

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
債券インデックスグループ
2016年8月30日

NOMURA-BPI MBS セクター リスク指標値について

現在、NOMURA-BPI MBS セクターでは、T スプレッドや実効デュレーション等一部のリスク指標に関して、金利モデルを用いて算出しております。2016年9月26日付データより、本金利モデルのパラメータ推定方法を一部変更致します。なお、金利モデルの変更はございません。

詳細は、当社営業までお問い合わせ下さい。

本件に伴う、累積投資収益指数・投資収益率への影響はございません。

NOMURA-BPI では、今後も、市場環境を注視し、債券運用の一助となるリスク指標を提供できるよう常に検討して参ります。

今後とも NOMURA-BPI をよろしく願いたします。