

PSJ 予測統計値
(平均値)

2010年 10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銀行・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、JPモルガン・バンク・レイズ・キャピタル、UBS、メリルリンチ日本、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			
JHF-1	13.75	12.89	11.64	10.32	9.18	8.28	7.62	6.86	6.55	7.10 / 11.56		
JHF-2	13.79	12.86	11.65	10.26	9.15	8.27	7.60	6.86	6.54	7.06 / 11.52		
JHF-3	13.89	13.04	11.72	10.42	9.23	8.32	7.64	6.88	6.56	7.31 / 11.67		
JHF-4	14.09	13.22	11.93	10.50	9.30	8.36	7.68	6.90	6.56	7.71 / 11.59		
JHF-5	14.54	13.58	12.23	10.79	9.50	8.51	7.81	6.94	6.60	8.00 / 12.03		
JHF-6	14.31	13.33	12.01	10.58	9.35	8.40	7.73	6.92	6.58	7.51 / 11.86		
JHF-7	13.44	12.60	11.36	10.06	8.95	8.15	7.53	6.83	6.54	6.57 / 11.32		
JHF-8	14.25	13.30	11.94	10.51	9.31	8.38	7.69	6.91	6.59	7.36 / 11.82		
JHF-9	13.66	12.81	11.46	10.08	9.01	8.19	7.57	6.87	6.57	6.70 / 11.41		
JHF-10	13.06	12.24	11.01	9.76	8.77	8.03	7.44	6.82	6.54	6.29 / 11.07		
JHF-11	13.58	12.80	11.48	10.12	9.02	8.20	7.56	6.88	6.59	6.66 / 11.59		
JHF-12	13.47	12.68	11.35	10.02	8.94	8.14	7.51	6.85	6.56	6.59 / 11.47		
JHF-13	13.32	12.53	11.25	9.92	8.88	8.11	7.49	6.86	6.57	6.45 / 11.54		
JHF-14	12.97	12.22	10.92	9.72	8.74	8.00	7.42	6.84	6.56	6.40 / 11.18		
JHF-15	14.43	13.57	12.14	10.68	9.40	8.45	7.72	6.97	6.64	7.80 / 12.23		
JHF-16	14.99	14.07	12.67	11.10	9.72	8.64	7.89	7.03	6.67	8.11 / 12.62		
JHF-17	14.58	13.70	12.30	10.76	9.48	8.52	7.84	7.02	6.69	7.87 / 12.41		
JHF-18	14.28	13.44	12.02	10.48	9.30	8.40	7.72	6.97	6.65	7.55 / 12.09		
JHF-19	13.46	12.64	11.26	9.98	8.91	8.15	7.53	6.90	6.62	6.77 / 11.32		
JHF-20	13.61	12.81	11.46	10.04	8.98	8.21	7.58	6.94	6.64	6.99 / 11.48		
JHF-21	14.05	13.24	11.79	10.35	9.16	8.32	7.67	6.98	6.68	7.40 / 11.83		
JHF-22	14.11	13.24	11.85	10.34	9.17	8.32	7.68	6.99	6.69	7.48 / 11.97		
JHF-23	14.87	13.94	12.44	10.80	9.51	8.52	7.83	7.05	6.73	8.10 / 12.48		
JHF-24	14.51	13.61	12.11	10.55	9.32	8.43	7.76	7.03	6.72	7.55 / 12.32		
JHF-25	14.50	13.61	12.06	10.51	9.30	8.41	7.75	7.03	6.72	7.55 / 12.23		
JHF-26	14.95	14.05	12.49	10.79	9.49	8.53	7.82	7.06	6.74	8.12 / 12.27		
JHF-27	14.51	13.65	12.11	10.53	9.31	8.44	7.77	7.06	6.74	7.52 / 12.07		
JHF-28	13.64	12.80	11.35	9.94	8.90	8.19	7.59	6.98	6.70	6.80 / 11.41		
JHF-29	13.44	12.65	11.14	9.81	8.84	8.15	7.57	7.00	6.73	6.59 / 11.22		
JHF-30	13.02	12.28	10.89	9.61	8.72	8.08	7.52	6.99	6.73	6.51 / 10.95		
JHF-31	12.83	12.12	10.68	9.51	8.65	8.02	7.50	6.99	6.73	6.41 / 10.75		
JHF-32	13.12	12.39	10.93	9.65	8.79	8.13	7.58	7.05	6.79	6.50 / 11.13		
JHF-33	12.78	12.04	10.67	9.49	8.66	8.04	7.53	7.04	6.78	6.40 / 10.82		
JHF-34	12.85	12.11	10.74	9.50	8.71	8.08	7.58	7.09	6.83	6.41 / 11.01		
JHF-35	11.51	10.82	9.65	8.71	8.12	7.66	7.29	6.93	6.71	6.02 / 9.73		
JHF-36	11.33	10.66	9.48	8.60	8.05	7.61	7.28	6.93	6.71	5.98 / 9.63		
JHF-37	11.35	10.75	9.47	8.61	8.07	7.64	7.29	6.93	6.72	6.02 / 9.70		
JHF-38	11.14	10.48	9.34	8.48	7.99	7.59	7.27	6.93	6.72	5.95 / 9.65		
JHF-39	10.84	10.17	9.10	8.34	7.89	7.54	7.25	6.93	6.73	5.76 / 9.60		
JHF-40	10.52	9.85	8.86	8.20	7.79	7.51	7.24	6.93	6.73	5.61 / 9.53		
JHF-41	10.21	9.60	8.67	8.06	7.68	7.38	7.16	6.88	6.69	5.46 / 9.51		
GHLC-1	12.42	11.81	11.26	10.24	8.87	7.56	6.52	5.33	4.78	4.89 / 11.09		
GHLC-2	12.50	11.88	11.30	10.23	8.83	7.50	6.50	5.36	4.85	5.31 / 11.03		
GHLC-3	12.49	11.88	11.25	10.18	8.76	7.46	6.48	5.41	4.91	5.59 / 10.61		
GHLC-4	12.61	12.03	11.45	10.30	8.82	7.50	6.54	5.48	5.00	5.86 / 10.81		
GHLC-5	12.59	12.02	11.49	10.29	8.82	7.53	6.57	5.54	5.08	5.84 / 10.75		
GHLC-6	12.70	12.12	11.49	10.26	8.81	7.54	6.61	5.61	5.16	6.16 / 10.64		
GHLC-7	12.67	12.10	11.47	10.26	8.76	7.49	6.57	5.59	5.14	6.08 / 10.33		
GHLC-8	12.68	12.11	11.45	10.19	8.70	7.47	6.57	5.61	5.18	6.26 / 10.29		
GHLC-9	12.49	11.93	11.31	10.03	8.52	7.33	6.48	5.59	5.18	6.26 / 10.23		
GHLC-10	12.44	11.90	11.21	9.84	8.39	7.24	6.44	5.58	5.20	6.41 / 10.06		

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、JPモルガン、バークレイズ・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	
GHLC-11	12.21	11.71	10.95	9.59	8.19	7.11	6.39	5.57	5.24	6.58 / 10.01
GHLC-12	12.02	11.49	10.73	9.36	7.98	6.99	6.33	5.58	5.27	6.33 / 9.45
GHLC-13	12.12	11.59	10.86	9.41	8.06	7.03	6.35	5.59	5.28	6.16 / 10.17
GHLC-14	12.17	11.61	10.88	9.53	8.13	7.08	6.40	5.60	5.27	6.48 / 9.92
GHLC-15	12.16	11.58	10.83	9.48	8.07	7.06	6.38	5.59	5.28	6.40 / 9.87
GHLC-16	12.14	11.66	10.82	9.40	8.04	7.05	6.38	5.61	5.30	6.13 / 9.84
GHLC-17	12.14	11.63	10.85	9.46	8.05	7.06	6.38	5.62	5.31	6.13 / 9.81
GHLC-18	12.11	11.61	10.80	9.39	8.04	7.05	6.39	5.63	5.33	6.46 / 9.62
GHLC-19	11.99	11.49	10.70	9.30	7.98	7.01	6.36	5.61	5.32	6.40 / 9.49
GHLC-20	12.13	11.60	10.69	9.34	8.02	7.12	6.44	5.68	5.39	6.22 / 9.60
GHLC-21	12.12	11.62	10.73	9.31	8.03	7.14	6.46	5.72	5.43	6.33 / 9.70
GHLC-22	12.24	11.73	10.85	9.42	8.10	7.17	6.49	5.72	5.42	6.50 / 9.96
GHLC-23	12.32	11.77	10.85	9.41	8.13	7.21	6.51	5.74	5.45	6.37 / 9.92
GHLC-24	12.33	11.75	10.81	9.38	8.12	7.22	6.54	5.78	5.49	6.27 / 9.96
GHLC-25	12.17	11.63	10.65	9.23	8.03	7.17	6.54	5.79	5.49	6.15 / 9.80
GHLC-26	11.93	11.39	10.46	9.06	7.88	7.06	6.42	5.73	5.45	6.06 / 9.35
GHLC-27	11.27	10.69	9.68	8.56	7.65	6.93	6.34	5.74	5.49	5.57 / 9.44
GHLC-28	11.94	11.37	10.35	8.97	7.86	7.06	6.44	5.76	5.48	5.94 / 9.54
GHLC-29	11.19	10.63	9.61	8.55	7.61	6.89	6.31	5.73	5.48	5.46 / 9.45
GHLC-30	11.02	10.49	9.52	8.50	7.57	6.86	6.29	5.72	5.48	5.48 / 9.53
GHLC-31	10.88	10.33	9.35	8.35	7.47	6.80	6.25	5.71	5.46	5.31 / 9.29
GHLC-32	10.64	10.08	9.18	8.19	7.39	6.75	6.23	5.72	5.48	5.22 / 9.18
GHLC-33	11.05	10.48	9.46	8.40	7.54	6.85	6.29	5.74	5.49	5.45 / 9.36
GHLC-34	10.77	10.24	9.24	8.25	7.43	6.75	6.23	5.72	5.49	5.33 / 9.23
GHLC-35	10.91	10.36	9.36	8.33	7.47	6.79	6.25	5.72	5.49	5.29 / 9.17
GHLC-36	11.37	10.73	9.68	8.57	7.67	6.91	6.35	5.77	5.51	5.60 / 9.43
GHLC-37	11.20	10.59	9.63	8.51	7.61	6.88	6.31	5.74	5.49	5.48 / 9.35
GHLC-38	11.67	11.07	9.93	8.77	7.80	7.03	6.42	5.79	5.52	5.82 / 9.55
GHLC-39	11.48	10.87	9.82	8.63	7.70	6.95	6.36	5.76	5.49	5.63 / 9.39
GHLC-40	12.05	11.37	10.24	9.02	7.95	7.14	6.49	5.82	5.53	6.24 / 9.74
GHLC-41	11.60	10.92	9.89	8.68	7.74	7.00	6.40	5.77	5.51	5.74 / 9.42
GHLC-42	12.04	11.34	10.22	9.01	7.95	7.14	6.49	5.81	5.52	6.28 / 9.75
GHLC-43	12.51	11.77	10.59	9.28	8.16	7.28	6.59	5.86	5.55	6.76 / 9.94
GHLC-44	13.17	12.41	11.20	9.77	8.51	7.53	6.77	5.93	5.59	7.21 / 10.33
GHLC-45	12.95	12.14	10.97	9.58	8.35	7.41	6.69	5.89	5.56	7.00 / 10.15
GHLC-46	13.07	12.30	11.06	9.62	8.41	7.45	6.73	5.90	5.56	7.04 / 10.16
GHLC-47	13.16	12.32	11.10	9.70	8.42	7.46	6.76	5.91	5.57	7.01 / 10.11
GHLC-48	12.46	11.72	10.49	9.14	8.05	7.20	6.58	5.84	5.54	6.28 / 9.61
GHLC-49	12.56	11.74	10.49	9.17	8.06	7.21	6.59	5.85	5.54	6.49 / 9.64
GHLC-50	13.23	12.39	11.10	9.67	8.43	7.47	6.76	5.92	5.57	6.98 / 10.25
GHLC-51	12.85	12.00	10.73	9.33	8.18	7.29	6.64	5.87	5.56	6.65 / 9.83
GHLC-52	12.41	11.64	10.39	9.12	8.01	7.17	6.54	5.83	5.54	6.36 / 9.52
GHLC-53	12.68	11.89	10.64	9.26	8.14	7.26	6.61	5.87	5.56	6.60 / 9.82
JHF-S1	12.43	11.82	11.11	9.98	8.72	7.56	6.65	5.64	5.16	7.13 / 10.22
JHF-S2	12.36	11.78	11.11	9.97	8.70	7.53	6.62	5.63	5.16	7.18 / 10.07
JHF-S3	12.38	11.81	11.06	9.95	8.70	7.54	6.64	5.63	5.16	7.18 / 10.14
JHF-S4	12.21	11.66	10.88	9.72	8.42	7.32	6.52	5.62	5.22	7.08 / 9.92
JHF-S5	12.03	11.50	10.77	9.50	8.23	7.17	6.44	5.60	5.24	6.78 / 9.70
JHF-S6	12.13	11.58	10.80	9.58	8.29	7.22	6.48	5.63	5.26	6.83 / 9.73
JHF-S7	12.08	11.58	10.74	9.54	8.26	7.20	6.46	5.61	5.25	6.79 / 9.61
JHF-S8	11.71	11.24	10.38	9.08	7.84	6.94	6.33	5.61	5.32	6.21 / 9.09
JHF-S9	11.70	11.23	10.38	9.12	7.85	6.96	6.34	5.62	5.33	6.23 / 9.13
JHF-S10	11.60	11.11	10.19	8.90	7.74	6.97	6.38	5.72	5.45	5.93 / 8.87
JHF-S11	12.09	11.52	10.53	9.16	7.99	7.16	6.50	5.80	5.51	6.31 / 9.58
JHF-S12	12.32	11.73	10.66	9.28	8.10	7.23	6.57	5.84	5.55	6.47 / 9.76

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、JPモルガン、バークレイズ・キャピタル、UBS、メリルリンチ日本、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		
JHF-S13	7.62	7.43	7.07	6.43	5.70	5.08	4.62	4.06	3.74	3.02	9.22
JHF-S14	7.58	7.40	7.06	6.41	5.70	5.09	4.63	4.07	3.76	3.00	9.10
JHF-S15	7.64	7.43	7.10	6.42	5.72	5.10	4.65	4.09	3.77	2.99	9.02
JHF-S16	8.09	7.91	7.51	6.83	6.07	5.39	4.88	4.21	3.91	3.40	9.07
JHF-S17	8.02	7.87	7.43	6.75	6.02	5.33	4.82	4.16	3.86	3.32	8.87
JHF-S18	8.09	7.85	7.46	6.81	6.05	5.36	4.84	4.17	3.87	3.31	8.78
GHLC-S1	12.10	11.48	10.83	9.77	8.60	7.44	6.52	5.40	4.88	6.51	10.84
GHLC-S2	12.03	11.38	10.73	9.71	8.53	7.40	6.50	5.39	4.87	6.59	10.95
GHLC-S3	12.07	11.46	10.83	9.82	8.59	7.43	6.52	5.42	4.91	6.58	10.90
GHLC-S4	12.25	11.68	10.99	9.92	8.68	7.50	6.58	5.51	5.02	6.70	10.91
GHLC-S5	12.20	11.63	10.97	9.91	8.66	7.50	6.56	5.51	5.01	6.74	10.86
GHLC-S6	12.37	11.77	11.10	10.02	8.78	7.60	6.65	5.59	5.09	6.89	10.50
GHLC-S7	12.33	11.78	11.12	9.99	8.77	7.58	6.65	5.58	5.09	6.91	10.49
GHLC-S8	12.36	11.77	11.07	10.05	8.77	7.58	6.65	5.59	5.09	6.98	10.47
GHLC-S9	12.31	11.76	11.08	10.01	8.75	7.57	6.63	5.58	5.09	6.99	10.44
GHLC-S10	12.31	11.76	11.09	10.01	8.76	7.59	6.65	5.59	5.10	7.02	10.44

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。