

P S J 予測統計値
(平均値)

2010年 12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・スタンレー、ゴールドマン・サックス、スタンレー・MUFG、クレディ・スイス、ドイツ、JP銀行・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	13.55	12.68	11.00	9.73	8.72	7.97	7.37	6.76	6.47	6.62 / 10.80		
JHF-2	13.52	12.63	10.96	9.67	8.70	7.94	7.35	6.75	6.46	6.53 / 10.74		
JHF-3	13.64	12.77	11.05	9.76	8.76	7.99	7.38	6.78	6.48	6.71 / 10.89		
JHF-4	13.83	12.97	11.21	9.85	8.82	8.02	7.40	6.78	6.47	7.01 / 10.81		
JHF-5	14.29	13.36	11.52	10.07	8.98	8.14	7.51	6.82	6.50	7.24 / 11.23		
JHF-6	14.06	13.08	11.30	9.91	8.85	8.06	7.46	6.80	6.49	6.90 / 11.01		
JHF-7	13.24	12.40	10.67	9.45	8.53	7.85	7.29	6.74	6.45	6.21 / 10.55		
JHF-8	13.94	13.08	11.25	9.90	8.81	8.02	7.42	6.79	6.49	6.70 / 11.02		
JHF-9	13.41	12.50	10.80	9.50	8.57	7.88	7.32	6.76	6.48	6.22 / 10.65		
JHF-10	12.81	12.02	10.37	9.24	8.36	7.72	7.22	6.72	6.45	5.90 / 10.35		
JHF-11	13.33	12.49	10.81	9.56	8.58	7.87	7.32	6.77	6.49	6.20 / 10.82		
JHF-12	13.18	12.38	10.66	9.43	8.51	7.81	7.30	6.75	6.47	6.19 / 10.68		
JHF-13	13.02	12.23	10.57	9.36	8.48	7.79	7.28	6.76	6.49	6.12 / 10.74		
JHF-14	12.72	11.94	10.34	9.18	8.34	7.68	7.22	6.73	6.47	5.99 / 10.40		
JHF-15	14.10	13.25	11.36	9.95	8.87	8.05	7.46	6.84	6.53	7.04 / 11.38		
JHF-16	14.68	13.77	11.86	10.31	9.12	8.24	7.57	6.88	6.56	7.81 / 11.72		
JHF-17	14.24	13.39	11.48	10.07	8.94	8.15	7.54	6.89	6.58	7.11 / 11.53		
JHF-18	13.98	13.15	11.22	9.89	8.80	8.05	7.46	6.86	6.56	7.10 / 11.19		
JHF-19	13.11	12.37	10.57	9.40	8.47	7.81	7.31	6.79	6.52	6.38 / 10.48		
JHF-20	13.33	12.52	10.73	9.49	8.53	7.86	7.34	6.81	6.53	6.46 / 10.64		
JHF-21	13.77	12.92	11.04	9.65	8.67	7.95	7.41	6.85	6.57	6.79 / 11.00		
JHF-22	13.76	12.98	11.07	9.71	8.68	7.94	7.42	6.86	6.58	6.84 / 11.10		
JHF-23	14.49	13.62	11.56	10.06	8.94	8.11	7.54	6.92	6.62	7.37 / 11.58		
JHF-24	14.12	13.33	11.29	9.86	8.80	8.03	7.49	6.90	6.61	6.96 / 11.43		
JHF-25	14.11	13.26	11.22	9.80	8.77	8.01	7.47	6.89	6.60	6.87 / 11.31		
JHF-26	14.55	13.68	11.59	10.03	8.91	8.11	7.53	6.91	6.61	7.45 / 11.38		
JHF-27	14.14	13.33	11.27	9.82	8.77	8.04	7.49	6.91	6.62	6.87 / 11.19		
JHF-28	13.28	12.45	10.56	9.36	8.47	7.84	7.35	6.85	6.58	6.34 / 10.64		
JHF-29	13.05	12.27	10.39	9.26	8.42	7.81	7.34	6.87	6.61	6.24 / 10.42		
JHF-30	12.71	11.98	10.17	9.04	8.33	7.74	7.32	6.86	6.61	6.18 / 10.16		
JHF-31	12.56	11.78	10.04	8.99	8.26	7.70	7.30	6.87	6.62	6.03 / 9.99		
JHF-32	12.81	12.07	10.25	9.11	8.38	7.79	7.36	6.91	6.66	6.10 / 10.32		
JHF-33	12.49	11.81	10.00	8.96	8.28	7.73	7.33	6.90	6.65	6.02 / 10.04		
JHF-34	12.59	11.85	10.09	9.00	8.32	7.76	7.37	6.95	6.70	6.03 / 10.22		
JHF-35	11.28	10.66	9.12	8.37	7.83	7.43	7.14	6.80	6.58	5.65 / 9.24		
JHF-36	11.10	10.42	9.02	8.24	7.77	7.40	7.14	6.80	6.60	5.61 / 9.16		
JHF-37	11.14	10.50	9.04	8.27	7.79	7.42	7.15	6.81	6.60	5.65 / 9.18		
JHF-38	10.95	10.30	8.87	8.19	7.73	7.39	7.14	6.81	6.61	5.65 / 9.10		
JHF-39	10.63	9.95	8.66	8.06	7.66	7.35	7.12	6.81	6.62	5.47 / 8.99		
JHF-40	10.28	9.65	8.49	7.93	7.60	7.35	7.11	6.81	6.62	5.33 / 8.86		
JHF-41	10.02	9.44	8.38	7.88	7.53	7.26	7.07	6.79	6.62	5.24 / 8.77		
JHF-42	9.69	9.15	8.22	7.72	7.47	7.24	7.05	6.79	6.62	5.12 / 8.68		
JHF-43	9.74	9.22	8.25	7.76	7.47	7.22	7.04	6.78	6.61	5.15 / 8.72		
GHLC-1	11.65	11.18	10.50	9.35	8.00	6.90	6.06	5.03	4.58	4.67 / 10.62		
GHLC-2	12.13	11.52	10.72	9.45	8.12	6.98	6.15	5.16	4.72	5.14 / 10.48		
GHLC-3	12.13	11.56	10.72	9.39	8.06	6.92	6.15	5.21	4.78	5.45 / 10.27		
GHLC-4	12.32	11.71	10.87	9.47	8.12	6.97	6.22	5.30	4.90	5.80 / 10.40		
GHLC-5	12.32	11.81	10.92	9.57	8.14	7.02	6.27	5.38	4.97	5.73 / 10.41		
GHLC-6	12.39	11.89	10.94	9.51	8.12	7.03	6.30	5.44	5.04	6.08 / 10.16		
GHLC-7	12.39	11.86	10.90	9.49	8.05	6.99	6.27	5.41	5.02	6.00 / 9.82		
GHLC-8	12.35	11.82	10.90	9.42	8.02	6.99	6.28	5.45	5.09	6.20 / 9.86		

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-9	12.14	11.64	10.66	9.16	7.82	6.88	6.20	5.41	5.07	6.16 /	9.65
GHLC-10	12.13	11.59	10.49	9.06	7.72	6.80	6.16	5.40	5.09	6.27 /	9.55
GHLC-11	11.91	11.39	10.22	8.77	7.53	6.71	6.11	5.42	5.12	6.03 /	9.69
GHLC-12	11.77	11.30	10.06	8.55	7.37	6.62	6.07	5.43	5.16	5.84 /	9.18
GHLC-13	11.87	11.36	10.18	8.66	7.47	6.69	6.11	5.45	5.17	5.73 /	9.17
GHLC-14	11.89	11.37	10.15	8.74	7.49	6.71	6.12	5.44	5.16	5.87 /	9.13
GHLC-15	11.86	11.36	10.07	8.67	7.45	6.68	6.10	5.44	5.17	5.89 /	9.13
GHLC-16	11.86	11.37	10.13	8.63	7.43	6.67	6.11	5.46	5.19	5.77 /	9.06
GHLC-17	11.83	11.37	10.10	8.67	7.46	6.70	6.13	5.48	5.20	5.84 /	9.09
GHLC-18	11.79	11.33	10.02	8.59	7.49	6.69	6.13	5.50	5.23	5.96 /	8.96
GHLC-19	11.74	11.25	9.91	8.54	7.42	6.63	6.10	5.47	5.20	5.80 /	8.94
GHLC-20	11.82	11.28	9.94	8.54	7.50	6.73	6.17	5.54	5.28	5.69 /	9.05
GHLC-21	11.83	11.34	9.95	8.50	7.53	6.75	6.21	5.58	5.31	5.82 /	8.94
GHLC-22	11.97	11.41	10.09	8.62	7.58	6.77	6.22	5.59	5.32	5.96 /	8.98
GHLC-23	12.03	11.50	10.11	8.64	7.61	6.81	6.25	5.61	5.34	5.96 /	8.95
GHLC-24	12.01	11.45	10.07	8.63	7.61	6.84	6.27	5.65	5.38	5.90 /	9.02
GHLC-25	11.86	11.30	9.85	8.50	7.53	6.82	6.26	5.65	5.38	5.72 /	9.08
GHLC-26	11.58	11.08	9.65	8.34	7.39	6.70	6.18	5.61	5.35	5.59 /	8.68
GHLC-27	10.93	10.41	9.04	8.03	7.23	6.60	6.12	5.62	5.37	5.28 /	8.93
GHLC-28	11.64	11.07	9.59	8.31	7.40	6.71	6.19	5.64	5.37	5.59 /	8.95
GHLC-29	10.88	10.37	9.01	8.02	7.21	6.58	6.11	5.62	5.38	5.29 /	8.97
GHLC-30	10.78	10.26	8.97	7.98	7.19	6.56	6.09	5.62	5.38	5.31 /	9.04
GHLC-31	10.63	10.11	8.83	7.86	7.09	6.48	6.05	5.59	5.36	5.08 /	8.86
GHLC-32	10.49	9.95	8.70	7.73	7.03	6.47	6.05	5.61	5.37	5.01 /	8.77
GHLC-33	10.78	10.21	8.92	7.97	7.15	6.54	6.09	5.62	5.38	5.20 /	8.92
GHLC-34	10.61	10.08	8.78	7.80	7.07	6.47	6.07	5.62	5.38	5.11 /	8.80
GHLC-35	10.70	10.14	8.86	7.90	7.12	6.50	6.08	5.62	5.39	5.18 /	8.85
GHLC-36	11.21	10.59	9.22	8.13	7.33	6.64	6.16	5.66	5.40	5.43 /	9.12
GHLC-37	11.07	10.49	9.12	8.10	7.26	6.60	6.13	5.64	5.39	5.23 /	8.90
GHLC-38	11.38	10.74	9.28	8.24	7.37	6.69	6.19	5.67	5.41	5.49 /	9.07
GHLC-39	11.24	10.55	9.19	8.12	7.28	6.62	6.14	5.64	5.39	5.30 /	8.94
GHLC-40	11.73	11.06	9.55	8.38	7.50	6.79	6.25	5.70	5.42	5.83 /	9.23
GHLC-41	11.33	10.66	9.27	8.23	7.34	6.69	6.18	5.67	5.41	5.50 /	8.99
GHLC-42	11.76	11.09	9.59	8.41	7.50	6.79	6.24	5.69	5.42	5.91 /	9.22
GHLC-43	12.18	11.45	9.88	8.64	7.67	6.90	6.32	5.72	5.44	6.21 /	9.44
GHLC-44	12.84	12.07	10.44	9.06	7.97	7.11	6.46	5.79	5.48	6.52 /	9.75
GHLC-45	12.64	11.85	10.22	8.90	7.83	7.02	6.39	5.74	5.45	6.34 /	9.57
GHLC-46	12.82	11.98	10.31	8.94	7.88	7.07	6.42	5.76	5.45	6.37 /	9.57
GHLC-47	12.87	12.08	10.36	8.95	7.89	7.07	6.45	5.76	5.45	6.37 /	9.54
GHLC-48	12.18	11.43	9.74	8.55	7.58	6.86	6.31	5.71	5.43	5.98 /	9.08
GHLC-49	12.26	11.48	9.79	8.52	7.58	6.85	6.30	5.70	5.42	5.97 /	9.06
GHLC-50	12.93	12.11	10.35	8.99	7.88	7.06	6.44	5.77	5.45	6.33 /	9.41
GHLC-51	12.51	11.74	9.98	8.64	7.67	6.92	6.34	5.73	5.43	6.08 /	9.12
GHLC-52	12.12	11.32	9.69	8.49	7.53	6.82	6.26	5.69	5.42	5.89 /	8.95
GHLC-53	12.38	11.60	9.87	8.62	7.64	6.89	6.32	5.72	5.44	6.04 /	9.03
JHF-S1	11.99	11.47	10.48	9.29	8.05	7.02	6.31	5.44	5.04	6.68 /	9.80
JHF-S2	11.99	11.47	10.46	9.25	8.01	6.99	6.28	5.42	5.03	6.66 /	9.60
JHF-S3	11.99	11.47	10.42	9.22	8.03	7.00	6.29	5.43	5.04	6.67 /	9.49
JHF-S4	11.83	11.37	10.24	9.00	7.76	6.87	6.21	5.45	5.11	6.30 /	9.31
JHF-S5	11.68	11.25	10.11	8.79	7.58	6.74	6.15	5.42	5.13	6.06 /	9.14
JHF-S6	11.73	11.27	10.17	8.83	7.63	6.79	6.17	5.45	5.15	6.10 /	9.09
JHF-S7	11.75	11.25	10.12	8.78	7.61	6.76	6.16	5.44	5.13	6.06 /	9.04
JHF-S8	11.42	10.95	9.72	8.34	7.30	6.59	6.08	5.47	5.22	5.67 /	8.58
JHF-S9	11.44	10.97	9.75	8.36	7.30	6.59	6.08	5.48	5.22	5.67 /	8.60
JHF-S10	11.32	10.82	9.46	8.15	7.28	6.62	6.13	5.58	5.33	5.48 /	8.24

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-S11	11.78	11.26	9.82	8.45	7.50	6.78	6.25	5.67	5.40	5.80 /	8.93
JHF-S12	12.03	11.42	9.92	8.53	7.60	6.86	6.31	5.71	5.45	5.92 /	9.16
JHF-S13	7.49	7.29	6.77	6.06	5.41	4.92	4.52	4.02	3.75	2.90 /	8.82
JHF-S14	7.43	7.31	6.75	6.01	5.39	4.89	4.50	3.99	3.72	2.87 /	8.78
JHF-S15	7.51	7.34	6.76	6.04	5.41	4.91	4.51	4.00	3.72	2.86 /	8.74
JHF-S16	7.96	7.70	7.13	6.43	5.70	5.15	4.73	4.13	3.88	3.26 /	8.77
JHF-S17	7.88	7.73	7.09	6.37	5.69	5.13	4.71	4.12	3.86	3.18 /	8.59
JHF-S18	7.85	7.68	7.08	6.39	5.66	5.10	4.67	4.09	3.83	3.17 /	8.50
GHLC-S1	11.64	11.09	10.20	9.04	7.92	6.94	6.16	5.19	4.75	6.43 /	10.44
GHLC-S2	11.62	11.04	10.12	9.06	7.90	6.92	6.15	5.19	4.76	6.51 /	10.45
GHLC-S3	11.69	11.15	10.27	9.13	7.95	6.95	6.17	5.22	4.78	6.47 /	10.39
GHLC-S4	11.91	11.32	10.43	9.26	8.04	6.99	6.24	5.31	4.89	6.63 /	10.41
GHLC-S5	11.86	11.33	10.34	9.20	8.02	6.97	6.23	5.30	4.87	6.66 /	10.37
GHLC-S6	12.01	11.47	10.48	9.28	8.10	7.06	6.30	5.37	4.96	6.82 /	10.07
GHLC-S7	11.97	11.45	10.46	9.31	8.10	7.04	6.30	5.37	4.95	6.88 /	10.09
GHLC-S8	11.99	11.46	10.51	9.29	8.11	7.06	6.30	5.38	4.97	6.88 /	10.07
GHLC-S9	11.96	11.39	10.49	9.31	8.09	7.03	6.30	5.38	4.96	6.86 /	10.05
GHLC-S10	11.94	11.38	10.48	9.31	8.09	7.04	6.30	5.38	4.96	6.84 /	10.05

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。