

NOMURA-BPI/Ladderの訂正箇所詳細(累積投資収益指数・投資収益率)

ラダー年限	残存種別	日付	累積投資 収益指数	各時点からの投資収益率(%)					
				前日	前月末			前年度末	前年末
				TOTAL	TOTAL	CAPITAL	INCOME	TOTAL	TOTAL
5	中期(3-7)	2006/04/03	98.567	-25.92	-25.92	-26.67	0.75	-25.92	-6.14
5	中期(3-7)	2006/04/04	98.725	58.64	-4.81	-5.56	0.75	-4.81	-5.47
5	中期(3-7)	2006/04/05	98.830	38.91	3.93	3.18	0.75	3.93	-5.02
5	中期(3-7)	2006/04/06	98.662	-62.18	-7.09	-7.84	0.75	-7.09	-5.60
5	中期(3-7)	2006/04/07	98.538	-45.99	-12.64	-13.39	0.75	-12.64	-6.00
5	中期(3-7)	2006/04/10	98.579	5.14	-7.31	-8.06	0.75	-7.31	-5.67
5	中期(3-7)	2006/04/11	98.625	17.10	-5.10	-5.84	0.75	-5.10	-5.45
5	中期(3-7)	2006/04/12	98.660	12.95	-3.59	-4.34	0.75	-3.59	-5.28
5	中期(3-7)	2006/04/13	98.604	-20.66	-4.90	-5.65	0.75	-4.90	-5.42
5	中期(3-7)	2006/04/14	98.553	-19.16	-5.92	-6.67	0.75	-5.92	-5.55
5	中期(3-7)	2006/04/17	98.657	12.91	-2.60	-3.35	0.75	-2.60	-5.04
5	中期(3-7)	2006/04/18	98.623	-12.59	-3.16	-3.91	0.75	-3.16	-5.11
5	中期(3-7)	2006/04/19	98.782	58.85	0.10	-0.65	0.75	0.10	-4.54
5	中期(3-7)	2006/04/20	98.759	-8.63	-0.34	-1.08	0.75	-0.34	-4.57
5	中期(3-7)	2006/04/21	98.791	12.05	0.25	-0.50	0.75	0.25	-4.42
5	中期(3-7)	2006/04/24	98.864	8.91	1.34	0.59	0.75	1.34	-4.08
5	中期(3-7)	2006/04/25	98.871	2.59	1.39	0.64	0.75	1.39	-4.02
5	中期(3-7)	2006/04/26	98.697	-63.99	-1.13	-1.88	0.75	-1.13	-4.53
5	中期(3-7)	2006/04/27	98.571	-46.89	-2.82	-3.57	0.75	-2.82	-4.88
5	中期(3-7)	2006/04/28	98.750	66.34	-0.36	-1.11	0.75	-0.36	-4.29
10	長期(7-)	2006/04/03	262.959	-66.06	-66.06	-67.50	1.43	-66.06	-10.54
10	長期(7-)	2006/04/04	263.221	36.43	-40.49	-41.92	1.43	-40.49	-10.05
10	長期(7-)	2006/04/05	263.332	15.35	-29.34	-30.77	1.43	-29.34	-9.79
10	長期(7-)	2006/04/06	262.533	-110.64	-42.81	-44.24	1.43	-42.81	-10.80
10	長期(7-)	2006/04/07	262.282	-34.96	-41.65	-43.08	1.43	-41.65	-11.04
10	長期(7-)	2006/04/10	262.344	2.89	-28.30	-29.73	1.43	-28.30	-10.63
10	長期(7-)	2006/04/11	262.288	-7.84	-26.43	-27.86	1.43	-26.43	-10.60
10	長期(7-)	2006/04/12	262.276	-1.64	-24.37	-25.80	1.43	-24.37	-10.51
10	長期(7-)	2006/04/13	261.511	-106.44	-30.61	-32.04	1.43	-30.61	-11.40
10	長期(7-)	2006/04/14	260.791	-100.57	-35.53	-36.96	1.43	-35.53	-12.22
10	長期(7-)	2006/04/17	260.949	7.39	-27.98	-29.41	1.43	-27.98	-11.68
10	長期(7-)	2006/04/18	260.778	-23.92	-27.73	-29.16	1.43	-27.73	-11.79
10	長期(7-)	2006/04/19	262.126	188.67	-16.48	-17.91	1.43	-16.48	-10.03
10	長期(7-)	2006/04/20	261.768	-49.84	-18.13	-19.56	1.43	-18.13	-10.37
10	長期(7-)	2006/04/21	261.884	16.20	-16.50	-17.93	1.43	-16.50	-10.14
10	長期(7-)	2006/04/24	262.345	21.39	-11.79	-13.22	1.43	-11.79	-9.33
10	長期(7-)	2006/04/25	262.028	-44.14	-13.07	-14.50	1.43	-13.07	-9.62
10	長期(7-)	2006/04/26	261.407	-86.43	-15.86	-17.29	1.43	-15.86	-10.26
10	長期(7-)	2006/04/27	260.709	-97.41	-18.84	-20.27	1.43	-18.84	-10.97
10	長期(7-)	2006/04/28	261.785	150.56	-12.87	-14.30	1.43	-12.87	-9.66
20	全体	2006/05/26	130.976	10.66	5.73	2.30	3.43	-4.99	-5.52
20	全体	2006/05/29	130.871	-9.75	4.23	0.80	3.43	-5.23	-5.60
20	全体	2006/05/30	131.080	58.28	5.92	2.50	3.43	-4.18	-5.19
20	全体	2006/05/31	131.278	55.31	7.43	4.00	3.43	-3.21	-4.79

NOMURA-BPI/Ladderの訂正箇所詳細(ポートフォリオ指標・青字は変更なし)

ラダー年限	残存種別	日付	額面 (10億円)	単価 (円)	利含単価 (円)	残存 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
5	中期(3-7)	2006/04/03	80	98.14	98.25	4.09	0.74	1.21	1.20	4.03	4.00	4.03	2
5	中期(3-7)	2006/04/04	80	98.29	98.41	4.09	0.74	1.17	1.16	4.02	4.00	4.02	2
5	中期(3-7)	2006/04/05	80	98.39	98.51	4.08	0.74	1.14	1.13	4.02	4.00	4.02	2
5	中期(3-7)	2006/04/06	80	98.22	98.34	4.08	0.74	1.19	1.18	4.02	3.99	4.02	2
5	中期(3-7)	2006/04/07	80	98.10	98.22	4.08	0.74	1.22	1.21	4.01	3.99	4.01	2
5	中期(3-7)	2006/04/10	80	98.13	98.26	4.07	0.74	1.21	1.20	4.01	3.98	4.01	2
5	中期(3-7)	2006/04/11	80	98.18	98.31	4.07	0.74	1.20	1.19	4.00	3.98	4.00	1
5	中期(3-7)	2006/04/12	80	98.21	98.34	4.06	0.74	1.19	1.18	4.00	3.98	4.00	1
5	中期(3-7)	2006/04/13	80	98.15	98.29	4.06	0.74	1.20	1.19	4.00	3.97	4.00	1
5	中期(3-7)	2006/04/14	80	98.10	98.23	4.06	0.74	1.22	1.21	4.00	3.97	3.99	1
5	中期(3-7)	2006/04/17	80	98.20	98.34	4.05	0.74	1.19	1.18	3.99	3.96	3.99	1
5	中期(3-7)	2006/04/18	80	98.16	98.30	4.05	0.74	1.20	1.19	3.98	3.96	3.98	1
5	中期(3-7)	2006/04/19	80	98.32	98.46	4.05	0.74	1.16	1.15	3.98	3.96	3.98	1
5	中期(3-7)	2006/04/20	80	98.29	98.44	4.04	0.74	1.17	1.16	3.98	3.96	3.98	1
5	中期(3-7)	2006/04/21	80	98.32	98.47	4.04	0.74	1.16	1.15	3.98	3.95	3.98	1
5	中期(3-7)	2006/04/24	80	98.39	98.54	4.03	0.74	1.14	1.14	3.97	3.95	3.97	1
5	中期(3-7)	2006/04/25	80	98.39	98.55	4.03	0.74	1.14	1.14	3.97	3.94	3.96	1
5	中期(3-7)	2006/04/26	80	98.22	98.38	4.03	0.74	1.19	1.18	3.96	3.94	3.96	1
5	中期(3-7)	2006/04/27	80	98.09	98.25	4.02	0.74	1.22	1.21	3.96	3.94	3.96	1
5	中期(3-7)	2006/04/28	80	98.27	98.43	4.02	0.74	1.18	1.17	3.96	3.93	3.96	2
10	長期(7-)	2006/04/03	120	97.16	97.37	8.59	1.40	1.79	1.77	8.09	8.02	8.08	0
10	長期(7-)	2006/04/04	120	97.25	97.47	8.59	1.40	1.78	1.75	8.08	8.01	8.07	0
10	長期(7-)	2006/04/05	120	97.29	97.51	8.58	1.40	1.77	1.75	8.08	8.01	8.07	0
10	長期(7-)	2006/04/06	120	96.99	97.21	8.58	1.40	1.81	1.79	8.08	8.01	8.07	0
10	長期(7-)	2006/04/07	120	96.89	97.12	8.58	1.40	1.83	1.80	8.07	8.00	8.07	0
10	長期(7-)	2006/04/10	120	96.90	97.14	8.57	1.40	1.83	1.80	8.07	7.99	8.06	0
10	長期(7-)	2006/04/11	120	96.88	97.12	8.57	1.40	1.83	1.80	8.06	7.99	8.05	0
10	長期(7-)	2006/04/12	120	96.87	97.12	8.56	1.40	1.83	1.80	8.06	7.99	8.05	0
10	長期(7-)	2006/04/13	120	96.58	96.83	8.56	1.40	1.87	1.84	8.06	7.98	8.05	0
10	長期(7-)	2006/04/14	120	96.31	96.57	8.56	1.40	1.91	1.88	8.05	7.98	8.04	0
10	長期(7-)	2006/04/17	120	96.36	96.63	8.55	1.40	1.90	1.87	8.04	7.97	8.03	0
10	長期(7-)	2006/04/18	120	96.29	96.56	8.55	1.40	1.91	1.88	8.04	7.97	8.03	0
10	長期(7-)	2006/04/19	120	96.79	97.06	8.55	1.40	1.84	1.81	8.04	7.97	8.03	0
10	長期(7-)	2006/04/20	120	96.65	96.93	8.54	1.40	1.86	1.83	8.04	7.96	8.03	0
10	長期(7-)	2006/04/21	120	96.69	96.97	8.54	1.40	1.86	1.83	8.03	7.96	8.02	0
10	長期(7-)	2006/04/24	120	96.85	97.14	8.53	1.40	1.83	1.81	8.03	7.95	8.02	0
10	長期(7-)	2006/04/25	120	96.73	97.02	8.53	1.40	1.85	1.82	8.02	7.95	8.01	0
10	長期(7-)	2006/04/26	120	96.49	96.80	8.53	1.40	1.88	1.85	8.02	7.95	8.01	0
10	長期(7-)	2006/04/27	120	96.23	96.54	8.52	1.40	1.92	1.89	8.02	7.94	8.01	0
10	長期(7-)	2006/04/28	120	96.63	96.94	8.52	1.40	1.87	1.84	8.01	7.94	8.00	1
20	全体	2006/05/26	200	110.44	111.13	9.82	3.79	1.56	1.62	8.15	8.07	8.12	1
20	全体	2006/05/29	200	110.32	111.04	9.81	3.79	1.57	1.63	8.13	8.06	8.10	1
20	全体	2006/05/30	200	110.48	111.22	9.81	3.79	1.55	1.61	8.14	8.06	8.11	1
20	全体	2006/05/31	200	110.64	111.39	9.81	3.79	1.53	1.59	8.14	8.06	8.11	1