

用語集 (債券)

2019年3月13日

債券インデックス 用語集

用語	定義
基準日 Base date	指数計算の際に基準となる日。
基準値 Base index value	基準日における累積投資収益指数。
元本累積投資収益指数 Capital investment return index/Capital Index	投下元本に対してのキャピタル・ゲインを合算した収益を指数化した値。
みなし格付 Deemed rating	個別銘柄格付が付与されていない銘柄に対して、一定の条件（同一発行体、同一財務上特約、同一格付会社等）を満たす際に付与されたとみなす個別銘柄格付。
財投機関債 FILP agency bonds	設立根拠法があり、かつ非上場である法人が発行する債券。
最高格付 Highest rating	格付会社 4 社(格付投資情報センター、日本格付研究所、Moody's、S&P)から付与された格付のうち、最も高い格付。
インデックス・ポートフォリオ Index portfolio	指数のルールに従い構成されたポートフォリオ。
JS プライス JS Price	日本経済新聞、野村総合研究所、金融工学研究所、野村証券の 4 社が時価会計における債券評価時価のための価格として共同開発し、日々運営している評価時価。詳細は"Index Calculation Policy"や『インデックス構成ルールブック』を参照。
最低格付 Lowest rating	格付会社 4 社(格付投資情報センター、日本格付研究所、Moody's、S&P)から付与された格付のうち、最も低い格付。
野村証券評価・算定時価 Nomura Price	野村証券グローバル・マーケット部門が算定している評価時価。詳細は"Index Calculation Policy"や『インデックス構成ルールブック』を参照。
ポートフォリオ確定日 Portfolio determination date	ポートフォリオ構成銘柄を確定する日。
公表開始日 Publication start date	指数の公表を開始した日。
定期入替	ルールに従い、定期的にポートフォリオ構成銘柄を入れ替

Scheduled reconstitution	えること。
定期入替基準日 Scheduled reconstitution base date	定期入替の基準となる日のこと。原則として、基準日まで に取得できる情報を用いて翌月ポートフォリオを確定す る。
定期入替日 Scheduled reconstitution date	ルールに則り、定期入替を実施する日。
セクター別インデックス Sub-index by sectors	セクター分類に応じて分類されたサブインデックス。例え ば、NOMURA-BPI であれば、国債・地方債といったサブイ ンデックスがある。
業種別インデックス Sub-index portfolio by industry	東証 33 業種分類に「財投機関債その他」を加えた 34 業種 に分類したサブインデックス。
格付別インデックス Sub-index portfolio by rating	格付け会社より提供される個別銘柄格付をもとに算出され たみなし格付によって分類したサブインデックス。
残存年数別インデックス Sub-index portfolio by term to maturity	残存年数に応じ、分類したサブインデックス。
累積投資収益指数 Total investment return index/Total Index	投下元本に対してのキャピタル・ゲインとインカム・ゲイ ンを合算した収益を指数化した値。
臨時入替 Unscheduled reconstitution	ポートフォリオ確定日から月末営業日までにおける債務不 履行や全額繰上償還、またその他重大な事項が発生した際 に行う臨時の入替を指す。