

P S J 予測統計値
(中央値)

2010年 10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・ピッチ日本、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	13.08	12.72	11.57	10.22	8.75	8.10	7.44	7.22	6.99	7.30 / 11.78	
JHF-2	13.04	12.52	11.49	9.84	8.84	8.16	7.45	7.24	6.98	7.26 / 11.74	
JHF-3	13.22	13.22	11.57	10.30	8.82	8.19	7.50	7.26	7.01	7.54 / 11.89	
JHF-4	13.43	13.43	11.71	10.21	8.82	8.25	7.51	7.26	7.04	7.90 / 11.82	
JHF-5	13.94	13.26	11.90	10.20	8.97	8.34	7.55	7.29	7.11	8.11 / 12.28	
JHF-6	13.60	12.90	11.80	10.04	8.84	8.33	7.57	7.25	7.03	7.77 / 12.09	
JHF-7	12.57	12.57	11.17	9.72	8.65	8.18	7.55	7.20	6.83	6.72 / 11.55	
JHF-8	13.51	13.13	11.64	10.13	8.94	8.33	7.68	7.22	6.98	7.60 / 12.05	
JHF-9	12.80	12.80	11.27	9.83	8.84	8.41	7.67	7.21	6.86	6.85 / 11.63	
JHF-10	12.47	12.17	10.79	9.62	8.59	8.12	7.62	7.24	6.83	6.38 / 11.31	
JHF-11	12.80	12.80	11.16	9.95	8.87	8.23	7.65	7.27	6.84	6.80 / 11.84	
JHF-12	12.66	12.66	11.05	9.80	8.72	8.23	7.57	7.27	6.83	6.72 / 11.68	
JHF-13	12.47	12.47	10.89	9.73	8.76	8.17	7.60	7.30	6.83	6.56 / 11.76	
JHF-14	12.10	12.10	10.61	9.45	8.61	8.18	7.57	7.25	6.83	6.49 / 11.39	
JHF-15	13.90	13.90	11.47	10.33	8.99	8.49	7.66	7.32	6.93	7.83 / 12.50	
JHF-16	14.28	13.37	11.96	10.72	9.39	8.55	7.77	7.31	7.03	8.15 / 12.90	
JHF-17	14.11	13.90	11.48	10.46	9.07	8.57	7.81	7.35	6.92	7.78 / 12.65	
JHF-18	13.79	13.56	11.28	10.13	8.94	8.53	7.73	7.35	6.92	7.78 / 12.30	
JHF-19	12.75	12.68	10.66	9.50	8.87	8.33	7.69	7.23	6.85	6.89 / 11.53	
JHF-20	12.96	12.74	10.78	9.60	8.98	8.36	7.72	7.25	6.88	7.12 / 11.68	
JHF-21	13.49	13.11	11.02	9.82	9.10	8.44	7.77	7.34	6.92	7.58 / 12.06	
JHF-22	13.51	13.08	10.99	9.82	9.11	8.41	7.75	7.34	6.91	7.65 / 12.21	
JHF-23	14.13	13.73	11.34	10.31	9.07	8.46	7.78	7.39	6.98	7.77 / 12.76	
JHF-24	13.95	13.39	11.16	10.00	9.05	8.45	7.77	7.40	6.95	7.71 / 12.59	
JHF-25	13.91	13.27	11.04	9.97	9.09	8.42	7.77	7.36	6.93	7.70 / 12.44	
JHF-26	13.96	13.32	11.45	10.20	9.12	8.46	7.79	7.40	6.86	8.15 / 12.54	
JHF-27	13.82	12.94	11.02	10.02	9.06	8.34	7.77	7.30	6.94	7.66 / 12.33	
JHF-28	13.18	12.11	10.67	9.58	8.70	8.13	7.69	7.04	6.79	6.87 / 11.71	
JHF-29	12.95	11.89	10.50	9.52	8.72	8.13	7.72	7.27	6.80	6.63 / 11.47	
JHF-30	12.46	11.92	10.33	9.38	8.59	8.05	7.62	7.26	6.79	6.54 / 11.16	
JHF-31	12.73	12.12	10.25	9.39	8.54	7.93	7.62	7.20	6.79	6.43 / 10.96	
JHF-32	13.11	12.56	10.32	9.53	8.68	8.01	7.67	7.30	6.83	6.53 / 11.34	
JHF-33	13.04	12.01	10.22	9.35	8.60	7.98	7.66	7.24	6.84	6.42 / 11.03	
JHF-34	13.06	12.06	10.29	9.37	8.66	8.04	7.71	7.27	6.89	6.43 / 11.24	
JHF-35	11.86	10.68	9.13	8.59	8.11	7.75	7.34	6.94	6.58	6.02 / 9.91	
JHF-36	11.51	10.40	8.99	8.46	8.05	7.71	7.32	6.91	6.56	5.98 / 9.73	
JHF-37	11.53	10.43	9.01	8.47	8.09	7.72	7.34	6.92	6.57	6.02 / 9.71	
JHF-38	11.22	10.18	8.83	8.33	8.12	7.71	7.32	6.87	6.52	5.95 / 9.74	
JHF-39	10.80	9.86	8.64	8.25	8.14	7.72	7.24	6.82	6.50	5.76 / 9.36	
JHF-40	10.63	9.62	8.51	8.20	8.11	7.73	7.32	6.78	6.54	5.60 / 9.16	
JHF-41	10.43	9.39	8.35	8.19	8.10	7.61	7.11	6.73	6.50	5.47 / 9.16	
GHLC-1	12.56	12.56	12.56	10.64	9.42	7.35	6.36	5.39	4.79	4.89 / 11.15	
GHLC-2	12.44	12.44	12.37	10.58	8.93	7.20	6.07	5.43	4.90	5.33 / 10.81	
GHLC-3	12.59	12.59	12.45	10.58	8.74	7.18	6.07	5.50	4.98	5.60 / 10.89	
GHLC-4	12.41	12.41	11.95	10.64	8.79	7.38	6.40	5.66	5.07	5.87 / 10.79	
GHLC-5	12.50	12.50	11.87	10.72	8.85	7.45	6.60	5.70	5.16	5.84 / 10.73	
GHLC-6	12.40	12.40	11.79	10.64	9.14	7.60	6.65	5.81	5.17	6.17 / 10.46	
GHLC-7	12.51	12.51	11.89	10.82	9.28	7.64	6.58	5.68	5.22	6.08 / 10.43	
GHLC-8	12.53	12.53	11.74	10.43	8.67	7.45	6.72	5.78	5.20	6.26 / 10.41	
GHLC-9	12.42	12.42	11.48	10.21	8.26	7.12	6.58	5.70	5.25	6.26 / 10.44	
GHLC-10	12.25	12.25	11.25	9.96	8.20	7.03	6.61	5.75	5.28	6.41 / 10.27	

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	11.87	11.87	10.80	9.65	8.09	7.01	6.70	5.73	5.26	6.60 / 9.99	
GHLC-12	11.45	11.45	10.42	9.15	8.10	7.19	6.65	5.71	5.35	6.43 / 9.60	
GHLC-13	11.68	11.68	10.60	9.32	8.08	7.17	6.59	5.80	5.36	6.25 / 10.36	
GHLC-14	11.75	11.75	10.68	9.47	8.10	7.26	6.72	5.79	5.37	6.57 / 10.10	
GHLC-15	11.62	11.62	10.53	9.28	8.02	7.28	6.71	5.79	5.40	6.51 / 10.63	
GHLC-16	11.69	11.69	10.55	9.26	8.07	7.23	6.67	5.80	5.42	6.23 / 11.46	
GHLC-17	11.64	11.64	10.50	9.23	8.09	7.28	6.71	5.78	5.44	6.25 / 10.83	
GHLC-18	11.58	11.58	10.41	9.17	7.94	7.25	6.68	5.77	5.52	6.69 / 10.43	
GHLC-19	11.40	11.40	10.31	8.96	7.82	7.24	6.69	5.72	5.51	6.63 / 9.68	
GHLC-20	11.40	11.40	10.26	8.93	7.89	7.37	6.80	5.82	5.61	6.43 / 9.82	
GHLC-21	11.41	11.41	10.25	8.80	7.67	7.25	6.73	5.88	5.64	6.54 / 9.93	
GHLC-22	11.76	11.76	10.43	9.10	7.74	7.26	6.60	5.90	5.65	6.70 / 10.29	
GHLC-23	11.72	11.72	10.45	9.03	7.76	7.26	6.74	5.98	5.70	6.55 / 10.93	
GHLC-24	11.66	11.66	10.39	8.95	7.78	7.29	6.67	6.03	5.71	6.44 / 10.38	
GHLC-25	11.46	11.46	10.28	8.74	7.82	7.31	6.70	6.02	5.72	6.31 / 10.36	
GHLC-26	10.92	10.92	9.96	8.34	7.66	7.27	6.59	5.90	5.73	6.21 / 10.93	
GHLC-27	10.00	10.00	9.10	8.17	7.54	7.27	6.65	6.06	5.74	5.69 / 10.39	
GHLC-28	10.89	10.89	9.87	8.28	7.75	7.26	6.60	6.00	5.67	6.06 / 9.75	
GHLC-29	9.87	9.87	9.00	8.06	7.49	7.28	6.56	6.04	5.66	5.54 / 9.64	
GHLC-30	9.77	9.77	8.97	8.00	7.31	7.20	6.43	6.03	5.64	5.59 / 9.69	
GHLC-31	9.41	9.41	8.57	8.01	7.39	7.14	6.54	6.02	5.63	5.39 / 9.48	
GHLC-32	9.30	9.15	8.50	7.98	7.40	6.94	6.63	6.08	5.67	5.27 / 9.36	
GHLC-33	9.58	9.58	8.73	7.98	7.45	7.14	6.59	6.05	5.64	5.54 / 9.56	
GHLC-34	9.52	9.25	8.61	8.03	7.44	6.97	6.56	6.10	5.68	5.39 / 9.43	
GHLC-35	9.69	9.48	8.60	8.06	7.45	6.94	6.51	5.96	5.58	5.34 / 9.46	
GHLC-36	9.98	9.89	9.05	7.99	7.47	7.14	6.50	6.04	5.60	5.70 / 9.62	
GHLC-37	10.18	9.78	8.82	7.88	7.45	7.11	6.51	5.98	5.58	5.57 / 9.55	
GHLC-38	10.36	9.70	8.90	8.02	7.47	7.25	6.56	6.08	5.62	5.95 / 9.75	
GHLC-39	10.11	9.39	8.76	7.93	7.48	7.18	6.54	6.02	5.61	5.74 / 9.59	
GHLC-40	10.88	9.57	9.08	8.33	7.60	7.33	6.60	6.09	5.66	6.39 / 9.96	
GHLC-41	10.27	9.43	8.84	7.98	7.52	7.16	6.55	6.05	5.64	5.85 / 9.65	
GHLC-42	11.16	10.98	9.87	8.45	7.68	7.47	6.68	6.13	5.68	6.45 / 10.84	
GHLC-43	11.68	11.68	10.20	8.76	7.82	7.49	6.86	6.14	5.72	6.99 / 11.13	
GHLC-44	12.66	12.66	10.70	9.11	8.08	7.64	6.80	6.15	5.75	7.26 / 10.65	
GHLC-45	12.37	11.71	10.44	8.93	8.07	7.55	6.99	6.13	5.74	7.10 / 10.84	
GHLC-46	12.46	12.19	10.53	8.92	8.19	7.53	7.05	6.13	5.73	7.18 / 10.74	
GHLC-47	12.82	11.83	10.47	9.00	8.21	7.64	6.85	6.15	5.73	7.21 / 10.36	
GHLC-48	12.38	11.34	9.89	8.62	7.90	7.44	6.83	6.10	5.67	6.46 / 10.17	
GHLC-49	12.55	11.35	9.86	8.60	7.93	7.46	6.76	6.08	5.67	6.66 / 9.95	
GHLC-50	12.93	12.17	10.44	9.05	8.29	7.65	6.68	6.18	5.73	7.16 / 10.49	
GHLC-51	13.12	11.75	10.01	8.75	8.09	7.48	6.68	6.12	5.68	6.81 / 10.07	
GHLC-52	12.20	11.23	9.74	8.53	7.83	7.33	6.68	6.14	5.62	6.53 / 9.74	
GHLC-53	12.52	11.59	9.90	8.62	7.97	7.44	6.62	6.16	5.67	6.75 / 10.05	
JHF-S1	11.81	11.60	11.01	9.75	8.53	7.20	6.46	5.65	5.23	7.13 / 10.32	
JHF-S2	11.78	11.78	10.96	9.74	8.50	7.24	6.42	5.62	5.23	7.18 / 10.19	
JHF-S3	11.19	11.19	10.81	9.75	8.49	7.32	6.43	5.61	5.21	6.71 / 10.29	
JHF-S4	11.22	11.22	10.31	9.44	8.24	7.11	6.38	5.71	5.41	6.70 / 10.06	
JHF-S5	11.07	11.07	10.09	9.12	8.00	6.83	6.31	5.69	5.45	6.71 / 9.88	
JHF-S6	11.06	11.06	10.14	9.16	8.10	6.85	6.34	5.70	5.44	6.87 / 9.90	
JHF-S7	11.04	11.04	10.11	9.11	8.05	6.86	6.36	5.67	5.44	6.84 / 9.83	
JHF-S8	10.59	10.59	9.66	8.67	7.74	6.84	6.16	5.77	5.50	6.36 / 9.30	
JHF-S9	10.64	10.64	9.70	8.70	7.83	7.01	6.52	5.78	5.50	6.37 / 10.00	
JHF-S10	10.18	10.18	9.28	8.52	7.74	7.27	6.66	5.97	5.51	6.06 / 10.21	
JHF-S11	10.94	10.94	9.83	8.80	7.86	7.49	6.74	6.06	5.64	6.45 / 10.30	
JHF-S12	11.22	11.22	9.95	8.87	7.93	7.36	6.81	6.12	5.68	6.61 / 10.17	

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	7.45	7.43	7.43	6.98	6.50	5.48	4.93	4.59	3.80		3.03 /	10.19
JHF-S14	7.50	7.50	7.50	7.05	6.50	5.55	4.98	4.59	3.80		3.00 /	10.10
JHF-S15	7.50	7.50	7.50	7.05	6.52	5.59	4.94	4.60	3.81		2.99 /	10.10
JHF-S16	7.95	7.95	7.94	7.18	6.89	6.05	5.15	4.69	3.96		3.41 /	10.04
JHF-S17	8.01	8.01	8.00	7.20	6.94	6.04	5.11	4.69	3.96		3.34 /	10.02
JHF-S18	8.01	8.01	8.00	7.22	7.13	6.12	5.12	4.67	3.97		3.32 /	10.03
GHLC-S1	11.60	11.60	11.23	9.80	8.34	6.92	6.34	5.47	4.95		6.51 /	10.82
GHLC-S2	11.53	11.53	11.19	9.80	8.18	6.85	6.40	5.55	4.95		6.59 /	10.93
GHLC-S3	11.78	11.78	11.18	9.94	8.31	6.97	6.18	5.48	4.96		6.57 /	10.88
GHLC-S4	11.83	11.83	11.20	9.94	8.34	7.09	6.16	5.53	5.07		6.68 /	10.89
GHLC-S5	11.77	11.77	11.16	9.93	8.36	7.02	6.17	5.53	5.09		6.77 /	10.84
GHLC-S6	11.89	11.89	11.08	10.06	8.60	7.23	6.42	5.61	5.15		6.89 /	10.61
GHLC-S7	11.86	11.86	11.03	10.03	8.58	7.21	6.41	5.59	5.11		6.90 /	10.47
GHLC-S8	11.82	11.72	11.00	9.81	8.33	7.12	6.37	5.60	5.14		6.99 /	10.45
GHLC-S9	11.84	11.74	10.99	9.81	8.36	7.12	6.31	5.58	5.13		6.99 /	10.42
GHLC-S10	11.47	11.17	10.89	9.80	8.35	7.17	6.34	5.59	5.11		7.01 /	10.42

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。