

お詫び

野村證券 金融工学研究センター
インデックス業務室
2018年9月14日

2018年9月10~12日における指数・ポートフォリオ指標の訂正について

2018年9月10~12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(赤字部分が訂正箇所です)。これは、一部の銘柄における時価の訂正によるものです。

■2018/9/10

2018/9/10 時点 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)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
NOMURA-BPI 総合 長期(7-)	576.777	0.55	112.01	112.46	0.39	0.40	14.08	14.04	14.02	3
NOMURA-BPI 総合 超長期(11-)	263.780	1.52	114.80	115.33	0.54	0.55	16.86	16.81	16.77	3
NOMURA-BPI MBS 全体	127.236	-0.08	102.58	102.58	0.87	0.38	5.75	5.74	5.53	26
NOMURA-BPI 除くABS 長期(7-)	576.790	0.55	112.01	112.46	0.39	0.40	14.08	14.04	14.02	3
NOMURA-BPI 除く国債 長期(7-)	243.492	0.21	106.09	106.32	0.54	0.46	10.94	10.91	10.87	22
NOMURA-BPI 除く国債 超長期(11-)	252.319	1.08	107.61	107.85	0.72	0.59	12.78	12.73	12.66	21
NOMURA-BPI/Extended 総合 長期(7-)	577.483	0.55	112.00	112.45	0.39	0.40	14.07	14.04	14.01	3
NOMURA-BPI/Extended 総合 超長期(11-)	264.185	1.52	114.80	115.33	0.54	0.55	16.86	16.81	16.77	3
NOMURA-BPI/Extended MBS 全体	127.236	-0.08	102.58	102.58	0.87	0.38	5.75	5.74	5.53	26
NOMURA-BPI/Extended 除くABS 全体	380.182	0.03	107.33	107.67	0.18	0.19	9.05	9.03	9.02	4
NOMURA-BPI/Extended 除くABS 長期(7-)	577.495	0.55	112.00	112.45	0.39	0.40	14.08	14.04	14.01	3
NOMURA-BPI/Extended 除く国債 長期(7-)	244.596	0.21	106.07	106.30	0.54	0.47	10.94	10.91	10.87	22
NOMURA-BPI/Extended 除く国債 超長期(11-)	254.371	1.08	107.60	107.85	0.72	0.59	12.78	12.74	12.66	21

2018/9/10 時点 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)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
NOMURA-BPI 総合 長期(7-)	576.778	0.56	112.01	112.46	0.39	0.40	14.08	14.04	14.02	3
NOMURA-BPI 総合 超長期(11-)	263.781	1.52	114.80	115.33	0.54	0.55	16.86	16.81	16.77	3
NOMURA-BPI MBS 全体	127.237	-0.05	102.58	102.58	0.87	0.38	5.75	5.74	5.53	25
NOMURA-BPI 除く ABS 長期(7-)	576.790	0.56	112.01	112.46	0.39	0.40	14.08	14.04	14.02	3
NOMURA-BPI 除く国債 長期(7-)	243.493	0.21	106.09	106.32	0.54	0.46	10.94	10.91	10.87	22
NOMURA-BPI 除く国債 超長期(11-)	252.320	1.09	107.61	107.85	0.72	0.58	12.78	12.73	12.66	21
NOMURA-BPI/Extended 総合 長期(7-)	577.483	0.56	112.00	112.45	0.39	0.40	14.07	14.04	14.01	3
NOMURA-BPI/Extended 総合 超長期(11-)	264.186	1.52	114.80	115.33	0.54	0.55	16.86	16.81	16.77	3
NOMURA-BPI/Extended MBS 全体	127.237	-0.05	102.58	102.58	0.87	0.38	5.75	5.74	5.53	25
NOMURA-BPI/Extended 除く ABS 全体	380.183	0.03	107.33	107.67	0.18	0.19	9.05	9.03	9.02	4
NOMURA-BPI/Extended 除く ABS 長期(7-)	577.495	0.56	112.00	112.45	0.39	0.40	14.08	14.04	14.01	3
NOMURA-BPI/Extended 除く国債 長期(7-)	244.597	0.21	106.07	106.30	0.54	0.47	10.94	10.91	10.87	22
NOMURA-BPI/Extended 除く国債 超長期(11-)	254.372	1.09	107.60	107.85	0.72	0.58	12.78	12.74	12.66	21

■2018/9/11

2018/9/11 時点 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)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
NOMURA-BPI 総合 長期(7-)	577.377	3.95	112.12	112.57	0.39	0.40	14.08	14.04	14.02	3
NOMURA-BPI MBS 全体	127.267	0.74	102.60	102.60	0.87	0.38	5.75	5.74	5.52	26
NOMURA-BPI 除く国債 全体	173.842	1.23	103.75	103.95	0.29	0.26	6.72	6.71	6.69	20
NOMURA-BPI 除く国債 超長期(11-)	252.543	3.93	107.70	107.95	0.71	0.58	12.78	12.74	12.66	21
NOMURA-BPI/Extended MBS 全体	127.267	0.74	102.60	102.60	0.87	0.38	5.75	5.74	5.52	26
NOMURA-BPI/Extended 除く国債 長期(7-)	244.780	2.69	106.15	106.38	0.53	0.46	10.94	10.91	10.87	22
NOMURA-BPI/Extended 除く国債 超長期(11-)	254.597	3.93	107.69	107.94	0.71	0.58	12.78	12.74	12.66	21

2018/9/11 時点 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)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
NOMURA-BPI 総合 長期(7-)	577.377	3.96	112.12	112.57	0.39	0.40	14.08	14.04	14.02	3
NOMURA-BPI MBS 全体	127.268	0.77	102.60	102.60	0.87	0.37	5.75	5.74	5.52	25
NOMURA-BPI 除く国債 全体	173.843	1.23	103.75	103.95	0.29	0.26	6.72	6.71	6.69	20
NOMURA-BPI 除く国債 超長期(11-)	252.544	3.94	107.70	107.95	0.71	0.58	12.78	12.74	12.66	21
NOMURA-BPI/Extended MBS 全体	127.268	0.77	102.60	102.60	0.87	0.37	5.75	5.74	5.52	25
NOMURA-BPI/Extended 除く国債 長期(7-)	244.781	2.69	106.15	106.38	0.53	0.46	10.94	10.91	10.87	22
NOMURA-BPI/Extended 除く国債 超長期(11-)	254.597	3.94	107.69	107.94	0.71	0.58	12.78	12.74	12.66	21

■2018/9/12

2018/9/12 時点 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)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
NOMURA-BPI MBS 全体	127.278	0.94	102.61	102.61	0.87	0.38	5.74	5.73	5.52	26
NOMURA-BPI 除く国債 全体	173.846	1.18	103.75	103.95	0.29	0.26	6.72	6.71	6.69	20
NOMURA-BPI 除く国債 超長期(11-)	252.563	3.84	107.70	107.96	0.71	0.58	12.78	12.73	12.66	21
NOMURA-BPI/Extended 総合 全体	380.375	1.88	107.39	107.73	0.18	0.19	9.05	9.03	9.02	4
NOMURA-BPI/Extended 総合 長期(7-)	578.132	3.89	112.12	112.58	0.39	0.40	14.08	14.04	14.02	3
NOMURA-BPI/Extended MBS 全体	127.278	0.94	102.61	102.61	0.87	0.38	5.74	5.73	5.52	26
NOMURA-BPI/Extended 除く国債 全体	174.230	1.18	103.72	103.92	0.29	0.26	6.70	6.69	6.67	21
NOMURA-BPI/Extended 除く国債 長期(7-)	244.790	2.59	106.15	106.38	0.53	0.46	10.93	10.90	10.86	22
NOMURA-BPI/Extended 除く国債 超長期(11-)	254.617	3.84	107.70	107.95	0.71	0.58	12.78	12.74	12.66	21

2018/9/12 時点 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)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
NOMURA-BPI MBS 全体	127.279	0.96	102.61	102.61	0.87	0.37	5.74	5.73	5.52	25
NOMURA-BPI 除く国債 全体	173.846	1.19	103.75	103.95	0.29	0.26	6.72	6.71	6.69	20
NOMURA-BPI 除く国債 超長期(11-)	252.564	3.85	107.70	107.96	0.71	0.58	12.78	12.73	12.66	21
NOMURA-BPI/Extended 総合 全体	380.375	1.89	107.39	107.73	0.18	0.19	9.05	9.03	9.02	4
NOMURA-BPI/Extended 総合 長期(7-)	578.133	3.89	112.12	112.58	0.39	0.40	14.08	14.04	14.02	3
NOMURA-BPI/Extended MBS 全体	127.279	0.96	102.61	102.61	0.87	0.37	5.74	5.73	5.52	25
NOMURA-BPI/Extended 除く国債 全体	174.230	1.19	103.72	103.92	0.29	0.26	6.70	6.69	6.67	21
NOMURA-BPI/Extended 除く国債 長期(7-)	244.791	2.59	106.15	106.38	0.53	0.46	10.93	10.90	10.86	22
NOMURA-BPI/Extended 除く国債 超長期(11-)	254.617	3.85	107.70	107.95	0.71	0.58	12.78	12.74	12.66	21

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 をよろしく願いいたします。