

PSJ 予測統計値
(平均値)

2009年 1月 5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：新光,野村,三菱UFJ,ゴールドマン・サックス,メルガン・スタンレー,クレディ・スイス,ドイツ,BNPパリバ,JPモルガン,みずほ,UBS,メリル・リンチ日本,大和SMBC,新生,日興フィナンシャルグループ												
回号	Yield Curve Scenarios (%)										最低 / 最高(%)	
	-300bp	-200bp	-100bp	-50bp	0bp	50bp	100bp	200bp	300bp			
JHF-1	14.05	13.45	12.08	10.53	9.37	8.62	8.02	7.41	7.01	7.62 / 12.51		
JHF-2	14.03	13.36	11.98	10.49	9.34	8.59	8.01	7.38	7.00	7.60 / 12.46		
JHF-3	14.20	13.56	12.14	10.61	9.40	8.63	8.03	7.40	7.00	7.66 / 12.69		
JHF-4	14.41	13.74	12.33	10.67	9.46	8.67	8.06	7.42	7.00	7.69 / 12.98		
JHF-5	14.74	14.06	12.57	10.87	9.57	8.76	8.13	7.43	7.00	7.65 / 13.16		
JHF-6	14.49	13.85	12.36	10.70	9.47	8.69	8.09	7.42	6.99	7.68 / 12.86		
JHF-7	13.68	13.08	11.64	10.25	9.21	8.53	7.97	7.38	6.99	7.55 / 12.30		
JHF-8	14.45	13.74	12.25	10.69	9.45	8.67	8.06	7.41	7.01	7.68 / 12.84		
JHF-9	13.86	13.23	11.78	10.35	9.25	8.56	7.99	7.39	7.00	7.59 / 12.49		
JHF-10	13.34	12.73	11.34	10.05	9.10	8.44	7.93	7.38	6.99	7.48 / 12.16		
JHF-11	13.94	13.29	11.84	10.37	9.31	8.58	8.03	7.43	7.04	7.57 / 12.79		
JHF-12	13.84	13.26	11.78	10.35	9.29	8.57	8.02	7.44	7.04	7.45 / 12.70		
JHF-13	13.82	13.14	11.75	10.31	9.30	8.58	8.05	7.47	7.08	7.50 / 12.82		
JHF-14	13.44	12.85	11.43	10.07	9.17	8.48	7.99	7.44	7.05	7.53 / 12.43		
JHF-15	15.13	14.42	12.79	11.03	9.76	8.90	8.30	7.62	7.19	7.51 / 14.14		
JHF-16	15.99	15.23	13.48	11.53	10.03	9.12	8.42	7.68	7.23	7.45 / 14.98		
JHF-17	15.29	14.55	12.88	11.16	9.82	9.00	8.35	7.65	7.21	7.49 / 14.00		
JHF-18	14.99	14.35	12.67	10.93	9.70	8.91	8.29	7.63	7.20	7.49 / 13.63		
JHF-19	14.08	13.41	11.86	10.38	9.37	8.67	8.13	7.54	7.14	7.46 / 12.74		
JHF-20	14.28	13.58	12.03	10.52	9.47	8.74	8.18	7.58	7.18	7.42 / 12.96		
GHLC-1	12.73	12.20	11.27	9.65	8.19	7.09	6.29	5.41	4.95	6.26 / 10.10		
GHLC-2	12.85	12.27	11.33	9.70	8.20	7.11	6.33	5.47	5.01	6.17 / 10.11		
GHLC-3	12.94	12.32	11.32	9.71	8.22	7.11	6.36	5.50	5.07	6.16 / 10.15		
GHLC-4	12.70	12.10	11.11	9.50	8.08	7.05	6.37	5.57	5.15	5.87 / 9.91		
GHLC-5	12.57	11.99	11.01	9.38	8.06	7.08	6.40	5.62	5.21	5.84 / 9.94		
GHLC-6	12.90	12.36	11.32	9.67	8.26	7.27	6.56	5.76	5.33	5.87 / 9.78		
GHLC-7	12.97	12.42	11.35	9.62	8.26	7.27	6.57	5.78	5.36	5.82 / 9.99		
GHLC-8	13.01	12.42	11.36	9.70	8.30	7.30	6.60	5.81	5.40	5.87 / 10.05		
GHLC-9	12.92	12.30	11.20	9.54	8.21	7.24	6.56	5.81	5.40	5.83 / 9.86		
GHLC-10	12.86	12.27	11.15	9.48	8.17	7.23	6.57	5.85	5.44	5.75 / 9.80		
GHLC-11	12.64	12.11	10.94	9.29	8.07	7.17	6.57	5.88	5.49	5.69 / 9.57		
GHLC-12	12.47	11.91	10.72	9.18	7.96	7.14	6.57	5.93	5.54	5.62 / 9.54		
GHLC-13	12.73	12.13	10.91	9.36	8.10	7.24	6.63	5.97	5.59	5.68 / 9.94		
GHLC-14	12.62	12.04	10.88	9.30	8.07	7.20	6.60	5.92	5.53	5.70 / 9.59		
GHLC-15	12.59	12.01	10.82	9.31	8.04	7.19	6.59	5.92	5.54	5.69 / 9.57		
GHLC-16	12.67	12.06	10.83	9.31	8.05	7.20	6.61	5.95	5.57	5.66 / 9.61		
GHLC-17	12.66	12.05	10.87	9.28	8.07	7.23	6.63	5.97	5.59	5.70 / 9.80		
GHLC-18	12.61	12.06	10.86	9.30	8.05	7.22	6.64	5.99	5.62	5.71 / 9.87		
GHLC-19	12.57	12.04	10.78	9.29	8.08	7.23	6.65	6.01	5.63	5.71 / 9.91		
GHLC-20	12.60	11.97	10.73	9.28	8.11	7.27	6.68	6.05	5.67	5.76 / 9.87		
GHLC-21	12.55	11.98	10.75	9.27	8.15	7.31	6.73	6.10	5.72	5.82 / 10.25		
GHLC-22	12.67	12.12	10.85	9.34	8.19	7.32	6.72	6.09	5.70	5.92 / 10.49		
GHLC-23	12.81	12.22	10.96	9.44	8.24	7.37	6.76	6.12	5.74	5.95 / 10.55		
GHLC-24	12.77	12.17	10.91	9.39	8.23	7.38	6.77	6.14	5.77	5.96 / 10.59		
GHLC-25	12.57	12.00	10.71	9.30	8.14	7.36	6.76	6.14	5.77	5.93 / 10.68		
GHLC-26	12.27	11.69	10.45	9.03	7.97	7.21	6.67	6.07	5.71	5.74 / 10.27		
GHLC-27	11.72	11.17	10.00	8.77	7.80	7.12	6.62	6.09	5.75	5.77 / 10.01		
GHLC-28	12.20	11.59	10.34	9.02	7.95	7.21	6.67	6.10	5.73	5.78 / 10.50		
GHLC-29	11.67	11.05	9.99	8.81	7.82	7.14	6.66	6.15	5.81	5.78 / 10.58		
GHLC-30	11.65	11.07	10.00	8.79	7.83	7.15	6.67	6.17	5.83	5.81 / 10.12		
GHLC-31	11.36	10.78	9.76	8.59	7.68	7.04	6.59	6.10	5.76	5.71 / 9.92		

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：新光、野村、三菱UFJ、ゴールドマン・サックス、モルガン・スタンレー、クレディ・スイス、ドイツ、BNPパリバ、JPモルガン、みずほ、UBS、メリル・リンチ日本、大和SMBC、新生、日興証券グループ

回号	Yield Curve Scenarios (%)									最低 / 最高(%)	
	-300bp	-200bp	-100bp	-50bp	0bp	50bp	100bp	200bp	300bp		
GHLC-32	11.05	10.53	9.45	8.41	7.56	6.96	6.54	6.06	5.73	5.68 /	9.81
GHLC-33	11.40	10.89	9.77	8.63	7.70	7.04	6.59	6.09	5.75	5.76 /	10.11
GHLC-34	11.12	10.59	9.55	8.41	7.58	6.96	6.55	6.08	5.75	5.68 /	9.99
GHLC-35	11.19	10.62	9.57	8.48	7.61	6.98	6.56	6.07	5.74	5.69 /	10.09
GHLC-36	11.73	11.15	10.02	8.80	7.83	7.12	6.66	6.14	5.79	5.80 /	10.41
GHLC-37	11.54	11.02	9.89	8.70	7.76	7.08	6.62	6.11	5.76	5.76 /	10.34
GHLC-38	11.88	11.32	10.15	8.90	7.87	7.17	6.66	6.12	5.77	5.85 /	10.61
GHLC-39	11.75	11.16	10.05	8.77	7.84	7.15	6.66	6.14	5.78	5.81 /	10.56
GHLC-40	12.31	11.74	10.47	9.11	8.05	7.29	6.75	6.18	5.81	5.93 /	11.00
GHLC-41	11.76	11.19	10.00	8.81	7.82	7.15	6.65	6.11	5.75	5.83 /	10.65
GHLC-42	12.31	11.74	10.52	9.12	8.06	7.32	6.77	6.20	5.82	5.97 /	11.02
GHLC-43	12.70	12.06	10.81	9.35	8.18	7.39	6.81	6.19	5.80	6.09 /	11.37
GHLC-44	13.56	12.81	11.44	9.86	8.51	7.61	6.96	6.26	5.85	6.31 /	12.18
GHLC-45	13.25	12.54	11.18	9.64	8.37	7.53	6.90	6.24	5.84	6.19 /	11.81
GHLC-46	13.46	12.74	11.39	9.77	8.46	7.61	6.96	6.28	5.88	6.23 /	11.99
GHLC-47	13.49	12.82	11.39	9.79	8.47	7.62	7.00	6.29	5.89	6.23 /	12.00
GHLC-48	12.77	12.10	10.75	9.32	8.18	7.44	6.88	6.25	5.87	6.02 /	11.37
GHLC-49	12.74	12.04	10.71	9.25	8.15	7.41	6.85	6.23	5.84	6.02 /	11.40
GHLC-50	13.58	12.87	11.44	9.81	8.50	7.65	7.03	6.32	5.91	6.22 /	12.13
GHLC-51	13.05	12.36	10.93	9.44	8.25	7.48	6.90	6.26	5.86	6.08 /	11.65
GHLC-52	12.72	12.02	10.67	9.26	8.14	7.42	6.84	6.25	5.87	6.01 /	11.36
GHLC-53	12.97	12.37	10.94	9.42	8.27	7.51	6.92	6.29	5.89	6.07 /	11.65
JHF-S1	12.66	12.10	11.02	9.52	8.23	7.26	6.56	5.77	5.34	5.76 /	9.83
JHF-S2	12.68	12.11	11.04	9.51	8.21	7.23	6.54	5.75	5.33	5.74 /	9.71
JHF-S3	12.71	12.15	11.06	9.54	8.27	7.30	6.60	5.81	5.39	5.75 /	9.80
JHF-S4	12.69	12.13	10.95	9.43	8.21	7.29	6.64	5.92	5.52	5.66 /	9.57
JHF-S5	12.49	11.94	10.78	9.24	8.09	7.22	6.62	5.94	5.55	5.58 /	9.52
JHF-S6	12.55	12.03	10.83	9.36	8.14	7.26	6.65	5.96	5.57	5.59 /	9.81
JHF-S7	12.61	12.04	10.92	9.38	8.17	7.29	6.69	5.98	5.60	5.59 /	10.32
JHF-S8	11.99	11.47	10.24	8.90	7.82	7.09	6.60	6.00	5.66	5.48 /	10.01
JHF-S9	12.00	11.44	10.33	8.88	7.85	7.12	6.62	6.02	5.68	5.49 /	10.46
JHF-S10	11.74	11.22	10.05	8.78	7.85	7.17	6.70	6.15	5.81	5.56 /	10.70
JHF-S11	12.38	11.84	10.53	9.22	8.15	7.39	6.86	6.28	5.90	5.77 /	11.15
JHF-S12	12.58	12.00	10.78	9.38	8.25	7.48	6.93	6.34	5.95	5.90 /	11.23
GHLC-S1	12.65	12.06	11.04	9.62	8.25	7.24	6.46	5.58	5.13	6.02 /	10.06
GHLC-S2	12.67	12.06	11.03	9.59	8.23	7.23	6.45	5.58	5.12	5.99 /	9.97
GHLC-S3	12.66	12.07	11.04	9.60	8.25	7.24	6.47	5.61	5.14	6.03 /	9.91
GHLC-S4	12.68	12.09	11.05	9.59	8.26	7.23	6.50	5.66	5.21	5.92 /	9.97
GHLC-S5	12.76	12.19	11.12	9.65	8.27	7.26	6.52	5.69	5.24	5.87 /	9.93
GHLC-S6	12.81	12.21	11.15	9.60	8.30	7.28	6.56	5.75	5.30	5.83 /	10.07
GHLC-S7	12.72	12.15	11.07	9.59	8.28	7.27	6.55	5.74	5.29	5.84 /	9.98
GHLC-S8	12.74	12.15	11.09	9.59	8.29	7.28	6.56	5.74	5.31	5.83 /	9.97
GHLC-S9	12.65	12.11	11.06	9.57	8.24	7.24	6.53	5.72	5.28	5.81 /	9.84
GHLC-S10	12.64	12.07	11.02	9.54	8.24	7.24	6.53	5.71	5.28	5.82 /	9.91

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（年始の最初の発表は、年末の最終営業日の午前11時現在、以下同じ。）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。