

2011年 10月 3日 公表

2011年 10月 3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, SMBC日興, 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, アール・ビー・エス, 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											
回号	Yield Curve Scenarios (%)										最低 / 最高 (%)
	-300bp	-200bp	-100bp	-50bp	0bp	50bp	100bp	200bp	300bp		
JHF-1	13.37	13.00	11.81	10.48	9.30	8.45	7.80	7.09	6.72	7.90 / 11.13	
JHF-2	13.37	12.93	11.73	10.42	9.26	8.41	7.77	7.06	6.71	7.91 / 11.03	
JHF-3	13.41	12.96	11.86	10.49	9.31	8.45	7.81	7.09	6.73	7.91 / 11.07	
JHF-4	13.57	13.14	11.91	10.52	9.38	8.50	7.85	7.11	6.73	7.95 / 11.13	
JHF-5	13.93	13.43	12.26	10.83	9.58	8.66	7.98	7.18	6.78	7.95 / 11.31	
JHF-6	13.75	13.28	12.06	10.68	9.46	8.57	7.92	7.15	6.77	7.99 / 11.10	
JHF-7	13.19	12.74	11.51	10.20	9.11	8.33	7.73	7.06	6.72	7.88 / 10.61	
JHF-8	13.76	13.31	12.06	10.64	9.43	8.55	7.88	7.14	6.78	8.05 / 10.96	
JHF-9	13.37	12.86	11.61	10.28	9.17	8.37	7.78	7.10	6.76	7.93 / 10.65	
JHF-10	12.91	12.52	11.26	10.02	8.97	8.24	7.67	7.05	6.73	7.80 / 10.25	
JHF-11	13.31	12.88	11.63	10.31	9.17	8.38	7.77	7.11	6.77	7.96 / 10.54	
JHF-12	13.21	12.78	11.50	10.20	9.11	8.33	7.73	7.09	6.76	7.95 / 10.43	
JHF-13	13.14	12.65	11.46	10.10	9.06	8.30	7.71	7.09	6.77	7.94 / 10.32	
JHF-14	12.86	12.42	11.22	9.92	8.93	8.19	7.66	7.07	6.76	7.88 / 10.11	
JHF-15	13.86	13.42	12.12	10.63	9.49	8.59	7.92	7.21	6.85	8.18 / 10.89	
JHF-16	14.24	13.72	12.48	10.96	9.73	8.78	8.07	7.29	6.89	8.19 / 11.50	
JHF-17	13.98	13.53	12.27	10.77	9.58	8.70	8.04	7.29	6.92	8.27 / 10.89	
JHF-18	13.84	13.36	12.02	10.58	9.44	8.60	7.96	7.26	6.89	8.22 / 11.05	
JHF-19	13.22	12.75	11.45	10.11	9.08	8.34	7.77	7.16	6.83	8.04 / 10.13	
JHF-20	13.33	12.87	11.59	10.18	9.15	8.41	7.82	7.20	6.87	8.10 / 10.18	
JHF-21	13.72	13.22	11.84	10.45	9.32	8.53	7.90	7.25	6.91	8.22 / 10.37	
JHF-22	13.67	13.21	11.88	10.41	9.32	8.50	7.89	7.25	6.92	8.23 / 10.27	
JHF-23	14.17	13.68	12.32	10.78	9.61	8.69	8.04	7.34	6.98	8.34 / 10.78	
JHF-24	13.97	13.53	12.08	10.60	9.48	8.61	7.99	7.32	6.97	8.28 / 10.69	
JHF-25	14.01	13.54	12.12	10.63	9.47	8.62	8.01	7.34	6.99	8.23 / 11.05	
JHF-26	14.26	13.75	12.27	10.72	9.58	8.71	8.06	7.36	7.00	8.28 / 11.18	
JHF-27	14.07	13.49	12.08	10.60	9.46	8.64	8.01	7.35	7.01	8.28 / 10.99	
JHF-28	13.50	12.97	11.51	10.18	9.13	8.43	7.88	7.29	6.97	8.20 / 10.33	
JHF-29	13.31	12.86	11.37	10.08	9.06	8.38	7.86	7.28	6.98	8.18 / 10.23	
JHF-30	13.04	12.59	11.14	9.86	8.93	8.30	7.82	7.26	6.97	8.14 / 10.05	
JHF-31	12.98	12.49	11.01	9.73	8.85	8.24	7.78	7.26	6.97	8.07 / 9.93	
JHF-32	13.16	12.68	11.22	9.93	8.99	8.34	7.86	7.31	7.02	8.18 / 10.18	
JHF-33	12.91	12.46	10.98	9.74	8.85	8.27	7.81	7.29	7.01	8.10 / 9.98	
JHF-34	12.98	12.51	11.09	9.78	8.90	8.31	7.86	7.34	7.05	8.17 / 10.07	
JHF-35	11.68	11.27	9.92	8.97	8.35	7.92	7.57	7.16	6.93	7.79 / 9.24	
JHF-36	11.51	10.99	9.71	8.86	8.27	7.88	7.53	7.14	6.91	7.67 / 9.18	
JHF-37	11.51	11.04	9.73	8.80	8.28	7.89	7.55	7.15	6.93	7.60 / 9.21	
JHF-38	11.35	10.84	9.57	8.70	8.21	7.84	7.51	7.14	6.92	7.43 / 9.13	
JHF-39	11.02	10.53	9.36	8.61	8.13	7.80	7.50	7.14	6.94	7.25 / 9.03	
JHF-40	10.71	10.24	9.11	8.42	8.05	7.77	7.47	7.13	6.92	7.11 / 8.92	
JHF-41	10.46	9.97	8.92	8.36	7.98	7.66	7.42	7.11	6.91	6.96 / 8.82	
JHF-42	10.12	9.66	8.72	8.20	7.91	7.60	7.38	7.09	6.91	6.88 / 8.71	
JHF-43	10.33	9.79	8.85	8.33	7.97	7.66	7.43	7.13	6.95	6.91 / 8.81	
JHF-44	10.36	9.87	8.87	8.36	7.99	7.69	7.47	7.17	6.98	6.95 / 8.88	
JHF-45	10.83	10.34	9.23	8.52	8.15	7.81	7.57	7.23	7.04	7.15 / 9.16	
JHF-46	10.93	10.40	9.24	8.59	8.21	7.88	7.61	7.27	7.07	7.22 / 9.27	
JHF-47	11.23	10.71	9.41	8.73	8.27	7.93	7.65	7.30	7.09	7.27 / 9.40	
JHF-48	11.25	10.70	9.39	8.74	8.29	7.96	7.67	7.32	7.11	7.31 / 9.43	
JHF-49	11.41	10.84	9.56	8.78	8.35	8.00	7.71	7.35	7.14	7.36 / 9.50	
JHF-50	11.51	10.96	9.56	8.78	8.37	8.03	7.73	7.37	7.17	7.38 / 9.52	
JHF-51	11.20	10.68	9.35	8.69	8.31	7.98	7.70	7.37	7.17	7.28 / 9.33	

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、SMBC日興、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、
アール・ビー・エス、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

回号	Yield Curve Scenarios (%)										最低 / 最高 (%)	
	-300bp	-200bp	-100bp	-50bp	0bp	50bp	100bp	200bp	300bp			
JHF-52	10.94	10.40	9.22	8.62	8.25	7.94	7.68	7.37	7.18	7.22 / 9.20		
JHF-53	10.86	10.34	9.21	8.61	8.23	7.92	7.67	7.36	7.16	7.21 / 9.20		
GHLC-1	11.69	11.34	10.88	10.12	8.89	7.74	6.72	5.43	4.88	6.56 / 12.79		
GHLC-2	12.05	11.64	11.21	10.33	9.10	7.91	6.84	5.53	4.98	6.78 / 13.05		
GHLC-3	12.28	11.85	11.32	10.42	9.15	7.91	6.86	5.58	5.04	6.91 / 12.96		
GHLC-4	12.70	12.21	11.67	10.64	9.28	7.98	6.91	5.66	5.12	6.80 / 12.79		
GHLC-5	12.71	12.30	11.65	10.56	9.06	7.79	6.84	5.70	5.17	7.27 / 12.81		
GHLC-6	12.82	12.39	11.71	10.49	9.05	7.85	6.94	5.83	5.31	7.11 / 11.87		
GHLC-7	12.95	12.48	11.78	10.56	9.05	7.86	6.94	5.86	5.31	7.13 / 12.68		
GHLC-8	12.83	12.40	11.63	10.39	8.95	7.78	6.89	5.84	5.33	7.18 / 11.80		
GHLC-9	12.68	12.25	11.54	10.22	8.76	7.60	6.77	5.79	5.31	6.92 / 11.28		
GHLC-10	12.58	12.10	11.36	10.06	8.59	7.45	6.67	5.74	5.31	6.77 / 10.30		
GHLC-11	12.34	11.94	11.13	9.81	8.36	7.32	6.57	5.73	5.31	6.52 / 9.71		
GHLC-12	12.25	11.83	10.98	9.57	8.15	7.19	6.51	5.72	5.35	6.50 / 9.32		
GHLC-13	12.37	11.92	11.12	9.68	8.24	7.27	6.56	5.75	5.37	6.66 / 10.12		
GHLC-14	12.36	11.94	11.11	9.74	8.30	7.29	6.57	5.74	5.35	6.64 / 9.89		
GHLC-15	12.32	11.90	11.06	9.67	8.23	7.27	6.56	5.76	5.37	6.59 / 9.88		
GHLC-16	12.34	11.92	11.03	9.63	8.17	7.21	6.52	5.73	5.36	6.60 / 9.80		
GHLC-17	12.33	11.90	11.03	9.67	8.19	7.24	6.55	5.76	5.39	6.62 / 9.73		
GHLC-18	11.96	11.52	10.66	9.28	7.89	6.95	6.29	5.54	5.17	6.43 / 9.51		
GHLC-19	11.98	11.54	10.67	9.18	7.89	6.97	6.29	5.55	5.19	6.47 / 9.33		
GHLC-20	12.02	11.59	10.65	9.21	7.92	7.03	6.34	5.60	5.24	6.53 / 9.48		
GHLC-21	12.06	11.68	10.68	9.25	7.93	7.05	6.37	5.64	5.28	6.59 / 9.58		
GHLC-22	12.09	11.72	10.76	9.32	7.95	7.03	6.35	5.62	5.27	6.55 / 9.81		
GHLC-23	12.16	11.77	10.79	9.32	7.99	7.09	6.39	5.66	5.30	6.63 / 9.78		
GHLC-24	12.14	11.73	10.72	9.29	7.98	7.09	6.40	5.69	5.34	6.70 / 9.75		
GHLC-25	12.01	11.60	10.51	9.11	7.88	7.01	6.40	5.68	5.34	6.67 / 9.61		
GHLC-26	11.87	11.48	10.46	9.03	7.78	6.93	6.31	5.62	5.28	6.51 / 9.29		
GHLC-27	11.15	10.76	9.65	8.51	7.47	6.77	6.22	5.64	5.34	6.21 / 8.76		
GHLC-28	11.82	11.39	10.29	8.89	7.75	6.93	6.32	5.66	5.35	6.47 / 9.22		
GHLC-29	11.07	10.65	9.60	8.46	7.45	6.73	6.21	5.63	5.35	6.35 / 8.83		
GHLC-30	10.96	10.52	9.54	8.39	7.42	6.73	6.20	5.65	5.36	6.47 / 8.93		
GHLC-31	10.90	10.42	9.39	8.33	7.33	6.67	6.17	5.62	5.35	6.27 / 8.72		
GHLC-32	10.81	10.40	9.31	8.24	7.28	6.66	6.18	5.65	5.39	6.16 / 8.69		
GHLC-33	11.00	10.60	9.54	8.44	7.42	6.74	6.24	5.68	5.39	6.26 / 8.86		
GHLC-34	10.95	10.48	9.44	8.26	7.34	6.69	6.22	5.68	5.41	6.22 / 8.87		
GHLC-35	10.99	10.57	9.50	8.34	7.40	6.73	6.24	5.70	5.42	6.34 / 8.97		
GHLC-36	11.40	10.93	9.85	8.62	7.62	6.86	6.33	5.74	5.44	6.75 / 9.26		
GHLC-37	11.32	10.86	9.73	8.57	7.57	6.83	6.32	5.74	5.44	6.72 / 9.30		
GHLC-38	11.68	11.21	10.07	8.80	7.77	7.00	6.41	5.80	5.48	6.99 / 9.58		
GHLC-39	11.55	11.05	9.95	8.70	7.69	6.94	6.39	5.78	5.47	6.93 / 9.45		
GHLC-40	11.89	11.44	10.25	8.99	7.87	7.06	6.46	5.82	5.48	7.02 / 9.68		
GHLC-41	11.62	11.17	10.04	8.78	7.74	7.00	6.42	5.81	5.50	7.00 / 9.53		
GHLC-42	11.93	11.49	10.30	8.99	7.90	7.11	6.50	5.85	5.51	6.96 / 9.80		
GHLC-43	12.25	11.82	10.61	9.23	8.09	7.24	6.59	5.90	5.55	7.14 / 10.05		
GHLC-44	12.69	12.24	11.07	9.62	8.39	7.45	6.75	5.97	5.59	7.13 / 10.42		
GHLC-45	12.62	12.21	11.00	9.54	8.30	7.39	6.69	5.94	5.57	7.11 / 10.39		
GHLC-46	12.74	12.30	11.07	9.64	8.38	7.44	6.75	5.98	5.58	7.04 / 10.54		
GHLC-47	12.86	12.33	11.11	9.68	8.39	7.45	6.78	5.98	5.60	7.05 / 10.37		
GHLC-48	12.23	11.76	10.51	9.13	8.01	7.20	6.62	5.91	5.56	7.09 / 9.88		
GHLC-49	12.22	11.74	10.52	9.14	8.00	7.19	6.61	5.91	5.56	7.16 / 9.85		
GHLC-50	12.73	12.29	11.00	9.60	8.34	7.43	6.78	5.99	5.60	7.10 / 10.35		
GHLC-51	12.45	12.01	10.75	9.32	8.13	7.28	6.66	5.95	5.58	7.13 / 9.97		
GHLC-52	12.17	11.72	10.46	9.07	8.00	7.19	6.59	5.91	5.57	7.10 / 9.78		
GHLC-53	12.36	11.93	10.64	9.24	8.10	7.26	6.65	5.93	5.58	7.11 / 9.97		

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、SMBC日興、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、アール・ビー・エス、パナクレイズ・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

回号	Yield Curve Scenarios (%)									最低 / 最高(%)
	-300bp	-200bp	-100bp	-50bp	0bp	50bp	100bp	200bp	300bp	
JHF-S1	12.14	11.67	10.95	9.77	8.56	7.45	6.60	5.56	5.04	6.66 / 10.31
JHF-S2	12.11	11.70	10.89	9.78	8.54	7.45	6.60	5.55	5.05	6.74 / 10.27
JHF-S3	12.11	11.64	10.89	9.75	8.55	7.45	6.60	5.56	5.05	6.74 / 10.21
JHF-S4	11.94	11.55	10.70	9.53	8.25	7.23	6.47	5.55	5.11	6.54 / 9.83
JHF-S5	11.90	11.48	10.62	9.41	8.09	7.08	6.39	5.54	5.13	6.45 / 9.66
JHF-S6	11.94	11.49	10.67	9.45	8.15	7.13	6.43	5.56	5.13	6.47 / 9.73
JHF-S7	11.93	11.47	10.62	9.37	8.11	7.10	6.40	5.55	5.14	6.46 / 9.62
JHF-S8	11.61	11.25	10.28	9.03	7.71	6.87	6.25	5.52	5.17	6.25 / 9.06
JHF-S9	11.67	11.23	10.28	9.08	7.74	6.89	6.26	5.53	5.18	6.26 / 9.23
JHF-S10	11.47	11.06	10.10	8.73	7.63	6.86	6.26	5.60	5.29	6.35 / 8.71
JHF-S11	11.91	11.53	10.46	9.06	7.85	7.02	6.39	5.71	5.38	6.78 / 9.26
JHF-S12	12.11	11.70	10.61	9.20	7.98	7.12	6.48	5.80	5.46	7.18 / 9.42
JHF-S13	7.91	7.75	7.38	6.74	6.05	5.44	4.95	4.38	3.99	3.14 / 9.78
JHF-S14	7.94	7.77	7.36	6.71	6.04	5.44	4.94	4.36	3.98	3.02 / 9.83
JHF-S15	7.97	7.79	7.39	6.70	6.04	5.43	4.95	4.38	4.00	2.91 / 9.72
JHF-S16	8.27	8.11	7.69	7.01	6.30	5.67	5.14	4.46	4.11	3.45 / 9.80
JHF-S17	8.24	8.12	7.66	7.03	6.27	5.65	5.12	4.43	4.09	3.36 / 9.64
JHF-S18	8.31	8.14	7.67	7.05	6.28	5.65	5.13	4.45	4.09	3.28 / 9.63
GHLC-S1	11.69	11.25	10.66	9.72	8.66	7.62	6.71	5.51	4.98	6.06 / 11.49
GHLC-S2	11.63	11.29	10.62	9.70	8.64	7.60	6.70	5.50	4.98	6.06 / 11.48
GHLC-S3	11.69	11.34	10.75	9.81	8.69	7.63	6.72	5.52	5.00	6.19 / 11.59
GHLC-S4	12.06	11.69	11.02	9.99	8.86	7.77	6.79	5.61	5.08	6.37 / 11.58
GHLC-S5	12.03	11.64	10.94	10.00	8.83	7.74	6.78	5.61	5.08	6.36 / 11.50
GHLC-S6	12.26	11.81	11.08	10.06	8.86	7.73	6.81	5.70	5.17	6.73 / 10.63
GHLC-S7	12.26	11.78	11.12	10.09	8.87	7.74	6.82	5.71	5.18	6.72 / 10.67
GHLC-S8	12.15	11.72	11.01	9.99	8.79	7.68	6.78	5.69	5.16	6.71 / 10.48
GHLC-S9	12.25	11.78	11.06	9.98	8.84	7.71	6.80	5.70	5.17	6.73 / 10.49
GHLC-S10	12.19	11.78	11.04	10.01	8.85	7.72	6.82	5.71	5.19	6.75 / 10.58

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。