

P S J 予測統計値  
(中央値)

2010年 11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、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	13.14	13.14	11.39	10.05	8.77	8.12	7.43	7.21	6.89	7.05 / 11.60		
JHF-2	13.53	13.05	11.33	9.96	8.73	8.10	7.42	7.21	6.87	7.01 / 11.52		
JHF-3	13.73	13.23	11.40	10.06	8.73	8.14	7.47	7.23	6.90	7.25 / 11.68		
JHF-4	13.60	13.44	11.48	10.18	8.79	8.26	7.47	7.24	6.93	7.65 / 11.59		
JHF-5	13.95	13.95	11.87	10.33	8.96	8.34	7.53	7.26	7.03	7.92 / 12.06		
JHF-6	13.64	13.64	11.63	10.19	8.80	8.31	7.54	7.20	6.93	7.51 / 11.83		
JHF-7	13.26	12.68	10.95	9.56	8.71	8.10	7.51	7.21	6.78	6.52 / 11.34		
JHF-8	13.90	13.48	11.53	10.02	8.88	8.31	7.63	7.20	6.86	7.29 / 11.82		
JHF-9	13.41	12.97	11.03	9.79	8.80	8.31	7.65	7.22	6.82	6.64 / 11.42		
JHF-10	13.06	12.53	10.58	9.47	8.72	8.07	7.59	7.20	6.77	6.23 / 11.10		
JHF-11	13.10	12.80	10.92	9.79	8.79	8.19	7.62	7.27	6.80	6.59 / 11.59		
JHF-12	13.65	12.86	10.81	9.66	8.71	8.19	7.54	7.28	6.80	6.59 / 11.47		
JHF-13	13.32	12.46	10.71	9.67	8.66	8.10	7.55	7.24	6.80	6.39 / 11.54		
JHF-14	12.54	12.17	10.47	9.51	8.69	8.15	7.54	7.11	6.77	6.34 / 11.17		
JHF-15	14.29	13.61	11.33	10.15	9.06	8.39	7.62	7.33	6.80	7.71 / 12.23		
JHF-16	14.47	14.12	11.95	10.58	9.23	8.52	7.74	7.33	6.89	8.05 / 12.62		
JHF-17	14.08	13.60	11.31	10.32	9.25	8.50	7.77	7.38	6.86	7.78 / 12.40		
JHF-18	13.96	13.21	11.13	10.14	9.02	8.43	7.71	7.36	6.88	7.69 / 12.05		
JHF-19	13.50	12.73	10.61	9.64	8.84	8.22	7.61	7.08	6.79	6.70 / 11.30		
JHF-20	13.72	12.89	10.70	9.67	8.88	8.23	7.68	7.10	6.84	6.91 / 11.48		
JHF-21	13.89	12.84	10.90	9.85	8.99	8.32	7.70	7.18	6.86	7.31 / 11.83		
JHF-22	13.86	13.18	10.90	9.85	8.98	8.30	7.69	7.19	6.87	7.38 / 11.97		
JHF-23	14.36	13.83	11.22	10.19	9.17	8.38	7.76	7.35	6.92	8.06 / 12.49		
JHF-24	14.01	13.46	11.08	9.98	9.09	8.34	7.73	7.24	6.89	7.43 / 12.34		
JHF-25	14.07	13.83	10.96	9.93	9.05	8.30	7.70	7.21	6.86	7.44 / 12.18		
JHF-26	14.65	13.96	11.26	10.16	9.10	8.36	7.76	7.25	6.82	8.05 / 12.28		
JHF-27	14.29	13.82	11.03	10.03	9.06	8.23	7.77	7.14	6.89	7.41 / 12.04		
JHF-28	13.53	13.04	10.45	9.58	8.70	8.06	7.64	7.03	6.76	6.71 / 11.46		
JHF-29	13.41	12.82	10.34	9.52	8.65	8.02	7.68	7.23	6.76	6.56 / 11.19		
JHF-30	13.19	12.43	10.17	9.38	8.55	7.98	7.67	7.20	6.78	6.43 / 10.93		
JHF-31	12.67	12.08	10.12	9.26	8.47	7.93	7.67	7.15	6.78	6.32 / 10.72		
JHF-32	13.11	12.36	10.18	9.43	8.60	8.01	7.72	7.23	6.79	6.41 / 11.11		
JHF-33	12.38	11.97	10.04	9.24	8.47	7.96	7.71	7.16	6.83	6.31 / 10.79		
JHF-34	12.42	11.94	10.09	9.31	8.53	8.00	7.75	7.22	6.87	6.34 / 10.97		
JHF-35	10.77	10.23	9.04	8.51	8.04	7.79	7.30	6.88	6.54	5.94 / 9.70		
JHF-36	10.61	10.06	8.89	8.39	7.99	7.77	7.28	6.86	6.52	5.89 / 9.53		
JHF-37	10.72	10.02	8.89	8.40	8.01	7.79	7.32	6.86	6.52	5.93 / 9.50		
JHF-38	10.97	9.81	8.73	8.25	7.97	7.78	7.25	6.81	6.51	5.88 / 9.37		
JHF-39	10.64	9.57	8.56	8.20	7.93	7.79	7.19	6.78	6.49	5.70 / 9.25		
JHF-40	10.26	9.30	8.45	8.19	7.90	7.79	7.29	6.74	6.53	5.54 / 9.11		
JHF-41	9.96	9.06	8.29	8.14	7.88	7.47	7.07	6.68	6.49	5.48 / 9.01		
JHF-42	9.57	8.74	8.17	7.93	7.73	7.41	7.00	6.66	6.49	5.39 / 8.74		
GHLC-1	11.94	11.94	11.89	10.26	9.12	7.11	5.95	5.19	4.62	4.73 / 11.03		
GHLC-2	12.44	12.44	12.34	10.31	8.70	7.13	5.94	5.25	4.80	5.18 / 11.18		
GHLC-3	12.59	12.59	12.19	10.31	8.50	7.01	6.21	5.33	4.86	5.49 / 10.77		
GHLC-4	12.41	12.41	11.91	10.36	8.63	7.16	6.44	5.50	5.02	5.82 / 10.80		
GHLC-5	12.54	12.54	11.78	10.46	8.63	7.14	6.45	5.52	5.11	5.73 / 10.81		
GHLC-6	12.44	12.44	11.61	10.44	8.87	7.24	6.57	5.66	5.12	6.10 / 10.41		
GHLC-7	12.54	12.54	11.71	10.53	8.92	7.25	6.43	5.53	5.14	6.04 / 10.29		
GHLC-8	12.51	12.51	11.56	10.25	8.44	7.15	6.53	5.63	5.16	6.21 / 10.14		
GHLC-9	12.50	12.50	11.26	10.03	8.20	6.98	6.42	5.57	5.13	6.18 / 10.22		

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	12.27	12.27	10.98	9.81	8.14	6.99	6.45	5.58	5.10	6.35 / 10.05
GHLC-11	11.83	11.83	10.64	9.37	8.03	7.07	6.52	5.55	5.21	6.53 / 9.90
GHLC-12	11.46	11.46	10.25	8.96	7.81	7.06	6.40	5.54	5.28	6.27 / 9.38
GHLC-13	11.69	11.69	10.37	8.98	7.85	7.04	6.45	5.55	5.32	6.10 / 10.13
GHLC-14	11.76	11.76	10.54	9.24	7.99	7.12	6.50	5.58	5.26	6.43 / 9.85
GHLC-15	11.63	11.63	10.36	9.15	7.88	7.16	6.47	5.55	5.35	6.35 / 9.85
GHLC-16	11.71	11.71	10.37	8.99	7.79	7.06	6.41	5.55	5.34	6.06 / 9.86
GHLC-17	11.62	11.62	10.35	9.03	7.87	7.16	6.42	5.55	5.36	6.10 / 9.74
GHLC-18	11.64	11.64	10.23	8.85	7.71	7.09	6.43	5.54	5.41	6.38 / 9.60
GHLC-19	11.43	11.43	10.14	8.76	7.60	7.09	6.37	5.53	5.47	6.32 / 9.43
GHLC-20	11.42	11.42	10.08	8.79	7.62	7.10	6.37	5.69	5.57	6.15 / 9.57
GHLC-21	11.41	11.41	10.10	8.55	7.57	7.12	6.37	5.69	5.57	6.27 / 9.68
GHLC-22	11.75	11.75	10.27	8.77	7.65	7.15	6.47	5.65	5.49	6.41 / 9.99
GHLC-23	11.72	11.72	10.27	8.75	7.67	7.15	6.46	5.71	5.59	6.41 / 9.90
GHLC-24	11.66	11.66	10.22	8.66	7.72	7.15	6.46	5.80	5.63	6.20 / 9.90
GHLC-25	11.46	11.46	10.07	8.49	7.74	7.06	6.56	5.94	5.63	6.08 / 9.77
GHLC-26	10.96	10.96	9.84	8.16	7.74	7.11	6.48	5.82	5.51	5.99 / 9.32
GHLC-27	9.97	9.97	8.98	8.06	7.36	7.09	6.44	5.94	5.51	5.53 / 9.41
GHLC-28	10.90	10.90	9.73	8.15	7.65	7.17	6.46	5.92	5.52	5.89 / 9.53
GHLC-29	9.86	9.86	8.89	7.95	7.35	7.07	6.37	5.96	5.58	5.51 / 9.44
GHLC-30	9.76	9.76	8.82	7.87	7.25	6.98	6.32	5.98	5.60	5.45 / 9.53
GHLC-31	9.40	9.40	8.47	7.91	7.35	6.90	6.38	5.88	5.51	5.29 / 9.29
GHLC-32	9.20	9.13	8.44	7.90	7.31	6.78	6.39	5.89	5.54	5.20 / 9.18
GHLC-33	9.55	9.55	8.60	7.99	7.39	6.93	6.45	5.95	5.57	5.43 / 9.38
GHLC-34	9.41	9.26	8.53	7.97	7.41	6.81	6.43	5.91	5.56	5.30 / 9.25
GHLC-35	9.58	9.45	8.49	7.98	7.41	6.84	6.45	5.90	5.55	5.35 / 9.30
GHLC-36	10.26	10.26	9.18	7.95	7.41	7.05	6.43	6.00	5.60	5.57 / 9.44
GHLC-37	10.04	9.77	8.73	7.84	7.41	7.04	6.43	5.94	5.56	5.45 / 9.35
GHLC-38	10.58	10.35	9.24	8.27	7.53	7.18	6.46	6.00	5.60	5.79 / 9.59
GHLC-39	10.55	10.09	8.99	8.13	7.46	7.11	6.45	5.96	5.59	5.59 / 9.43
GHLC-40	10.87	10.87	9.68	8.43	7.61	7.26	6.50	6.07	5.64	6.19 / 9.78
GHLC-41	10.65	10.26	9.13	8.20	7.48	7.10	6.48	6.00	5.62	5.80 / 9.46
GHLC-42	11.01	10.98	9.70	8.33	7.60	7.22	6.48	6.07	5.65	6.23 / 9.76
GHLC-43	11.68	11.47	10.02	8.63	7.74	7.34	6.59	6.12	5.68	6.72 / 9.98
GHLC-44	12.67	11.63	10.53	9.04	7.99	7.55	6.63	6.13	5.73	7.15 / 10.35
GHLC-45	12.26	11.64	10.29	8.86	7.98	7.53	6.68	6.13	5.70	6.92 / 10.15
GHLC-46	12.46	11.39	10.33	8.95	8.09	7.50	6.75	6.13	5.73	6.98 / 10.17
GHLC-47	12.49	11.44	10.35	8.94	8.11	7.61	6.76	6.15	5.71	6.96 / 10.13
GHLC-48	12.18	11.36	9.74	8.53	7.81	7.34	6.57	6.04	5.66	6.23 / 9.65
GHLC-49	11.91	11.36	9.71	8.46	7.82	7.34	6.69	6.06	5.65	6.43 / 9.61
GHLC-50	12.63	11.59	10.27	8.92	8.17	7.61	6.77	6.16	5.71	6.90 / 10.23
GHLC-51	11.79	11.35	9.89	8.59	7.97	7.48	6.66	6.08	5.66	6.60 / 9.81
GHLC-52	12.24	11.24	9.62	8.36	7.71	7.25	6.63	6.09	5.61	6.31 / 9.54
GHLC-53	12.48	11.50	9.78	8.49	7.86	7.37	6.60	6.08	5.67	6.54 / 9.81
JHF-S1	11.79	11.79	10.99	9.66	8.48	7.16	6.32	5.54	5.12	7.09 / 10.17
JHF-S2	11.78	11.78	10.92	9.60	8.48	7.12	6.32	5.56	5.10	7.11 / 10.01
JHF-S3	11.83	11.83	10.81	9.65	8.50	7.17	6.28	5.56	5.13	7.15 / 10.11
JHF-S4	11.60	11.60	10.33	9.24	8.35	7.02	6.37	5.61	5.31	6.99 / 9.85
JHF-S5	11.34	11.34	10.09	8.93	7.96	6.85	6.34	5.60	5.37	6.66 / 9.63
JHF-S6	11.40	11.40	10.12	9.08	8.23	6.89	6.35	5.62	5.37	6.75 / 9.68
JHF-S7	11.36	11.36	10.13	9.08	8.09	6.91	6.32	5.59	5.37	6.73 / 9.57
JHF-S8	10.65	10.65	9.56	8.63	7.59	6.83	6.26	5.69	5.42	6.13 / 9.04
JHF-S9	10.66	10.66	9.56	8.58	7.60	6.83	6.27	5.68	5.42	6.17 / 9.07
JHF-S10	10.19	10.19	9.17	8.39	7.61	7.00	6.23	5.91	5.42	5.88 / 8.86
JHF-S11	10.95	10.95	9.67	8.67	7.71	7.13	6.48	6.03	5.57	6.24 / 9.65

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-S12	11.23	11.23	9.81	8.75	7.79	7.24	6.66	6.11	5.61	6.36 /	9.83
JHF-S13	7.44	7.44	7.43	6.92	6.41	5.41	4.88	4.54	3.72	2.98 /	9.23
JHF-S14	7.46	7.46	7.50	6.98	6.45	5.45	4.90	4.51	3.77	2.95 /	9.13
JHF-S15	7.50	7.50	7.49	7.00	6.47	5.49	4.88	4.55	3.73	2.94 /	9.08
JHF-S16	7.92	7.92	7.85	7.09	6.77	5.78	5.07	4.61	3.90	3.35 /	9.13
JHF-S17	7.92	7.92	7.81	7.19	6.74	5.74	5.02	4.59	3.90	3.27 /	8.91
JHF-S18	7.94	7.94	7.85	7.13	6.74	5.75	5.07	4.55	3.90	3.26 /	8.83
GHLC-S1	11.53	11.53	11.07	9.57	8.02	6.89	6.16	5.36	4.97	6.43 /	10.80
GHLC-S2	11.52	11.52	11.00	9.52	7.98	6.78	6.23	5.45	4.93	6.51 /	10.83
GHLC-S3	11.72	11.72	10.97	9.72	8.09	6.83	6.00	5.38	4.94	6.53 /	10.80
GHLC-S4	11.78	11.78	11.03	9.74	8.16	6.83	6.16	5.39	5.05	6.64 /	10.82
GHLC-S5	11.78	11.78	10.96	9.74	8.16	6.83	6.22	5.43	5.02	6.70 /	10.74
GHLC-S6	11.90	11.90	11.04	9.86	8.38	7.03	6.30	5.44	5.14	6.84 /	10.42
GHLC-S7	11.92	11.92	10.94	9.85	8.36	7.01	6.31	5.44	5.10	6.86 /	10.43
GHLC-S8	11.83	11.83	11.07	9.80	8.30	7.00	6.32	5.42	5.09	6.92 /	10.41
GHLC-S9	11.84	11.84	10.93	9.76	8.34	7.04	6.24	5.42	5.07	6.94 /	10.38
GHLC-S10	11.78	11.78	10.86	9.70	8.35	7.08	6.24	5.41	5.10	6.98 /	10.36

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。