

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-BPI MBS セクター 金利モデルについて

現在、NOMURA-BPI MBS セクターにおきまして、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”コーナーに掲載しておりますリスク指標値算出に用いる金利モデルを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-BPI をよろしく願いたします。