

# 用語集(債券)

2024年11月29日

# 債券インデックス 用語集

用語	定義
インデックス・ポートフォリオ	指数のルールに従い構成されたポートフォリオ。
格付別インデックス	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。
元本累積投資収益指数 (キャピタル指数)	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。
基準値	基準日における累積投資収益指数。
基準日	指数計算の際に基準となる日。
業種別インデックス	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。
公表開始日	指数の公表を開始した日。
最高格付	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。
最低格付	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。
財投機関債	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。
残存年数別インデックス	残存年数に応じ、分類したサブインデックス。
JS プライス	日本経済新聞社、日経金融工学研究所、野村総合研究所、野村證券の 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。
セクター別インデックス	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。
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えること。
定期入替基準日	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	ルールに則り、定期入替を実施する日。
野村証券評価・算定時価	野村証券が算定している評価時価。詳細は" <b>Index Calculation Policy</b> "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	ポートフォリオ構成銘柄を確定する日。
みなし格付	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。
臨時入替	ポートフォリオ確定日から月末営業日までに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。
累積投資収益指数	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。