

PSJ 予測統計値
(平均値)

2009年 4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：新光,野村,三菱UFJ,ゴールドマン・サックス,メガバンク,クレディ・スイス,ドイツ,JPモルガン,みずほ,UBS,メリル・リンチ日本,大和SMBC,新生,日興フィグループ											
回号	Yield Curve Scenarios (%)										最低 / 最高(%)
	-300bp	-200bp	-100bp	-50bp	0bp	50bp	100bp	200bp	300bp		
JHF-1	13.48	12.86	11.29	9.91	8.92	8.22	7.64	7.05	6.73	7.31 / 12.08	
JHF-2	13.41	12.77	11.31	9.94	8.91	8.21	7.63	7.05	6.73	7.30 / 12.01	
JHF-3	13.58	12.98	11.43	10.01	8.98	8.26	7.68	7.09	6.76	7.35 / 12.23	
JHF-4	13.80	13.18	11.55	10.08	9.04	8.31	7.71	7.11	6.77	7.37 / 12.20	
JHF-5	14.20	13.59	11.89	10.35	9.18	8.43	7.80	7.14	6.79	7.45 / 12.63	
JHF-6	13.97	13.33	11.62	10.16	9.08	8.36	7.76	7.11	6.78	7.39 / 12.38	
JHF-7	13.15	12.61	11.03	9.76	8.84	8.17	7.62	7.07	6.75	7.26 / 11.83	
JHF-8	13.90	13.27	11.62	10.12	9.08	8.33	7.75	7.13	6.80	7.36 / 12.38	
JHF-9	13.41	12.82	11.20	9.86	8.91	8.23	7.68	7.11	6.79	7.28 / 11.99	
JHF-10	12.86	12.28	10.83	9.61	8.76	8.10	7.60	7.08	6.78	7.22 / 11.68	
JHF-11	13.43	12.87	11.27	9.90	8.96	8.27	7.72	7.15	6.83	7.32 / 12.27	
JHF-12	13.41	12.79	11.13	9.87	8.93	8.23	7.70	7.15	6.83	7.30 / 12.18	
JHF-13	13.27	12.67	11.10	9.85	8.93	8.24	7.71	7.17	6.86	7.30 / 12.31	
JHF-14	13.00	12.43	10.89	9.66	8.83	8.14	7.67	7.16	6.85	7.28 / 11.93	
JHF-15	14.50	13.87	12.04	10.49	9.33	8.53	7.93	7.29	6.95	7.51 / 13.10	
JHF-16	15.30	14.62	12.62	10.89	9.56	8.72	8.06	7.35	6.98	7.62 / 13.58	
JHF-17	14.74	14.09	12.18	10.58	9.44	8.67	8.03	7.36	7.01	7.54 / 13.37	
JHF-18	14.51	13.79	11.97	10.44	9.33	8.57	7.97	7.34	7.00	7.49 / 13.02	
JHF-19	13.64	12.99	11.25	9.96	9.06	8.36	7.83	7.28	6.96	7.38 / 12.16	
JHF-20	13.78	13.20	11.41	10.10	9.14	8.43	7.88	7.32	7.00	7.42 / 12.40	
JHF-21	14.34	13.74	11.83	10.34	9.31	8.55	7.98	7.38	7.04	7.48 / 12.91	
JHF-22	14.44	13.74	11.82	10.34	9.33	8.55	8.00	7.39	7.06	7.50 / 13.02	
JHF-23	15.13	14.47	12.38	10.73	9.53	8.69	8.09	7.43	7.07	7.59 / 13.54	
GHLC-1	12.51	11.87	10.79	9.14	7.77	6.73	5.95	5.07	4.67	5.70 / 10.00	
GHLC-2	12.53	11.96	10.81	9.13	7.76	6.73	5.97	5.11	4.72	5.66 / 9.83	
GHLC-3	12.62	12.01	10.82	9.15	7.76	6.72	6.00	5.15	4.77	5.65 / 9.75	
GHLC-4	12.42	11.85	10.63	8.95	7.66	6.69	6.00	5.21	4.84	5.40 / 9.84	
GHLC-5	12.33	11.79	10.56	8.90	7.65	6.71	6.05	5.26	4.92	5.41 / 9.84	
GHLC-6	12.68	12.11	10.83	9.14	7.85	6.88	6.19	5.39	5.04	5.44 / 9.61	
GHLC-7	12.70	12.14	10.82	9.10	7.82	6.86	6.17	5.39	5.03	5.41 / 9.47	
GHLC-8	12.71	12.14	10.81	9.15	7.85	6.89	6.22	5.42	5.07	5.45 / 9.56	
GHLC-9	12.64	12.06	10.71	9.02	7.79	6.84	6.20	5.43	5.10	5.42 / 9.37	
GHLC-10	12.52	12.01	10.58	8.92	7.72	6.82	6.19	5.46	5.13	5.38 / 9.28	
GHLC-11	12.37	11.82	10.37	8.78	7.62	6.79	6.19	5.49	5.18	5.33 / 9.27	
GHLC-12	12.13	11.60	10.12	8.59	7.51	6.73	6.18	5.53	5.23	5.28 / 8.96	
GHLC-13	12.26	11.73	10.27	8.72	7.58	6.77	6.19	5.55	5.24	5.35 / 9.26	
GHLC-14	12.34	11.76	10.34	8.79	7.61	6.80	6.21	5.54	5.22	5.37 / 9.15	
GHLC-15	12.31	11.73	10.30	8.76	7.61	6.80	6.22	5.55	5.23	5.34 / 9.14	
GHLC-16	12.28	11.75	10.27	8.69	7.59	6.79	6.22	5.56	5.26	5.31 / 9.08	
GHLC-17	12.29	11.71	10.29	8.75	7.61	6.82	6.24	5.59	5.27	5.37 / 9.16	
GHLC-18	12.25	11.66	10.22	8.67	7.57	6.79	6.23	5.58	5.28	5.37 / 9.15	
GHLC-19	12.18	11.68	10.16	8.74	7.61	6.81	6.24	5.60	5.30	5.37 / 9.10	
GHLC-20	12.20	11.65	10.21	8.76	7.67	6.87	6.30	5.66	5.35	5.42 / 9.16	
GHLC-21	12.21	11.65	10.19	8.74	7.71	6.90	6.34	5.71	5.40	5.48 / 9.45	
GHLC-22	12.30	11.79	10.29	8.85	7.74	6.93	6.35	5.71	5.40	5.56 / 9.65	
GHLC-23	12.40	11.86	10.34	8.87	7.79	6.96	6.38	5.74	5.42	5.58 / 9.69	
GHLC-24	12.32	11.78	10.28	8.88	7.78	6.98	6.39	5.76	5.45	5.62 / 9.66	
GHLC-25	12.10	11.57	10.14	8.75	7.70	6.96	6.37	5.76	5.45	5.60 / 9.47	
GHLC-26	11.90	11.32	9.86	8.57	7.55	6.82	6.28	5.69	5.40	5.44 / 9.16	
GHLC-27	11.24	10.68	9.40	8.23	7.37	6.70	6.21	5.70	5.42	5.52 / 8.81	
GHLC-28	11.81	11.21	9.79	8.54	7.53	6.81	6.29	5.72	5.43	5.49 / 9.04	

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：新光、野村、三菱UFJ、ゴールドマン・サックス、モルガン・スタンレー、クレディ・スイス、ドイツ、JPモルガン、みずほ、UBS、メリル・リンチ日本、大和SMBC、新生、日興フィグループ

回号	Yield Curve Scenarios (%)									最低 / 最高(%)	
	-300bp	-200bp	-100bp	-50bp	0bp	50bp	100bp	200bp	300bp		
GHLC-29	11.17	10.63	9.36	8.25	7.38	6.71	6.24	5.75	5.47	5.53 /	8.90
GHLC-30	11.01	10.48	9.27	8.18	7.33	6.66	6.20	5.72	5.44	5.55 /	9.02
GHLC-31	10.87	10.30	9.10	8.01	7.22	6.58	6.15	5.68	5.41	5.47 /	8.70
GHLC-32	10.60	10.05	8.94	7.89	7.14	6.54	6.13	5.68	5.42	5.44 /	8.45
GHLC-33	10.93	10.40	9.26	8.13	7.29	6.63	6.19	5.71	5.44	5.54 /	8.75
GHLC-34	10.65	10.15	9.02	7.96	7.16	6.54	6.14	5.69	5.42	5.46 /	8.49
GHLC-35	10.74	10.21	9.07	7.98	7.19	6.56	6.15	5.69	5.43	5.47 /	8.53
GHLC-36	11.24	10.68	9.40	8.28	7.37	6.70	6.23	5.73	5.45	5.55 /	9.06
GHLC-37	11.08	10.57	9.35	8.17	7.32	6.66	6.21	5.72	5.44	5.53 /	8.90
GHLC-38	11.43	10.91	9.58	8.34	7.46	6.77	6.27	5.75	5.46	5.59 /	9.20
GHLC-39	11.29	10.75	9.47	8.32	7.40	6.72	6.25	5.74	5.46	5.57 /	9.11
GHLC-40	11.82	11.25	9.88	8.58	7.60	6.87	6.34	5.79	5.49	5.65 /	9.50
GHLC-41	11.42	10.84	9.48	8.33	7.43	6.77	6.27	5.75	5.47	5.58 /	9.20
GHLC-42	11.88	11.23	9.87	8.56	7.60	6.89	6.35	5.80	5.49	5.69 /	9.62
GHLC-43	12.28	11.65	10.15	8.78	7.75	7.00	6.42	5.83	5.52	5.79 /	9.95
GHLC-44	13.10	12.40	10.78	9.25	8.05	7.21	6.58	5.90	5.57	5.95 /	10.65
GHLC-45	12.79	12.12	10.50	9.07	7.93	7.13	6.52	5.88	5.55	5.87 /	10.36
GHLC-46	12.92	12.21	10.62	9.15	7.97	7.17	6.55	5.89	5.55	5.91 /	10.59
GHLC-47	12.95	12.29	10.60	9.13	7.97	7.19	6.57	5.88	5.54	5.89 /	10.47
GHLC-48	12.17	11.63	10.04	8.69	7.71	7.02	6.44	5.84	5.52	5.72 /	9.98
GHLC-49	12.24	11.58	10.04	8.69	7.69	7.01	6.42	5.83	5.51	5.72 /	9.94
GHLC-50	13.00	12.34	10.66	9.17	7.99	7.22	6.59	5.91	5.57	5.90 /	10.62
GHLC-51	12.51	11.87	10.27	8.85	7.80	7.08	6.47	5.86	5.54	5.79 /	10.16
GHLC-52	12.13	11.56	9.99	8.69	7.67	6.97	6.40	5.83	5.52	5.73 /	9.86
GHLC-53	12.44	11.80	10.20	8.83	7.78	7.06	6.46	5.87	5.55	5.77 /	10.19
JHF-S1	12.53	11.93	10.69	9.13	7.86	6.90	6.20	5.38	5.01	5.31 /	9.47
JHF-S2	12.49	11.90	10.66	9.06	7.86	6.89	6.19	5.38	5.01	5.33 /	9.33
JHF-S3	12.52	11.94	10.68	9.08	7.88	6.91	6.22	5.40	5.03	5.35 /	9.40
JHF-S4	12.36	11.85	10.49	8.96	7.76	6.85	6.21	5.46	5.12	5.28 /	9.16
JHF-S5	12.19	11.62	10.25	8.75	7.61	6.77	6.17	5.48	5.15	5.22 /	8.90
JHF-S6	12.25	11.68	10.31	8.79	7.66	6.80	6.20	5.48	5.17	5.24 /	8.93
JHF-S7	12.24	11.72	10.32	8.78	7.65	6.80	6.20	5.48	5.16	5.24 /	8.90
JHF-S8	11.64	11.19	9.75	8.37	7.36	6.64	6.13	5.54	5.26	5.18 /	8.64
JHF-S9	11.64	11.20	9.73	8.36	7.37	6.65	6.14	5.54	5.27	5.20 /	8.66
JHF-S10	11.35	10.90	9.45	8.25	7.35	6.66	6.18	5.64	5.37	5.29 /	8.63
JHF-S11	11.93	11.43	9.92	8.62	7.64	6.89	6.36	5.77	5.48	5.49 /	9.25
JHF-S12	12.16	11.65	10.15	8.75	7.76	7.00	6.45	5.85	5.55	5.57 /	9.75
GHLC-S1	12.37	11.87	10.64	9.15	7.83	6.84	6.07	5.17	4.76	5.54 /	10.00
GHLC-S2	12.32	11.73	10.57	9.07	7.79	6.81	6.05	5.17	4.77	5.49 /	9.95
GHLC-S3	12.37	11.82	10.60	9.12	7.81	6.82	6.06	5.19	4.78	5.54 /	9.87
GHLC-S4	12.38	11.85	10.59	9.08	7.83	6.83	6.11	5.25	4.86	5.45 /	9.84
GHLC-S5	12.37	11.77	10.56	9.06	7.80	6.80	6.09	5.24	4.84	5.43 /	9.72
GHLC-S6	12.48	11.95	10.72	9.12	7.88	6.88	6.17	5.32	4.93	5.38 /	9.72
GHLC-S7	12.43	11.91	10.69	9.16	7.86	6.87	6.16	5.31	4.92	5.39 /	9.59
GHLC-S8	12.40	11.89	10.63	9.14	7.86	6.87	6.15	5.31	4.93	5.38 /	9.58
GHLC-S9	12.46	11.86	10.67	9.10	7.85	6.85	6.14	5.29	4.92	5.38 /	9.48
GHLC-S10	12.41	11.88	10.66	9.13	7.85	6.85	6.15	5.30	4.92	5.37 /	9.52

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（年始の最初の発表は、年末の最終営業日の午前11時現在、以下同じ。）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。