

お詫び

野村証券 金融工学研究センター
インデックス・プロダクツ・グループ
2013年10月10日

2013年10月9日における指数・ポートフォリオ指標の訂正について

2013年10月9日における日次投資収益指数およびポートフォリオ指標について、下記の通り訂正いたします。これは、一部の銘柄における時価の訂正によるものです。

■訂正後(赤字部分が訂正箇所です)

訂正後	累積投資 収益指数	前月末 来リター ン(%)	単価 (円)	利含 単価 (円)	残存 (年)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
NOMURA-BPI 総合 全体	350.454	11.51	105.28	105.50	8.40	0.57	0.59	7.60	7.56	7.55	5
NOMURA-BPI 総合 長期(7-)	495.084	23.00	108.07	108.35	14.64	1.01	1.03	12.64	12.57	12.54	3
NOMURA-BPI 総合 超長期(11-)	216.332	31.03	110.41	110.72	18.70	1.29	1.32	15.45	15.35	15.28	2
NOMURA-BPI MBS 全体	120.883	6.21	104.44	104.58	6.76	1.47	0.89	6.33	6.30	6.11	13
NOMURA-BPI 除くABS 全体	350.474	11.52	105.28	105.51	8.40	0.57	0.58	7.60	7.57	7.56	5
NOMURA-BPI 除くABS 長期(7-)	495.087	23.00	108.07	108.35	14.64	1.01	1.03	12.64	12.57	12.54	3
NOMURA-BPI 除くABS 超長期(11-)	216.332	31.03	110.41	110.72	18.70	1.29	1.32	15.45	15.35	15.28	2
NOMURA-BPI 除く国債 全体	164.400	6.89	103.90	104.16	6.14	0.61	0.58	5.73	5.71	5.70	20
NOMURA-BPI 除く国債 長期(7-)	217.537	15.18	105.34	105.60	11.11	1.05	0.96	9.96	9.91	9.88	16
NOMURA-BPI 除く国債 超長期(11-)	218.167	19.77	107.30	107.61	13.71	1.43	1.25	11.71	11.63	11.54	18
NOMURA-BPI/Extended 総合 全体	350.687	11.50	105.26	105.49	8.39	0.58	0.59	7.59	7.55	7.54	5
NOMURA-BPI/Extended 総合 長期(7-)	495.682	23.00	108.07	108.34	14.64	1.01	1.03	12.64	12.57	12.54	3
NOMURA-BPI/Extended 総合 超長期(11-)	216.659	31.03	110.40	110.72	18.70	1.29	1.32	15.45	15.35	15.28	3
NOMURA-BPI/Extended MBS 全体	120.883	6.21	104.44	104.58	6.76	1.47	0.89	6.33	6.30	6.11	13
NOMURA-BPI/Extended 除くABS 全体	350.707	11.51	105.27	105.50	8.39	0.58	0.59	7.59	7.56	7.55	5
NOMURA-BPI/Extended 除くABS 長期(7-)	495.686	23.00	108.07	108.34	14.64	1.01	1.03	12.64	12.57	12.54	3
NOMURA-BPI/Extended 除くABS 超長期(11-)	216.659	31.03	110.40	110.72	18.70	1.29	1.32	15.45	15.35	15.28	3
NOMURA-BPI/Extended 除く国債 全体	164.748	6.88	103.86	104.12	6.11	0.62	0.59	5.71	5.69	5.68	21
NOMURA-BPI/Extended 除く国債 長期(7-)	218.492	15.19	105.32	105.58	11.11	1.05	0.97	9.96	9.91	9.88	16
NOMURA-BPI/Extended 除く国債 超長期(11-)	219.900	19.79	107.25	107.56	13.71	1.44	1.26	11.71	11.63	11.54	19

■訂正前

訂正前	累積投資 収益指数	前月末 来リター ン(%)	単価 (円)	利含 単価 (円)	残存 (年)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
NOMURA-BPI 総合 全体	350.449	11.45	105.28	105.50	8.40	0.57	0.59	7.60	7.56	7.55	5
NOMURA-BPI 総合 長期(7-)	495.070	22.89	108.07	108.34	14.64	1.01	1.03	12.64	12.57	12.54	3
NOMURA-BPI 総合 超長期(11-)	216.322	30.84	110.41	110.72	18.70	1.29	1.32	15.45	15.35	15.28	3
NOMURA-BPI MBS 全体	120.768	2.36	104.35	104.48	6.76	1.47	0.90	6.33	6.30	6.11	15
NOMURA-BPI 除くABS 全体	350.469	11.46	105.28	105.51	8.40	0.57	0.59	7.60	7.57	7.56	5
NOMURA-BPI 除くABS 長期(7-)	495.073	22.88	108.07	108.34	14.64	1.01	1.03	12.64	12.57	12.54	3
NOMURA-BPI 除くABS 超長期(11-)	216.322	30.84	110.41	110.72	18.70	1.29	1.32	15.45	15.35	15.28	3
NOMURA-BPI 除く国債 全体	164.390	6.65	103.90	104.16	6.14	0.61	0.58	5.73	5.71	5.70	20
NOMURA-BPI 除く国債 長期(7-)	217.499	14.47	105.33	105.59	11.11	1.05	0.97	9.96	9.91	9.88	16
NOMURA-BPI 除く国債 超長期(11-)	218.092	18.37	107.26	107.57	13.71	1.43	1.26	11.71	11.63	11.54	19
NOMURA-BPI/Extended 総合 全体	350.683	11.44	105.26	105.49	8.39	0.58	0.59	7.59	7.55	7.54	5
NOMURA-BPI/Extended 総合 長期(7-)	495.668	22.89	108.07	108.34	14.64	1.01	1.03	12.64	12.57	12.54	3
NOMURA-BPI/Extended 総合 超長期(11-)	216.649	30.84	110.40	110.71	18.70	1.29	1.32	15.45	15.35	15.28	3
NOMURA-BPI/Extended MBS 全体	120.768	2.36	104.35	104.48	6.76	1.47	0.90	6.33	6.30	6.11	15
NOMURA-BPI/Extended 除くABS 全体	350.702	11.45	105.27	105.49	8.39	0.58	0.59	7.59	7.56	7.55	5
NOMURA-BPI/Extended 除くABS 長期(7-)	495.672	22.89	108.07	108.34	14.64	1.01	1.03	12.64	12.57	12.54	3
NOMURA-BPI/Extended 除くABS 超長期(11-)	216.649	30.84	110.40	110.71	18.70	1.29	1.32	15.45	15.35	15.28	3
NOMURA-BPI/Extended 除く国債 全体	164.739	6.64	103.86	104.12	6.11	0.62	0.59	5.71	5.69	5.68	21
NOMURA-BPI/Extended 除く国債 長期(7-)	218.454	14.48	105.30	105.56	11.11	1.05	0.97	9.96	9.91	9.88	16
NOMURA-BPI/Extended 除く国債 超長期(11-)	219.824	18.38	107.21	107.53	13.71	1.44	1.26	11.71	11.63	11.54	19

NOMURA-BPI をご利用の皆様ならびに関係各位にご迷惑をおかけしましたことを深くお詫び申し上げます。

今後とも NOMURA-BPI をよろしく願いたします。