

P S J 予測統計値
(中央値)

2010年 11月 15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、銀行・スタンレー・MUFG、クレディ・スイス、ドイツ、JP銀行・パナソニック・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	13.18	13.18	11.36	10.28	9.10	8.20	7.51	7.16	6.77	6.96 / 11.28		
JHF-2	13.10	13.10	11.37	10.11	9.13	8.16	7.48	7.16	6.77	6.91 / 11.24		
JHF-3	13.42	13.32	11.44	10.11	9.13	8.14	7.58	7.18	6.80	7.17 / 11.39		
JHF-4	13.61	13.52	11.60	9.95	9.23	8.22	7.59	7.19	6.80	7.55 / 11.28		
JHF-5	14.01	14.01	12.11	10.20	9.28	8.34	7.74	7.23	6.80	7.83 / 11.73		
JHF-6	13.68	13.68	11.82	10.33	9.30	8.26	7.62	7.18	6.79	7.41 / 11.54		
JHF-7	12.66	12.62	11.03	9.91	9.04	8.08	7.51	7.07	6.78	6.43 / 11.07		
JHF-8	13.74	13.57	11.80	10.23	9.31	8.32	7.62	7.20	6.78	7.19 / 11.54		
JHF-9	13.85	13.00	11.11	9.94	9.14	8.20	7.58	7.08	6.82	6.53 / 11.14		
JHF-10	12.83	12.49	10.54	9.52	8.82	8.01	7.46	7.00	6.81	6.14 / 10.80		
JHF-11	12.84	12.84	10.96	9.91	9.20	8.23	7.50	7.06	6.78	6.50 / 11.31		
JHF-12	13.51	12.70	10.84	9.79	9.05	8.14	7.51	7.05	6.78	6.49 / 11.19		
JHF-13	12.96	12.56	10.67	9.74	9.03	8.12	7.52	7.01	6.78	6.31 / 11.25		
JHF-14	12.46	12.33	10.39	9.55	8.60	8.01	7.53	6.98	6.80	6.24 / 10.90		
JHF-15	13.92	13.81	11.57	10.20	9.45	8.35	7.64	7.24	6.82	7.62 / 11.92		
JHF-16	14.52	14.45	12.04	10.49	9.64	8.54	7.80	7.32	6.86	7.98 / 12.26		
JHF-17	14.13	13.83	11.82	10.23	9.47	8.45	7.81	7.22	6.86	7.66 / 12.07		
JHF-18	13.82	13.48	11.32	10.06	9.28	8.36	7.71	7.11	6.86	7.57 / 11.74		
JHF-19	13.66	12.78	10.49	9.53	8.83	8.15	7.55	7.05	6.83	6.59 / 10.99		
JHF-20	13.74	12.88	10.55	9.56	8.85	8.21	7.57	7.05	6.87	6.79 / 11.16		
JHF-21	13.92	13.19	10.93	9.73	9.00	8.32	7.63	7.13	6.89	7.19 / 11.50		
JHF-22	13.55	13.16	10.93	9.72	9.00	8.23	7.64	7.09	6.90	7.25 / 11.64		
JHF-23	14.49	13.81	11.57	10.05	9.27	8.35	7.72	7.12	6.94	7.92 / 12.15		
JHF-24	14.05	13.45	11.26	9.85	9.10	8.27	7.69	7.13	6.93	7.31 / 12.00		
JHF-25	14.08	13.45	11.05	9.79	9.04	8.21	7.67	7.13	6.91	7.29 / 11.86		
JHF-26	14.78	13.42	11.32	10.01	9.09	8.27	7.74	7.04	6.82	8.01 / 11.94		
JHF-27	14.35	13.57	10.89	9.88	8.93	8.17	7.73	7.09	6.92	7.26 / 11.74		
JHF-28	13.53	12.81	10.37	9.49	8.60	7.98	7.48	6.98	6.74	6.58 / 11.17		
JHF-29	13.44	12.74	10.26	9.48	8.60	7.97	7.64	7.25	6.78	6.43 / 10.91		
JHF-30	13.20	12.48	10.07	9.30	8.48	7.93	7.64	7.21	6.76	6.30 / 10.66		
JHF-31	12.62	12.17	10.02	9.16	8.37	7.92	7.63	7.17	6.75	6.21 / 10.46		
JHF-32	13.10	12.57	10.06	9.32	8.57	7.97	7.69	7.26	6.81	6.28 / 10.82		
JHF-33	12.65	12.03	9.90	9.15	8.38	7.95	7.66	7.19	6.79	6.20 / 10.52		
JHF-34	12.78	12.11	9.96	9.19	8.46	8.00	7.71	7.23	6.83	6.21 / 10.69		
JHF-35	11.64	10.39	8.99	8.40	8.04	7.72	7.24	6.92	6.67	5.80 / 9.47		
JHF-36	11.31	10.15	8.81	8.34	7.96	7.73	7.23	6.89	6.73	5.76 / 9.32		
JHF-37	11.32	10.15	8.83	8.35	7.96	7.74	7.25	6.89	6.70	5.80 / 9.34		
JHF-38	11.02	9.93	8.68	8.24	7.92	7.73	7.25	6.84	6.68	5.75 / 9.24		
JHF-39	10.78	9.67	8.53	8.19	7.87	7.68	7.20	6.79	6.75	5.57 / 9.13		
JHF-40	10.59	9.41	8.40	8.14	7.85	7.73	7.24	6.79	6.79	5.41 / 8.99		
JHF-41	10.43	9.20	8.33	8.07	7.82	7.41	7.07	6.79	6.79	5.32 / 8.90		
JHF-42	9.81	8.97	8.28	8.02	7.81	7.37	7.01	6.83	6.83	5.25 / 8.73		
GHLC-1	11.92	11.92	11.86	10.09	8.89	7.13	5.97	5.36	4.73	4.75 / 10.91		
GHLC-2	12.36	12.36	11.96	10.00	8.64	7.07	6.35	5.35	4.81	5.18 / 10.84		
GHLC-3	12.50	12.50	12.02	10.02	8.26	6.91	6.29	5.33	4.95	5.49 / 10.45		
GHLC-4	12.30	12.30	11.90	10.22	8.30	7.15	6.36	5.50	4.96	5.84 / 10.61		
GHLC-5	12.46	12.46	11.72	10.18	8.43	7.01	6.40	5.52	5.06	5.77 / 10.60		
GHLC-6	12.44	12.44	11.39	10.30	8.63	7.19	6.50	5.63	5.10	6.12 / 10.37		
GHLC-7	12.57	12.57	11.58	10.28	8.78	7.12	6.40	5.52	5.12	6.04 / 9.93		
GHLC-8	12.53	12.53	11.34	10.11	8.36	7.13	6.46	5.62	5.14	6.20 / 10.00		
GHLC-9	12.42	12.42	11.08	9.91	8.19	7.03	6.35	5.55	5.14	6.20 / 9.82		

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-10	12.30	12.30	10.82	9.62	8.13	6.94	6.39	5.57	5.13	6.35 / 9.70	
GHLC-11	11.89	11.89	10.44	9.15	7.89	6.96	6.45	5.58	5.21	6.47 / 9.86	
GHLC-12	11.55	11.55	10.07	8.85	7.63	6.94	6.37	5.56	5.30	6.16 / 9.32	
GHLC-13	11.72	11.72	10.24	8.95	7.69	6.99	6.41	5.57	5.26	6.00 / 9.73	
GHLC-14	11.86	11.86	10.27	9.00	7.83	7.04	6.46	5.60	5.26	6.31 / 9.48	
GHLC-15	11.73	11.73	10.21	8.98	7.74	6.98	6.41	5.58	5.37	6.23 / 9.48	
GHLC-16	11.80	11.80	10.15	8.94	7.70	6.97	6.40	5.57	5.34	5.96 / 9.48	
GHLC-17	11.75	11.75	10.10	9.00	7.73	7.04	6.40	5.57	5.38	5.96 / 9.42	
GHLC-18	11.69	11.69	10.04	8.99	7.74	7.04	6.39	5.57	5.41	6.32 / 9.16	
GHLC-19	11.56	11.56	9.95	8.92	7.68	6.99	6.33	5.56	5.46	6.25 / 9.07	
GHLC-20	11.52	11.52	9.96	8.93	7.73	7.05	6.40	5.68	5.57	6.10 / 9.19	
GHLC-21	11.53	11.53	9.90	8.93	7.71	7.08	6.37	5.69	5.61	6.21 / 9.28	
GHLC-22	11.87	11.87	10.12	8.95	7.65	7.08	6.43	5.65	5.49	6.37 / 9.58	
GHLC-23	11.81	11.81	10.09	9.01	7.70	7.09	6.45	5.74	5.61	6.35 / 9.55	
GHLC-24	11.76	11.76	10.04	9.06	7.73	7.07	6.49	5.80	5.65	6.15 / 9.52	
GHLC-25	11.57	11.57	9.93	8.83	7.63	7.05	6.51	5.90	5.66	6.03 / 9.54	
GHLC-26	11.07	11.07	9.74	8.74	7.66	7.05	6.50	5.78	5.56	5.93 / 9.05	
GHLC-27	10.11	10.11	9.24	8.05	7.33	6.87	6.39	5.96	5.50	5.49 / 9.27	
GHLC-28	11.00	11.00	9.63	8.42	7.59	7.10	6.46	5.85	5.52	5.83 / 9.34	
GHLC-29	10.01	10.01	9.21	8.06	7.31	6.93	6.35	5.96	5.52	5.48 / 9.31	
GHLC-30	9.90	9.90	9.11	8.13	7.25	6.93	6.30	5.96	5.57	5.41 / 9.39	
GHLC-31	9.73	9.72	8.96	7.95	7.36	6.75	6.35	5.90	5.47	5.25 / 9.18	
GHLC-32	9.66	9.59	8.80	7.89	7.21	6.72	6.38	5.87	5.49	5.16 / 9.08	
GHLC-33	9.93	9.91	9.03	8.02	7.41	6.76	6.42	5.94	5.53	5.38 / 9.26	
GHLC-34	9.98	9.85	8.82	7.92	7.41	6.75	6.43	5.87	5.48	5.24 / 9.12	
GHLC-35	10.20	9.90	8.92	7.97	7.45	6.77	6.43	5.89	5.46	5.31 / 9.17	
GHLC-36	10.73	10.36	9.31	8.21	7.45	6.94	6.43	6.01	5.54	5.52 / 9.49	
GHLC-37	10.72	10.19	9.03	8.01	7.41	6.94	6.43	5.92	5.52	5.40 / 9.22	
GHLC-38	11.38	10.43	9.30	8.19	7.49	7.09	6.42	6.00	5.56	5.74 / 9.43	
GHLC-39	11.29	10.23	9.17	8.13	7.45	7.01	6.40	5.95	5.54	5.54 / 9.29	
GHLC-40	11.58	10.99	9.62	8.31	7.58	7.16	6.51	6.06	5.60	6.14 / 9.62	
GHLC-41	11.34	10.38	9.22	8.16	7.48	7.00	6.44	5.98	5.57	5.74 / 9.35	
GHLC-42	11.61	11.09	9.68	8.39	7.55	7.11	6.44	6.05	5.61	6.17 / 9.60	
GHLC-43	12.23	11.58	9.92	8.58	7.68	7.22	6.53	6.09	5.61	6.66 / 9.82	
GHLC-44	12.76	12.19	10.33	9.04	7.92	7.42	6.62	6.13	5.67	7.02 / 10.20	
GHLC-45	12.31	11.29	10.16	8.76	7.90	7.45	6.67	6.11	5.60	6.83 / 10.01	
GHLC-46	12.50	11.33	10.23	8.82	8.02	7.48	6.75	6.13	5.63	6.86 / 10.02	
GHLC-47	12.74	11.31	10.28	8.81	8.03	7.51	6.76	6.13	5.60	6.86 / 9.96	
GHLC-48	11.75	11.39	9.83	8.48	7.73	7.27	6.52	6.00	5.58	6.15 / 9.48	
GHLC-49	11.82	11.37	9.81	8.48	7.74	7.26	6.52	5.99	5.55	6.35 / 9.44	
GHLC-50	12.50	11.61	10.25	8.85	8.08	7.55	6.76	6.11	5.63	6.80 / 9.91	
GHLC-51	12.60	11.30	10.03	8.63	7.87	7.34	6.62	6.02	5.56	6.50 / 9.53	
GHLC-52	12.04	10.89	9.64	8.49	7.72	7.17	6.47	5.93	5.59	6.22 / 9.33	
GHLC-53	12.29	11.65	9.89	8.62	7.76	7.29	6.61	6.01	5.65	6.46 / 9.51	
JHF-S1	11.87	11.87	10.94	9.80	8.48	7.35	6.45	5.63	5.18	7.06 / 10.07	
JHF-S2	11.86	11.86	10.87	9.79	8.53	7.29	6.45	5.62	5.16	7.09 / 9.85	
JHF-S3	11.87	11.87	10.77	9.81	8.56	7.28	6.46	5.65	5.16	7.11 / 9.81	
JHF-S4	11.71	11.71	10.49	9.14	8.12	6.90	6.34	5.60	5.35	6.91 / 9.56	
JHF-S5	11.42	11.42	10.29	8.98	8.05	6.78	6.27	5.59	5.40	6.59 / 9.35	
JHF-S6	11.48	11.48	10.38	9.00	8.07	6.81	6.27	5.60	5.40	6.67 / 9.36	
JHF-S7	11.43	11.43	10.30	8.99	8.08	6.83	6.27	5.58	5.39	6.66 / 9.30	
JHF-S8	10.74	10.74	9.53	8.57	7.64	6.80	6.23	5.69	5.47	6.11 / 8.80	
JHF-S9	10.76	10.76	9.55	8.58	7.67	6.79	6.23	5.67	5.45	6.12 / 8.82	
JHF-S10	10.29	10.29	9.13	8.43	7.51	6.90	6.24	5.94	5.45	5.84 / 8.64	
JHF-S11	11.05	11.05	9.62	8.67	7.61	7.11	6.36	6.04	5.59	6.17 / 9.41	

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-S12	11.31	11.31	9.82	8.77	7.70	7.21	6.54	6.11	5.63	6.32 /	9.64
JHF-S13	7.39	7.39	7.37	6.98	6.38	5.68	5.05	4.48	3.77	2.97 /	9.15
JHF-S14	7.46	7.46	7.44	6.98	6.35	5.68	5.06	4.46	3.79	2.94 /	9.05
JHF-S15	7.45	7.45	7.49	6.98	6.37	5.67	5.08	4.47	3.79	2.93 /	9.01
JHF-S16	7.89	7.89	7.78	7.13	6.62	5.75	5.33	4.63	3.94	3.34 /	9.05
JHF-S17	7.90	7.90	7.71	7.17	6.64	5.68	5.33	4.56	3.94	3.26 /	8.91
JHF-S18	7.92	7.92	7.74	7.21	6.63	5.68	5.34	4.54	3.94	3.25 /	8.81
GHLC-S1	11.53	11.53	10.78	9.47	8.14	6.99	6.46	5.38	4.92	6.43 /	10.65
GHLC-S2	11.52	11.52	10.80	9.45	8.02	6.76	6.37	5.41	4.90	6.51 /	10.71
GHLC-S3	11.72	11.72	10.80	9.53	8.10	6.93	6.41	5.38	4.89	6.51 /	10.68
GHLC-S4	11.78	11.78	10.78	9.63	8.36	6.92	6.41	5.45	5.02	6.66 /	10.71
GHLC-S5	11.78	11.78	10.74	9.59	8.26	6.98	6.40	5.45	5.02	6.74 /	10.63
GHLC-S6	11.87	11.87	11.00	9.68	8.43	7.42	6.41	5.50	5.12	6.86 /	10.35
GHLC-S7	11.90	11.90	10.91	9.70	8.45	7.48	6.43	5.49	5.12	6.86 /	10.33
GHLC-S8	11.87	11.87	11.00	9.63	8.46	7.51	6.41	5.46	5.10	6.94 /	10.32
GHLC-S9	11.84	11.84	10.88	9.65	8.44	7.50	6.43	5.46	5.09	6.94 /	10.33
GHLC-S10	11.76	11.76	10.84	9.67	8.46	7.50	6.41	5.49	5.09	7.02 /	10.26

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。