

PSJ 予測統計値
(中央値)

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、ゴールドマン・サックス、住友銀行、三井住友銀行、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-1	13.36	13.08	11.85	10.24	9.27	8.12	7.45	7.20	6.80	7.10 / 11.56		
JHF-2	13.89	12.99	11.83	10.03	9.28	8.18	7.46	7.20	6.79	7.06 / 11.52		
JHF-3	13.79	13.36	11.93	10.43	9.31	8.21	7.49	7.23	6.82	7.31 / 11.67		
JHF-4	14.09	13.49	12.09	10.27	9.42	8.27	7.51	7.22	6.82	7.71 / 11.59		
JHF-5	14.40	13.89	12.25	10.62	9.46	8.36	7.59	7.25	6.82	8.00 / 12.03		
JHF-6	14.50	13.57	12.21	10.46	9.49	8.35	7.56	7.23	6.83	7.51 / 11.86		
JHF-7	13.65	12.70	11.27	10.03	9.27	8.20	7.54	7.11	6.80	6.57 / 11.32		
JHF-8	14.58	13.44	12.05	10.32	9.52	8.35	7.66	7.25	6.82	7.36 / 11.82		
JHF-9	13.78	13.78	11.45	10.05	9.29	8.30	7.66	7.13	6.83	6.70 / 11.41		
JHF-10	13.08	12.68	10.98	9.74	9.02	8.14	7.61	7.03	6.73	6.29 / 11.07		
JHF-11	13.89	13.63	11.39	10.02	9.28	8.25	7.65	7.10	6.82	6.66 / 11.59		
JHF-12	13.98	13.50	11.22	9.92	9.19	8.25	7.55	7.07	6.80	6.59 / 11.47		
JHF-13	13.75	13.29	11.10	9.84	9.13	8.19	7.57	7.05	6.80	6.45 / 11.54		
JHF-14	12.53	12.53	10.73	9.66	8.75	8.20	7.56	7.03	6.74	6.40 / 11.18		
JHF-15	14.25	14.08	11.93	10.33	9.54	8.51	7.69	7.28	6.83	7.80 / 12.23		
JHF-16	14.41	14.41	12.46	10.69	9.75	8.63	7.80	7.38	6.88	8.11 / 12.62		
JHF-17	14.20	14.04	12.16	10.42	9.56	8.58	7.79	7.26	6.90	7.87 / 12.41		
JHF-18	14.09	14.04	11.88	10.16	9.41	8.54	7.72	7.14	6.89	7.55 / 12.09		
JHF-19	13.71	13.05	11.17	9.79	8.98	8.22	7.65	7.09	6.76	6.77 / 11.32		
JHF-20	13.73	13.08	11.32	9.84	9.00	8.23	7.71	7.10	6.79	6.99 / 11.48		
JHF-21	13.85	13.46	11.71	9.97	9.14	8.33	7.73	7.14	6.83	7.40 / 11.83		
JHF-22	13.81	13.35	11.71	9.96	9.13	8.28	7.74	7.09	6.83	7.48 / 11.97		
JHF-23	14.44	14.10	12.36	10.25	9.40	8.39	7.81	7.14	6.90	8.10 / 12.48		
JHF-24	13.96	13.90	12.05	10.07	9.24	8.36	7.76	7.15	6.86	7.55 / 12.32		
JHF-25	14.05	13.89	12.06	10.05	9.17	8.32	7.76	7.16	6.84	7.55 / 12.23		
JHF-26	14.73	14.10	12.52	10.24	9.22	8.39	7.81	7.11	6.85	8.12 / 12.27		
JHF-27	14.26	13.85	11.94	10.11	9.12	8.33	7.81	7.11	6.88	7.52 / 12.07		
JHF-28	13.52	13.16	10.91	9.68	8.76	8.11	7.56	7.05	6.77	6.80 / 11.41		
JHF-29	13.44	12.95	10.58	9.58	8.73	8.10	7.73	7.21	6.80	6.59 / 11.22		
JHF-30	13.20	12.57	10.29	9.43	8.64	8.05	7.73	7.19	6.80	6.51 / 10.95		
JHF-31	12.63	12.28	10.20	9.34	8.56	8.01	7.74	7.14	6.81	6.41 / 10.75		
JHF-32	13.13	12.50	10.56	9.51	8.69	8.10	7.78	7.24	6.80	6.50 / 11.13		
JHF-33	12.56	12.11	10.21	9.33	8.54	8.04	7.78	7.18	6.85	6.40 / 10.82		
JHF-34	12.63	12.06	10.25	9.38	8.62	8.10	7.78	7.21	6.89	6.41 / 11.01		
JHF-35	11.92	10.27	9.07	8.53	8.06	7.84	7.34	6.89	6.51	6.02 / 9.73		
JHF-36	11.61	10.16	8.93	8.43	8.05	7.83	7.33	6.86	6.50	5.98 / 9.63		
JHF-37	11.71	10.11	8.98	8.43	8.09	7.86	7.34	6.86	6.51	6.02 / 9.70		
JHF-38	11.37	9.89	8.82	8.27	8.05	7.83	7.26	6.81	6.51	5.95 / 9.65		
JHF-39	10.93	9.66	8.68	8.26	8.02	7.83	7.20	6.77	6.51	5.76 / 9.60		
JHF-40	10.52	9.41	8.56	8.19	7.97	7.83	7.34	6.73	6.51	5.61 / 9.53		
JHF-41	10.20	9.10	8.30	8.08	7.81	7.50	7.06	6.69	6.50	5.46 / 9.51		
GHLC-1	12.63	12.63	12.55	11.01	9.41	7.34	6.56	5.73	5.05	4.89 / 11.09		
GHLC-2	12.62	12.62	12.43	10.83	8.90	7.13	6.60	5.77	5.08	5.31 / 11.03		
GHLC-3	12.71	12.71	12.46	10.72	8.63	7.15	6.65	5.68	5.07	5.59 / 10.61		
GHLC-4	12.41	12.41	12.12	10.64	9.29	7.51	6.53	5.64	5.04	5.86 / 10.81		
GHLC-5	12.48	12.48	12.24	10.53	8.85	7.23	6.59	5.71	5.13	5.84 / 10.75		
GHLC-6	12.73	12.73	12.02	10.42	8.93	7.43	6.65	5.75	5.12	6.16 / 10.64		
GHLC-7	12.93	12.93	12.13	10.47	9.07	7.62	6.68	5.65	5.12	6.08 / 10.33		
GHLC-8	12.88	12.88	12.19	10.43	9.04	7.54	6.71	5.73	5.13	6.26 / 10.29		
GHLC-9	12.90	12.90	11.97	10.16	8.77	7.33	6.73	5.67	5.11	6.26 / 10.23		
GHLC-10	12.72	12.72	11.70	9.85	8.69	7.24	6.62	5.63	5.14	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	12.36	12.36	11.17	9.56	8.31	7.13	6.49	5.55	5.25	6.58 / 10.01
GHLC-12	12.18	12.18	10.68	9.25	8.08	7.14	6.40	5.53	5.32	6.33 / 9.45
GHLC-13	12.29	12.29	10.93	9.35	8.06	7.19	6.45	5.56	5.34	6.16 / 10.17
GHLC-14	12.34	12.34	11.05	9.43	8.11	7.26	6.49	5.60	5.30	6.48 / 9.92
GHLC-15	12.25	12.25	10.82	9.33	8.01	7.22	6.45	5.57	5.38	6.40 / 9.87
GHLC-16	12.23	12.23	10.93	9.30	8.08	7.19	6.44	5.53	5.37	6.13 / 9.84
GHLC-17	12.20	12.20	10.81	9.29	8.08	7.17	6.43	5.54	5.40	6.13 / 9.81
GHLC-18	12.09	12.09	10.76	9.27	8.02	7.16	6.43	5.58	5.45	6.46 / 9.62
GHLC-19	11.98	11.98	10.51	9.15	7.94	7.08	6.39	5.58	5.49	6.40 / 9.49
GHLC-20	11.96	11.96	10.44	9.14	7.99	7.12	6.38	5.73	5.53	6.22 / 9.60
GHLC-21	11.92	11.92	10.49	9.18	7.98	7.17	6.38	5.73	5.58	6.33 / 9.70
GHLC-22	12.12	12.12	10.79	9.30	8.04	7.24	6.47	5.71	5.54	6.50 / 9.96
GHLC-23	12.12	12.12	10.73	9.30	7.96	7.24	6.46	5.77	5.60	6.37 / 9.92
GHLC-24	12.04	12.04	10.63	9.27	7.96	7.27	6.48	5.85	5.66	6.27 / 9.96
GHLC-25	11.82	11.82	10.39	9.18	7.89	7.29	6.63	5.95	5.61	6.15 / 9.80
GHLC-26	11.62	11.62	9.91	8.90	7.93	7.13	6.50	5.86	5.50	6.06 / 9.35
GHLC-27	10.48	10.48	9.48	8.15	7.65	7.11	6.54	5.96	5.54	5.57 / 9.44
GHLC-28	11.41	11.41	9.85	8.88	7.76	7.21	6.49	5.93	5.52	5.94 / 9.54
GHLC-29	10.38	10.38	9.44	8.14	7.66	7.14	6.41	6.01	5.56	5.46 / 9.45
GHLC-30	10.24	10.22	9.41	8.21	7.68	7.19	6.39	5.97	5.60	5.48 / 9.53
GHLC-31	10.26	9.94	9.20	8.04	7.49	6.98	6.47	5.89	5.52	5.31 / 9.29
GHLC-32	10.22	9.59	9.02	7.96	7.40	6.82	6.51	5.89	5.52	5.22 / 9.18
GHLC-33	10.47	10.20	9.28	8.07	7.62	6.97	6.55	5.93	5.58	5.45 / 9.36
GHLC-34	10.36	10.00	9.06	8.00	7.57	6.81	6.47	5.89	5.46	5.33 / 9.23
GHLC-35	10.41	10.25	9.15	8.05	7.62	6.97	6.48	5.91	5.45	5.29 / 9.17
GHLC-36	11.01	10.73	9.38	8.18	7.70	7.10	6.47	5.99	5.56	5.60 / 9.43
GHLC-37	10.84	10.64	9.27	8.11	7.65	7.10	6.46	5.94	5.49	5.48 / 9.35
GHLC-38	11.58	10.90	9.52	8.28	7.79	7.27	6.53	6.00	5.56	5.82 / 9.55
GHLC-39	11.29	10.66	9.38	8.22	7.74	7.18	6.51	5.98	5.55	5.63 / 9.39
GHLC-40	11.84	11.42	9.80	8.43	7.87	7.38	6.51	6.04	5.60	6.24 / 9.74
GHLC-41	11.34	10.80	9.43	8.26	7.76	7.21	6.55	5.99	5.56	5.74 / 9.42
GHLC-42	11.87	11.17	9.84	8.50	7.93	7.40	6.54	6.06	5.61	6.28 / 9.75
GHLC-43	12.38	11.59	10.43	8.71	8.10	7.49	6.70	6.13	5.61	6.76 / 9.94
GHLC-44	13.07	12.61	11.23	9.33	8.31	7.57	6.70	6.19	5.65	7.21 / 10.33
GHLC-45	13.05	12.00	10.85	9.01	8.22	7.55	6.88	6.17	5.60	7.00 / 10.15
GHLC-46	12.48	12.21	10.83	8.97	8.26	7.64	7.05	6.17	5.63	7.04 / 10.16
GHLC-47	12.84	12.12	10.92	9.05	8.27	7.65	7.04	6.17	5.58	7.01 / 10.11
GHLC-48	12.58	11.54	9.99	8.61	7.99	7.35	6.70	6.02	5.58	6.28 / 9.61
GHLC-49	12.87	11.66	9.98	8.65	7.98	7.36	6.71	6.01	5.58	6.49 / 9.64
GHLC-50	12.95	12.40	10.82	9.08	8.31	7.67	7.06	6.18	5.64	6.98 / 10.25
GHLC-51	13.33	12.09	10.28	8.84	8.10	7.50	6.84	6.06	5.58	6.65 / 9.83
GHLC-52	12.22	11.60	9.82	8.62	7.89	7.27	6.66	5.91	5.60	6.36 / 9.52
GHLC-53	12.54	11.92	10.15	8.75	8.02	7.37	6.81	6.00	5.66	6.60 / 9.82
JHF-S1	12.22	12.22	11.05	10.15	8.70	7.50	6.50	5.66	5.27	7.13 / 10.22
JHF-S2	12.21	12.21	11.02	10.15	8.71	7.44	6.47	5.66	5.29	7.18 / 10.07
JHF-S3	12.24	12.24	11.03	10.09	8.72	7.43	6.51	5.65	5.29	7.18 / 10.14
JHF-S4	12.04	12.04	10.72	9.34	8.40	7.08	6.57	5.65	5.47	7.08 / 9.92
JHF-S5	11.90	11.90	10.38	9.15	8.30	7.01	6.45	5.69	5.50	6.78 / 9.70
JHF-S6	11.95	11.95	10.50	9.19	8.36	7.04	6.47	5.71	5.49	6.83 / 9.73
JHF-S7	11.98	11.98	10.38	9.16	8.32	7.06	6.44	5.67	5.49	6.79 / 9.61
JHF-S8	11.66	11.66	9.62	8.71	7.97	6.88	6.26	5.81	5.39	6.21 / 9.09
JHF-S9	11.68	11.68	9.64	8.71	7.98	6.89	6.27	5.83	5.42	6.23 / 9.13
JHF-S10	11.12	11.12	9.32	8.51	7.70	7.11	6.31	5.98	5.42	5.93 / 8.87
JHF-S11	11.55	11.55	9.76	8.84	8.03	7.48	6.48	6.07	5.56	6.31 / 9.58
JHF-S12	11.78	11.78	9.98	8.95	8.08	7.38	6.70	6.14	5.61	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	7.50	7.50	7.49	6.98	6.42	5.43	4.91	4.52	3.73	3.02	/	9.22
JHF-S14	7.55	7.55	7.54	7.02	6.47	5.47	4.92	4.48	3.74	3.00	/	9.10
JHF-S15	7.60	7.60	7.58	7.06	6.48	5.50	4.93	4.53	3.77	2.99	/	9.02
JHF-S16	7.99	7.92	7.84	7.15	6.77	5.77	5.09	4.63	3.88	3.40	/	9.07
JHF-S17	7.98	7.90	7.79	7.20	6.74	5.74	5.01	4.65	3.90	3.32	/	8.87
JHF-S18	7.96	7.94	7.84	7.24	6.74	5.74	5.09	4.64	3.91	3.31	/	8.78
GHLC-S1	11.80	11.80	11.37	9.86	8.24	7.05	6.47	5.69	5.06	6.51	/	10.84
GHLC-S2	11.67	11.67	11.20	9.85	7.98	6.76	6.40	5.66	5.07	6.59	/	10.95
GHLC-S3	11.79	11.79	11.34	9.85	8.21	7.00	6.41	5.70	5.07	6.58	/	10.90
GHLC-S4	11.84	11.84	11.29	9.83	8.37	7.04	6.47	5.76	5.12	6.70	/	10.91
GHLC-S5	11.77	11.77	11.15	9.84	8.45	7.10	6.42	5.76	5.15	6.74	/	10.86
GHLC-S6	12.14	12.14	11.24	10.06	8.80	7.76	6.46	5.67	5.15	6.89	/	10.50
GHLC-S7	12.09	12.09	11.22	10.03	8.78	7.65	6.46	5.66	5.14	6.91	/	10.49
GHLC-S8	12.02	12.02	11.13	9.97	8.78	7.68	6.46	5.69	5.13	6.98	/	10.47
GHLC-S9	12.07	12.07	11.14	10.01	8.78	7.62	6.46	5.70	5.12	6.99	/	10.44
GHLC-S10	12.04	12.04	11.09	9.97	8.74	7.60	6.46	5.72	5.13	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。