

お知らせ

野村証券 金融工学研究センター
クオンツ・リサーチ部
インデックス業務室
2016年2月9日

NOMURA 変動利付国債インデックスにおける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、リスク指標（T スプレッドや実効デュレーション等）を公表しておりますが、新たな金利モデルに基づくリスク指標の算出をも検討しております。

詳細については、後日、当社お客様向けウェブサイト”NomuraNow”にて掲載する予定です。

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。