

PSJ 予測統計値
(平均値)

2011年 2月 1日 公表

貸付債権担保住宅金融支援機構債券 / 貸付債権担保住宅金融公庫債券												
報告参加会員：みずほ、日興コーディアル、野村、三菱UFJモルガン・スタンレー、ゴールドマン・サックス、モルガン・スタンレー-MUFG、クレディスイス、ドイツ、バークレイズ・キャピタル、UBS、メリル Lynch 日本、大和証券キャピタルマーケット、新生、シティグループ												
回号	Yield Curve Scenarios (%)										最低 / 最高(%)	
	-300bp	-200bp	-100bp	-50bp	0bp	50bp	100bp	200bp	300bp			
JHF-1	13.70	12.62	10.89	9.64	8.68	7.95	7.35	6.78	6.49	6.79 / 10.84		
JHF-2	13.64	12.62	10.90	9.62	8.66	7.93	7.34	6.77	6.48	6.72 / 10.77		
JHF-3	13.80	12.77	11.00	9.70	8.72	7.98	7.38	6.79	6.51	6.94 / 10.94		
JHF-4	13.96	12.90	11.12	9.77	8.76	8.01	7.39	6.79	6.50	7.23 / 10.85		
JHF-5	14.38	13.29	11.38	10.01	8.92	8.12	7.50	6.83	6.52	7.45 / 11.27		
JHF-6	14.16	13.06	11.19	9.84	8.80	8.04	7.44	6.80	6.51	7.11 / 11.10		
JHF-7	13.36	12.37	10.57	9.36	8.48	7.82	7.28	6.74	6.47	6.32 / 10.58		
JHF-8	14.08	13.00	11.13	9.76	8.76	8.01	7.41	6.80	6.52	6.97 / 11.04		
JHF-9	13.52	12.50	10.66	9.41	8.54	7.87	7.32	6.78	6.50	6.44 / 10.68		
JHF-10	12.93	12.02	10.29	9.19	8.34	7.71	7.21	6.73	6.47	5.99 / 10.38		
JHF-11	13.45	12.48	10.71	9.46	8.54	7.86	7.32	6.79	6.51	6.32 / 10.83		
JHF-12	13.35	12.33	10.59	9.40	8.48	7.79	7.28	6.76	6.50	6.33 / 10.73		
JHF-13	13.17	12.24	10.49	9.29	8.43	7.78	7.27	6.77	6.51	6.21 / 10.77		
JHF-14	12.91	11.99	10.31	9.18	8.34	7.69	7.23	6.76	6.50	6.18 / 10.43		
JHF-15	14.18	13.14	11.22	9.85	8.82	8.04	7.45	6.85	6.56	7.29 / 11.42		
JHF-16	14.66	13.63	11.62	10.17	9.05	8.22	7.56	6.89	6.57	7.78 / 11.77		
JHF-17	14.29	13.25	11.29	9.93	8.88	8.14	7.53	6.90	6.60	7.29 / 11.55		
JHF-18	13.97	13.01	11.09	9.69	8.75	8.03	7.45	6.87	6.58	7.26 / 11.22		
JHF-19	13.24	12.30	10.48	9.30	8.45	7.81	7.31	6.81	6.54	6.49 / 10.50		
JHF-20	13.38	12.46	10.59	9.39	8.52	7.86	7.36	6.84	6.57	6.62 / 10.65		
JHF-21	13.74	12.78	10.84	9.55	8.64	7.95	7.41	6.86	6.59	6.96 / 11.01		
JHF-22	13.82	12.83	10.88	9.55	8.65	7.93	7.41	6.88	6.60	6.96 / 11.14		
JHF-23	14.41	13.39	11.33	9.87	8.90	8.09	7.54	6.93	6.64	7.49 / 11.60		
JHF-24	14.10	13.09	11.06	9.69	8.76	8.01	7.48	6.91	6.62	7.11 / 11.47		
JHF-25	14.09	13.08	11.04	9.70	8.76	8.03	7.50	6.93	6.65	7.35 / 11.31		
JHF-26	14.48	13.43	11.32	9.90	8.88	8.12	7.55	6.94	6.66	7.53 / 11.36		
JHF-27	14.08	13.05	11.02	9.68	8.73	8.02	7.49	6.93	6.65	6.98 / 11.17		
JHF-28	13.28	12.40	10.40	9.27	8.46	7.84	7.36	6.88	6.63	6.38 / 10.58		
JHF-29	13.08	12.20	10.34	9.14	8.40	7.79	7.35	6.89	6.63	6.29 / 10.40		
JHF-30	12.76	11.85	10.07	9.04	8.31	7.73	7.32	6.88	6.64	6.22 / 10.16		
JHF-31	12.62	11.81	10.00	8.94	8.26	7.70	7.31	6.89	6.64	6.11 / 9.98		
JHF-32	12.82	11.98	10.15	9.08	8.38	7.79	7.38	6.94	6.69	6.24 / 10.31		
JHF-33	12.59	11.77	10.01	8.93	8.26	7.72	7.33	6.92	6.68	6.05 / 10.02		
JHF-34	12.67	11.87	10.06	9.00	8.31	7.74	7.37	6.96	6.72	6.04 / 10.19		
JHF-35	11.42	10.64	9.17	8.32	7.83	7.43	7.16	6.82	6.60	5.65 / 9.14		
JHF-36	11.25	10.51	9.02	8.28	7.78	7.40	7.15	6.82	6.61	5.61 / 9.05		
JHF-37	11.26	10.53	9.01	8.26	7.80	7.43	7.17	6.84	6.63	5.69 / 9.14		
JHF-38	11.03	10.36	8.86	8.17	7.73	7.40	7.14	6.83	6.62	5.55 / 9.05		
JHF-39	10.72	10.00	8.73	8.03	7.67	7.36	7.13	6.84	6.63	5.42 / 8.95		
JHF-40	10.45	9.70	8.57	7.95	7.61	7.36	7.12	6.83	6.63	5.31 / 8.82		
JHF-41	10.18	9.51	8.39	7.88	7.54	7.28	7.10	6.81	6.63	5.22 / 8.73		
JHF-42	9.80	9.20	8.25	7.77	7.48	7.26	7.08	6.81	6.63	5.14 / 8.64		
JHF-43	9.96	9.35	8.29	7.85	7.53	7.28	7.11	6.83	6.65	5.18 / 8.68		
JHF-44	10.02	9.36	8.34	7.82	7.53	7.31	7.12	6.86	6.68	5.10 / 8.69		
JHF-45	10.42	9.69	8.51	8.00	7.62	7.35	7.16	6.87	6.69	5.35 / 8.78		
GHLC-1	11.69	11.26	10.60	9.35	8.02	6.89	6.00	4.95	4.51	4.44 / 10.30		
GHLC-2	11.94	11.38	10.53	9.31	7.99	6.90	6.09	5.08	4.66	4.91 / 10.04		
GHLC-3	11.92	11.28	10.41	9.17	7.85	6.81	6.06	5.12	4.71	5.30 / 9.78		
GHLC-4	12.08	11.50	10.63	9.29	7.98	6.91	6.16	5.24	4.82	5.73 / 9.78		
GHLC-5	12.04	11.55	10.67	9.29	8.00	6.93	6.19	5.29	4.90	5.65 / 9.48		
GHLC-6	12.24	11.68	10.72	9.34	8.02	6.99	6.27	5.40	5.01	6.00 / 9.59		

貸付債権担保住宅金融支援機構債券 / 貸付債権担保住宅金融公庫債券

報告参加会員：みずほ、日興コーディアル、野村、三菱UFJモルガン・スタンレー、ゴールドマン・サックス、モルガン・スタンレー-MUFG、クレディ・スイス、ドイツ・ハークレイズ・キャピタル、UBS、メルリッチ日本、大和証券キャピタルマーケット、新生、シティグループ

回号	Yield Curve Scenarios (%)									最低 / 最高(%)	
	-300bp	-200bp	-100bp	-50bp	0bp	50bp	100bp	200bp	300bp		
GHLC-7	12.21	11.62	10.69	9.24	7.94	6.91	6.20	5.36	4.98	6.00 /	9.27
GHLC-8	12.19	11.65	10.66	9.24	7.92	6.91	6.23	5.40	5.04	6.16 /	9.32
GHLC-9	12.04	11.46	10.51	9.04	7.75	6.82	6.15	5.37	5.03	6.16 /	9.29
GHLC-10	11.96	11.40	10.37	8.88	7.63	6.74	6.10	5.35	5.04	6.20 /	9.01
GHLC-11	11.78	11.26	10.10	8.67	7.47	6.66	6.08	5.39	5.10	6.12 /	9.28
GHLC-12	11.61	11.15	9.88	8.44	7.30	6.57	6.02	5.38	5.13	5.80 /	8.71
GHLC-13	11.73	11.25	10.05	8.56	7.41	6.65	6.07	5.42	5.15	5.73 /	9.16
GHLC-14	11.70	11.22	10.02	8.64	7.42	6.65	6.07	5.40	5.14	5.92 /	8.91
GHLC-15	11.76	11.24	10.03	8.55	7.40	6.65	6.07	5.42	5.15	5.80 /	8.89
GHLC-16	11.73	11.21	9.98	8.51	7.35	6.61	6.04	5.39	5.14	5.77 /	8.88
GHLC-17	11.71	11.23	10.00	8.52	7.39	6.64	6.08	5.44	5.17	5.80 /	8.88
GHLC-18	11.71	11.20	9.95	8.52	7.42	6.63	6.08	5.45	5.20	6.07 /	8.67
GHLC-19	11.64	11.17	9.82	8.43	7.37	6.59	6.06	5.44	5.19	5.96 /	8.58
GHLC-20	11.72	11.23	9.86	8.47	7.46	6.70	6.14	5.52	5.26	5.96 /	8.78
GHLC-21	11.74	11.24	9.86	8.49	7.46	6.70	6.16	5.55	5.29	5.93 /	8.70
GHLC-22	11.85	11.37	9.95	8.53	7.51	6.72	6.17	5.56	5.29	6.06 /	8.94
GHLC-23	11.94	11.36	9.97	8.54	7.55	6.76	6.20	5.58	5.32	6.03 /	8.95
GHLC-24	11.89	11.35	9.98	8.50	7.54	6.79	6.22	5.61	5.36	6.00 /	8.94
GHLC-25	11.74	11.21	9.75	8.40	7.48	6.78	6.22	5.62	5.36	5.97 /	8.97
GHLC-26	11.52	10.97	9.59	8.24	7.35	6.66	6.14	5.58	5.34	5.73 /	8.51
GHLC-27	10.88	10.39	8.95	8.00	7.17	6.55	6.08	5.60	5.37	5.37 /	8.80
GHLC-28	11.56	10.98	9.48	8.19	7.34	6.66	6.14	5.61	5.36	5.69 /	8.79
GHLC-29	10.82	10.25	8.96	7.95	7.15	6.53	6.07	5.60	5.37	5.31 /	8.89
GHLC-30	10.71	10.14	8.87	7.91	7.12	6.50	6.06	5.60	5.37	5.31 /	8.99
GHLC-31	10.62	10.09	8.80	7.83	7.05	6.45	6.03	5.59	5.36	5.18 /	8.77
GHLC-32	10.54	9.96	8.64	7.69	7.00	6.43	6.04	5.61	5.39	5.12 /	8.70
GHLC-33	10.77	10.19	8.89	7.90	7.10	6.50	6.07	5.61	5.37	5.18 /	8.85
GHLC-34	10.67	10.10	8.75	7.74	7.03	6.44	6.04	5.61	5.38	5.10 /	8.76
GHLC-35	10.71	10.17	8.83	7.81	7.07	6.46	6.05	5.61	5.38	5.16 /	8.82
GHLC-36	11.15	10.56	9.15	8.07	7.26	6.59	6.12	5.64	5.40	5.46 /	9.08
GHLC-37	11.14	10.45	9.04	8.00	7.22	6.57	6.11	5.64	5.39	5.38 /	9.02
GHLC-38	11.53	10.79	9.31	8.23	7.36	6.69	6.18	5.66	5.41	5.63 /	9.24
GHLC-39	11.35	10.65	9.15	8.13	7.27	6.62	6.12	5.64	5.39	5.47 /	8.95
GHLC-40	11.71	11.04	9.50	8.32	7.44	6.74	6.22	5.68	5.42	5.81 /	9.21
GHLC-41	11.29	10.59	9.17	8.12	7.28	6.64	6.14	5.65	5.40	5.56 /	9.00
GHLC-42	11.75	11.02	9.47	8.33	7.43	6.75	6.21	5.67	5.41	5.86 /	9.22
GHLC-43	12.20	11.42	9.82	8.53	7.62	6.89	6.31	5.74	5.46	6.09 /	9.44
GHLC-44	12.90	12.02	10.32	8.99	7.92	7.09	6.46	5.80	5.51	6.42 /	9.77
GHLC-45	12.60	11.80	10.06	8.75	7.75	6.97	6.35	5.73	5.45	6.25 /	9.54
GHLC-46	12.76	11.94	10.22	8.84	7.80	7.02	6.38	5.74	5.45	6.31 /	9.60
GHLC-47	12.87	11.96	10.18	8.82	7.79	7.01	6.40	5.74	5.44	6.29 /	9.54
GHLC-48	12.23	11.37	9.67	8.43	7.50	6.82	6.26	5.69	5.42	5.91 /	9.15
GHLC-49	12.28	11.37	9.63	8.44	7.50	6.82	6.26	5.68	5.42	5.87 /	9.10
GHLC-50	12.98	12.00	10.17	8.83	7.80	7.02	6.40	5.74	5.45	6.26 /	9.46
GHLC-51	12.58	11.63	9.84	8.51	7.59	6.87	6.30	5.70	5.42	5.97 /	9.15
GHLC-52	12.17	11.32	9.58	8.33	7.46	6.78	6.21	5.67	5.41	5.81 /	8.97
GHLC-53	12.47	11.54	9.78	8.50	7.55	6.85	6.27	5.69	5.43	5.93 /	9.08
JHF-S1	11.86	11.32	10.33	9.16	7.96	6.99	6.28	5.40	5.01	6.77 /	9.46
JHF-S2	11.85	11.33	10.28	9.11	7.94	6.97	6.27	5.40	5.01	6.76 /	9.28
JHF-S3	11.85	11.27	10.25	9.10	7.95	6.97	6.27	5.40	5.01	6.79 /	9.36
JHF-S4	11.75	11.20	10.13	8.87	7.70	6.83	6.18	5.41	5.09	6.39 /	9.06
JHF-S5	11.62	11.15	9.99	8.75	7.54	6.74	6.15	5.43	5.13	6.17 /	8.82
JHF-S6	11.67	11.13	10.02	8.77	7.58	6.75	6.14	5.43	5.12	6.18 /	8.85
JHF-S7	11.65	11.17	10.00	8.74	7.55	6.73	6.13	5.41	5.12	6.14 /	8.74
JHF-S8	11.34	10.88	9.62	8.27	7.26	6.56	6.04	5.45	5.20	5.68 /	8.28

貸付債権担保住宅金融支援機構債券 / 貸付債権担保住宅金融公庫債券

報告参加会員：みずほ、日興コーディアル、野村、三菱UFJモルガン・スタンレー、ゴールドマン・サックス、モルガン・スタンレー-MUFG、クレディ・スイス、ドイツ・ハークレイズ・キャピタル、UBS、メリリッジ日本、大和証券キャピタルマーケット、新生、シティグループ

回号	Yield Curve Scenarios (%)										最低 / 最高(%)	
	-300bp	-200bp	-100bp	-50bp	0bp	50bp	100bp	200bp	300bp			
JHF-S9	11.36	10.85	9.65	8.32	7.28	6.57	6.06	5.46	5.22	5.69 / 8.43		
JHF-S10	11.29	10.85	9.47	8.10	7.26	6.61	6.11	5.57	5.33	5.45 / 8.18		
JHF-S11	11.78	11.19	9.74	8.43	7.47	6.76	6.23	5.66	5.40	5.75 / 8.86		
JHF-S12	12.06	11.44	9.89	8.52	7.59	6.85	6.30	5.72	5.46	5.87 / 9.10		
JHF-S13	7.41	7.23	6.65	5.90	5.28	4.80	4.41	3.92	3.65	2.83 / 8.56		
JHF-S14	7.40	7.24	6.67	5.95	5.30	4.83	4.44	3.94	3.67	2.81 / 8.63		
JHF-S15	7.36	7.17	6.60	5.91	5.27	4.79	4.40	3.90	3.63	2.80 / 8.54		
JHF-S16	7.82	7.61	6.99	6.31	5.58	5.05	4.64	4.04	3.78	3.17 / 8.61		
JHF-S17	7.80	7.65	7.00	6.26	5.58	5.04	4.61	4.03	3.77	3.10 / 8.53		
JHF-S18	7.90	7.72	7.06	6.36	5.62	5.08	4.64	4.06	3.80	3.09 / 8.49		
GHLC-S1	11.49	10.98	10.06	8.91	7.79	6.85	6.07	5.09	4.66	6.34 / 9.72		
GHLC-S2	11.48	10.94	9.97	8.83	7.75	6.81	6.05	5.09	4.66	6.41 / 9.63		
GHLC-S3	11.52	11.00	10.04	8.91	7.82	6.85	6.09	5.12	4.70	6.43 / 9.59		
GHLC-S4	11.73	11.16	10.17	9.04	7.90	6.92	6.19	5.24	4.83	6.59 / 9.91		
GHLC-S5	11.70	11.09	10.15	8.99	7.88	6.90	6.17	5.24	4.81	6.66 / 9.82		
GHLC-S6	11.82	11.29	10.30	9.17	8.01	7.01	6.27	5.34	4.92	6.82 / 9.74		
GHLC-S7	11.78	11.24	10.31	9.14	7.98	6.97	6.25	5.33	4.90	6.86 / 9.63		
GHLC-S8	11.75	11.27	10.29	9.15	7.98	6.99	6.26	5.32	4.91	6.87 / 9.61		
GHLC-S9	11.74	11.26	10.29	9.14	7.97	6.97	6.25	5.33	4.91	6.90 / 9.49		
GHLC-S10	11.79	11.27	10.30	9.10	7.99	6.99	6.27	5.34	4.93	6.87 / 9.58		

1. 本資料に記載するPSJ予測統計値は、一定の要件を満たす金融商品取引業者（証券会社）から発表日（毎月1日及び15日、休業日の場合は翌営業日。以下同じ。）の前営業日の午後3時現在における予測期限前償還率をPSJモデルに換算した値（以下「PSJ予測値」。）について本協会が報告を受け、集計のうえ統計処理を行った数値です。
2. 本資料は、発表日の前営業日の午後3時現在におけるMBSのPSJ予測統計値の情報提供を唯一の目的としており、本資料に記載された金融商品への投資を推奨・勧誘するものではありません。最終的な投資判断は御自身でお願いいたします。
3. 本資料に記載するPSJ予測統計値は、発表日の前営業日の午後3時現在における経済・金融情勢や公表済みデータ等に基づくPSJ予測値により算出したものです。したがって、金融商品取引業者（証券会社）におけるPSJ予測値算出時以降に、前提条件等が変化した場合には、当然にPSJ予測統計値が異なる可能性があります。
4. 本資料に記載するPSJ予測統計値の算出に当たっては、一定の要件を満たす金融商品取引業者（証券会社）からPSJ予測値の報告を受けておりますが、当該金融商品取引業者（証券会社）は、本協会に対してPSJ予測値の正確性及び完全性を保証するものではありません。また、PSJ予測統計値について、本協会として、その正確性及び完全性に関して責任を負うものではありません。
5. 本協会は、個々の金融商品取引業者（証券会社）が算出するPSJ予測値についての御照会には応じかねますので、あらかじめ御了解ください。
6. 本協会は、本資料の欠落・誤謬等についてその責を負いかねますので御了承ください。