

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
 2018年2月20日

NOMURA-BPI の翌月ポートフォリオ確定日および組入基準のルール変更について

翌月ポートフォリオ確定日および組入基準を次のように変更いたします。

なお、このルールは2018年5月ポートフォリオ確定日(2018年4月24日)より適用されます。

<対象インデックス>

- NOMURA-BPI
- NOMURA-BPI/Extended
- NOMURA-BPI/Ladder

<ルール変更内容>

ルールブック 該当項番	現行ルール	新ルール
3.2 ポートフォリオ確定日	<p>原則として以下の2つのうち、どちらか早い日付を翌月ポートフォリオの確定日とする。</p> <ul style="list-style-type: none"> ● 毎月25日の翌営業日 ● 月末最終営業日の3営業日前 <p>ただし、ポートフォリオ確定日からその月の末日までに国債発行が見込まれる場合は、事前にアナウンスの上、ポートフォリオ確定日とその入札日に変更することがある。</p>	<p>原則として以下の2つのうち、どちらか早い日付を翌月ポートフォリオの確定日とする。</p> <ul style="list-style-type: none"> ● 毎月25日の翌営業日 ● 毎月月末4営業日前 <p>ただし、ポートフォリオ確定日からその月の末日までに影響の大きい国債発行が見込まれる場合は、事前にアナウンスの上、ポートフォリオ確定日を変更することがある。</p>
4.1 翌月ポートフォリオ組入基準 4.1.7 発行日	<p>国債： ポートフォリオ確定日の属する月の末日までに発行される銘柄</p>	<p>国債： ポートフォリオ確定日までに発行された銘柄</p>

詳細につきましては各インデックスのウェブサイト<<http://qr.nomura.co.jp/jp/index.html>>の「インデックス構成ルールブック」もしくは「債券インデックスハンドブック」をご参照ください。

今後とも NOMURA-BPI をよろしくお願いたします。

【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

03-6703-3986