

お詫び

野村証券 金融工学研究センター
 インデックス業務室
 2020年9月3日

2020年7月22日におけるNOMURA-BPIポートフォリオ指標の訂正について

2020年7月22日における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。翌7月23日に[証券市場インデックスWEB](#)「日次 投資収益指数 およびポートフォリオ指標」に掲載した値と比較した結果は、下記の通りとなりました。

なお、2020年7月22日における累積投資収益指数・投資収益率に変更はございません。

NOMURA-BPI

指数	指標名	正	誤	差
総合 長期 (7-)	M-Dur	14.34	14.33	-0.01
総合 超長期 (11-)	Dur	17.30	17.29	-0.01
MBS	残存	5.92	5.88	-0.04
MBS	複利	0.24	0.23	-0.01
MBS	Dur	5.79	5.75	-0.04
MBS	M-Dur	5.78	5.75	-0.03
MBS	E-Dur	5.54	5.50	-0.04
MBS	Tspd	21	20	-1
除く ABS	M-Dur	9.37	9.36	-0.01
除く ABS 超長期 (11-)	Dur	17.30	17.29	-0.01
除く 国債 長期 (7-)	残存	12.09	12.08	-0.01
除く 国債 長期 (7-)	Dur	11.33	11.32	-0.01
除く 国債 長期 (7-)	E-Dur	11.26	11.25	-0.01
除く 国債 超長期 (11-)	残存	14.45	14.44	-0.01
除く 国債 超長期 (11-)	Dur	13.30	13.29	-0.01
除く 国債 超長期 (11-)	M-Dur	13.27	13.26	-0.01
除く 国債 超長期 (11-)	E-Dur	13.19	13.18	-0.01

NOMURA-BPI/Extended

指数	指標名	正	誤	差
総合	E-Dur	9.35	9.34	-0.01
総合 長期 (7-)	残存	15.75	15.74	-0.01
総合 長期 (7-)	E-Dur	14.32	14.31	-0.01
総合 超長期 (11-)	Dur	17.30	17.29	-0.01
MBS	残存	5.92	5.88	-0.04
MBS	複利	0.24	0.23	-0.01
MBS	Dur	5.79	5.75	-0.04
MBS	M-Dur	5.78	5.75	-0.03
MBS	E-Dur	5.54	5.50	-0.04
MBS	Tspd	21	20	-1
除く ABS 長期 (7-)	M-Dur	14.34	14.33	-0.01
除く ABS 超長期 (11-)	Dur	17.30	17.29	-0.01
除く 国債 長期 (7-)	残存	12.09	12.08	-0.01
除く 国債 長期 (7-)	M-Dur	11.30	11.29	-0.01
除く 国債 長期 (7-)	E-Dur	11.26	11.25	-0.01
除く 国債 超長期 (11-)	残存	14.45	14.44	-0.01
除く 国債 超長期 (11-)	Dur	13.31	13.29	-0.02
除く 国債 超長期 (11-)	M-Dur	13.27	13.26	-0.01
除く 国債 超長期 (11-)	E-Dur	13.19	13.18	-0.01

野村総合研究所のサービスを通じて当該データをご利用の場合は、野村総合研究所からの案内をご確認いただき、もしくは下記担当窓口までご相談ください。

【野村総合研究所 担当窓口】

野村総合研究所 投資情報サービス事業部

ids-help@nri.co.jp

045-613-7220

この度は、NOMURA-BPI ご利用の皆様ならびに関係各位にご迷惑をおかけいたしますこと、深くお詫
び申し上げます。

【お問合せ先】

野村証券 金融工学研究センター

インデックス業務室

bpi@jp.nomura.com