

お知らせ

野村証券 金融工学研究センター
インデックス業務室
2016年3月17日

NOMURA 変動利付国債インデックス 金利モデルについて

現在、NOMURA 変動利付国債インデックスにおきまして、T スプレッドや実効デュレーション等一部のリスク指標値に関して、金利モデルを用いて算出しております。2016年3月28日付データより、本ウェブサイト“Performance”コーナーに提供しておりますリスク指標値を、マイナス金利に対応したモデルに基づいて計算されたリスク指標値へ切り替える予定です。

詳細は、当社営業にお問い合わせ下さい。

なお、本件に伴う投資収益指数・投資収益率への影響はございません。

今後とも NOMURA 変動利付国債インデックスをよろしくお願いいたします。