



月間投資収益率 (2024年6月末)

累積投資 収益指数	前月末からの投資収益率			過去からの期間投資収益率	
	トータル	キャピタル	インカム	前年度末	前年末
総合 357.511	3.58	2.76	0.82	-9.83	-5.92

出所: 野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング(NFRC)

(注) 投資収益率は年率換算(%)

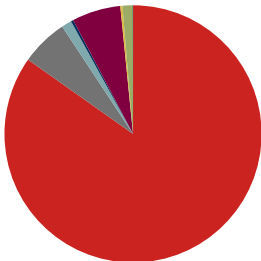
ポートフォリオ指標 (2024年6月末)

	翌月ポート	当月ポート	差
	(2024年7月)	(2024年6月)	
額面 [兆円]	1137.20	1130.16	7.04
デュレーション [年]	8.75	8.73	0.03
修正デュレーション	8.69	8.67	0.03
時価単価 [円]	95.70	95.70	0.00
利含単価 [円]	95.84	95.84	0.00
残存年数 [年]	10.27	10.25	0.03
利率 [%]	0.79	0.79	0.00
単利 [%]	1.01	1.00	0.00
複利 [%]	0.97	0.97	0.00
Tスプレッド [bp]	4	4	0

出所: NFRC

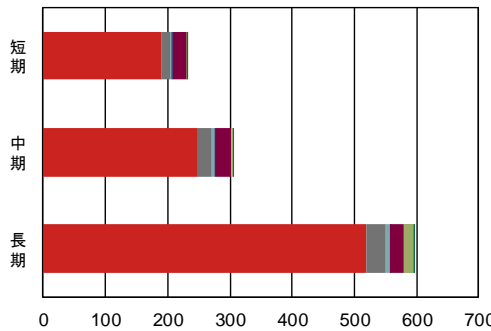
(注) デュレーション・修正デュレーションは経過利子込時価総額加重平均、単利・複利・Tスプレッドは時価総額加重平均、それ以外は額面加重平均。

銘柄別額面構成 (2024年6月末)



出所: NFRC

残存別額面構成 (2024年6月末)



出所: NFRC

(兆円)

	国債	地方債	政保債	金融債	事業債	円建外債	MBS	ABS
構成比	84.8%	5.9%	1.3%	0.3%	6.1%	0.3%	1.3%	0.1%
全体	958.32	66.87	14.39	3.44	69.22	3.09	14.14	0.70
短期	190.68	12.84	3.42	2.02	20.78	1.55	-	0.21
中期	247.50	24.29	4.55	1.24	24.93	1.26	-	0.30
長期	520.14	29.75	6.42	0.18	23.50	0.28	14.14	0.19

出所: NFRC

(兆円)

目次

銘柄別・投資収益率 投資収益指数	2
総合 残存別・投資収益率 投資収益指数	3
国債 残存別・投資収益率 投資収益指数	4
「除く MBS」残存別・投資収益率 投資収益指数	6
「除く ABS」「SDGs」残存別・投資収益率 投資収益指数	7
「除く国債」残存別・投資収益率 投資収益指数	8
銘柄 残存別・月間投資収益率	9
「除く（銘柄）」残存別・月間投資収益率	9
事業債 業種別・月間投資収益率	10
事業債 円建外債 格付別・月間投資収益率	10
事業債 円建外債 格付会社別・月間投資収益率	11
銘柄 残存別・ポートフォリオ指標	15
「除く」銘柄 残存別・ポートフォリオ指標	16
特定銘柄 残存別・ポートフォリオ指標	19
事業債 業種別・ポートフォリオ指標	21
事業債 円建外債 格付別・ポートフォリオ指標	29
事業債 格付会社別・ポートフォリオ指標	31
円建外債 格付会社別・ポートフォリオ指標	43
NOMURA-BPI 総合・ポートフォリオ指標の推移	55
NOMURA-BPI の定義	56
レポートの表記等について	57
NOMURA-BPI のデータ提供について	58
ディスクレイマー	59

銘柄別・投資収益率 (2024年6月末)

	累積投資 収益指数	前月末からの投資収益率			過去からの投資収益率	
		トータル	キャピタル	インカム	前年度末	前年末
総合	357.511	3.58	2.76	0.82	-9.83	-5.92
国債	367.658	3.54	2.69	0.85	-10.47	-6.35
地方債	385.446	4.17	3.56	0.62	-6.30	-3.70
政保債	359.874	3.60	2.88	0.73	-8.62	-4.86
金融債	272.337	3.12	2.87	0.25	-1.59	-1.28
事業債	384.383	3.88	3.14	0.74	-5.93	-3.05
円建外債	355.328	3.55	2.51	1.04	0.06	0.71
MBS	122.865	2.51	1.86	0.65	-7.91	-4.75
ABS	112.641	3.99	3.25	0.73	-4.13	-2.59

出所:NFRC

投資収益率は年率換算 (%)

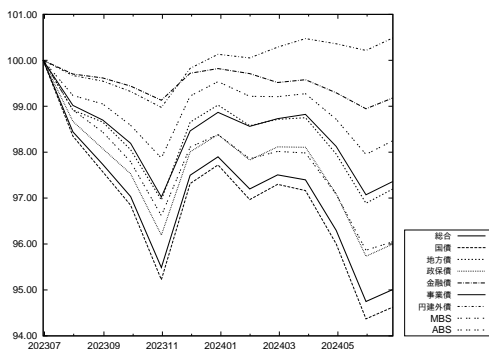
銘柄別・累積投資収益指数の推移

年/月/日	総合	国債	地方債	政保債	金融債	事業債	円建外債	MBS	ABS
2023/06/30	376.290	388.532	396.555	374.873	274.584	394.798	353.603	127.918	114.648
2023/07/31	370.426	382.115	392.260	369.886	273.762	390.921	352.432	126.534	113.771
2023/08/31	367.761	379.098	391.224	367.657	273.527	389.661	352.004	125.918	113.558
2023/09/29	365.131	376.276	388.838	365.613	273.040	387.667	351.204	125.093	113.026
2023/10/31	359.310	369.972	384.497	360.606	272.197	383.050	349.978	123.591	112.207
2023/11/30	366.877	378.104	391.217	367.399	273.808	388.732	352.982	125.500	113.756
2023/12/29	368.384	379.681	392.689	368.807	274.089	390.324	354.068	125.847	114.116
2024/01/31	365.748	376.748	390.907	366.730	273.788	389.119	353.786	125.176	113.750
2024/02/29	366.902	378.041	391.457	367.807	273.255	389.783	354.618	125.381	113.740
2024/03/29	366.497	377.512	391.595	367.776	273.423	390.152	355.274	125.336	113.814
2024/04/30	362.353	373.000	388.461	363.973	272.639	387.392	354.877	124.185	113.176
2024/05/31	356.531	366.662	384.217	358.882	271.686	383.242	354.364	122.629	112.297
2024/06/03	356.654	366.780	384.455	359.014	271.749	383.389	354.458	122.700	112.362
2024/06/04	357.354	367.524	385.170	359.636	271.954	383.962	354.930	122.827	112.517
2024/06/05	358.326	368.566	385.981	360.504	272.228	384.758	355.116	123.091	112.706
2024/06/06	359.959	370.348	387.128	361.920	272.453	385.895	355.700	123.532	112.930
2024/06/07	359.530	369.892	386.709	361.554	272.329	385.554	355.519	123.397	112.837
2024/06/10	357.720	367.935	385.277	359.946	271.970	384.205	354.942	122.921	112.539
2024/06/11	357.956	368.187	385.480	360.162	272.039	384.392	355.121	122.989	112.586
2024/06/12	358.870	369.165	386.304	360.982	272.305	385.133	355.412	123.231	112.772
2024/06/13	359.495	369.840	386.789	361.531	272.421	385.594	355.636	123.406	112.868
2024/06/14	360.419	370.822	387.684	362.365	272.691	386.361	355.903	123.680	113.074
2024/06/17	360.177	370.530	387.744	362.174	272.803	386.297	356.254	123.678	113.118
2024/06/18	359.701	370.003	387.445	361.766	272.803	386.006	356.103	123.567	113.073
2024/06/19	360.173	370.528	387.705	362.184	272.835	386.304	356.221	123.658	113.120
2024/06/20	359.894	370.236	387.375	361.918	272.775	386.083	356.150	123.545	113.048
2024/06/21	359.262	369.547	386.896	361.385	272.642	385.664	355.947	123.373	112.944
2024/06/24	358.855	369.096	386.648	361.033	272.649	385.434	355.814	123.264	112.912
2024/06/25	358.574	368.791	386.456	360.800	272.635	385.215	355.811	123.173	112.874
2024/06/26	357.861	368.012	385.923	360.174	272.562	384.758	355.646	122.991	112.770
2024/06/27	356.659	366.735	384.788	359.095	272.207	383.765	355.121	122.630	112.510
2024/06/28	357.511	367.658	385.446	359.874	272.337	384.383	355.328	122.865	112.641

出所:NFRC

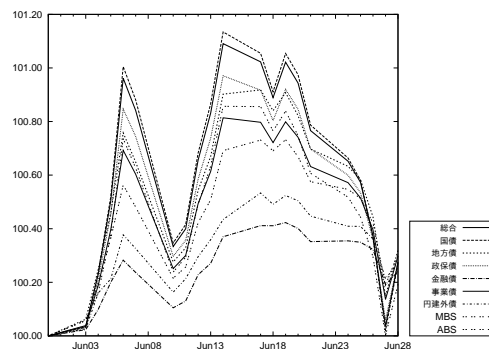
1983年12月末=100。MBSセクターは2003年3月末=100。ABSセクターは2008年3月末=100。

指数の推移 (月次) 2023年6月末=100に補正。



出所:NFRC

指数の推移 (日次) 2024年5月末=100に補正。



出所:NFRC

総合 残存別・投資収益率 (2024年6月末)

	累積投資 収益指数	前月末からの投資収益率			過去からの投資収益率	
		トータル	キャピタル	インカム	前年度末	前年末
総合	357.511	3.58	2.76	0.82	-9.83	-5.92
短期 (1-3)	233.539	2.19	1.81	0.38	-0.68	-0.72
中期 (3-7)	334.586	4.10	3.46	0.64	-3.33	-2.51
長期 (7-)	519.995	3.89	2.78	1.11	-17.04	-9.84
長期 (7-11)	190.497	4.46	3.49	0.97	-8.19	-4.79
超長期 (11-)	228.799	3.54	2.34	1.20	-22.25	-12.79
(11-15)	218.958	3.25	2.22	1.04	-14.79	-7.99
(15-)	234.303	3.64	2.39	1.26	-24.92	-14.50

出所:NFRC

投資収益率は年率換算 (%)

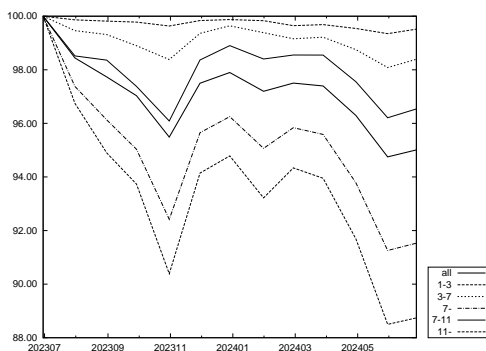
総合 残存別・投資収益指数の推移

総合 年/月/日	全体	短期 (1-3)	中期 (3-7)	長期 (7-)	長期*			
					(7-11)	超長期*	(11-15)*	(15-)*
2023/06/30	376.290	234.673	340.048	568.125	197.327	257.834	233.855	269.251
2023/07/31	370.426	234.353	338.216	553.224	194.403	249.447	228.461	259.576
2023/08/31	367.761	234.242	337.716	546.155	194.094	244.681	226.958	253.445
2023/09/29	365.131	234.156	336.305	539.912	192.157	241.681	224.358	250.261
2023/10/31	359.310	233.813	334.547	525.066	189.609	233.049	219.298	240.100
2023/11/30	366.877	234.294	337.869	543.408	194.102	242.740	226.749	250.768
2023/12/29	368.384	234.378	338.833	546.833	195.161	244.389	228.039	252.571
2024/01/31	365.748	234.282	337.961	540.108	194.175	240.354	226.074	247.692
2024/02/29	366.902	233.846	337.190	544.488	194.470	243.240	227.529	251.157
2024/03/29	366.497	233.935	337.386	543.065	194.467	242.237	227.344	249.824
2024/04/30	362.353	233.598	335.805	532.811	192.503	236.411	223.575	243.144
2024/05/31	356.531	233.147	333.537	518.449	189.847	228.179	218.413	233.650
2024/06/03	356.654	233.165	333.700	518.646	190.056	228.166	218.692	233.525
2024/06/04	357.354	233.261	334.184	520.155	190.536	228.883	219.321	234.281
2024/06/05	358.326	233.421	334.733	522.328	191.015	230.070	220.179	235.603
2024/06/06	359.959	233.519	335.197	526.541	191.688	232.555	221.576	238.523
2024/06/07	359.530	233.451	334.949	525.585	191.359	232.119	221.166	238.075
2024/06/10	357.720	233.298	334.145	521.208	190.441	229.695	219.542	235.326
2024/06/11	357.956	233.341	334.260	521.748	190.587	229.970	219.795	235.612
2024/06/12	358.870	233.476	334.790	523.797	191.157	231.003	220.596	236.741
2024/06/13	359.495	233.524	335.012	525.360	191.487	231.867	221.082	237.756
2024/06/14	360.419	233.657	335.580	527.407	192.103	232.866	221.848	238.851
2024/06/17	360.177	233.726	335.785	526.466	192.241	232.101	221.596	237.884
2024/06/18	359.701	233.746	335.707	525.141	192.046	231.307	221.187	236.937
2024/06/19	360.173	233.747	335.805	526.418	192.141	232.140	221.631	237.925
2024/06/20	359.894	233.731	335.640	525.771	191.865	231.884	221.146	237.755
2024/06/21	359.262	233.662	335.369	524.249	191.531	231.051	220.502	236.843
2024/06/24	358.855	233.688	335.332	523.082	191.374	230.341	220.018	236.042
2024/06/25	358.574	233.690	335.257	522.336	191.238	229.913	219.771	235.541
2024/06/26	357.861	233.664	335.083	520.455	190.879	228.846	219.073	234.325
2024/06/27	356.659	233.486	334.333	517.811	190.088	227.553	218.027	232.928
2024/06/28	357.511	233.539	334.586	519.995	190.497	228.799	218.958	234.303

出所:NFRC

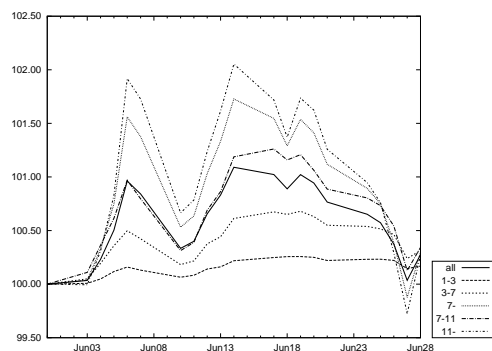
* は 1995年12月末=100。それ以外は、1983年12月末=100。

指数の推移 (月次) 2023年6月末=100に補正。



出所:NFRC

指数の推移 (日次) 2024年5月末=100に補正。



出所:NFRC

国債 残存別・投資収益率 (2024年6月末)

	累積投資 収益指数	前月末からの投資収益率			過去からの投資収益率	
		トータル	キャピタル	インカム	前年度末	前年末
国債	367.658	3.54	2.69	0.85	-10.47	-6.35
短期 (1-3)	220.855	2.12	1.75	0.37	-0.74	-0.78
中期 (3-7)	333.447	4.04	3.39	0.65	-3.43	-2.64
長期 (7-)	529.824	3.84	2.70	1.14	-17.70	-10.32
長期 (7-11)	189.023	4.39	3.41	0.98	-8.33	-4.96
超長期 (11-)	227.526	3.52	2.28	1.23	-23.19	-13.42
(11-15)	217.488	3.10	2.04	1.05	-14.99	-8.20
(15-)	233.177	3.67	2.37	1.30	-26.13	-15.29

出所:NFRC

投資収益率は年率換算 (%)

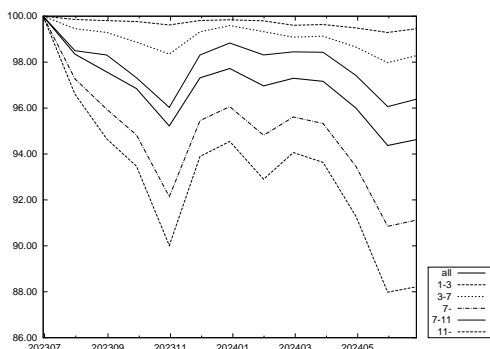
国債 残存別・投資収益指数の推移

国債 年/月/日	全体	短期 (1-3)	中期 (3-7)	長期 (7-)	長期*			
					長期* (7-11)	超長期* (11-)	(11-15)*	(15-)*
2023/06/30	388.532	222.065	339.276	581.457	196.110	257.907	232.618	270.034
2023/07/31	382.115	221.754	337.431	565.612	193.170	249.154	227.207	259.815
2023/08/31	379.098	221.638	336.877	557.899	192.799	244.125	225.661	253.299
2023/09/29	376.276	221.548	335.443	551.388	190.852	241.059	223.053	250.022
2023/10/31	369.972	221.219	333.693	535.772	188.324	232.150	218.060	239.413
2023/11/30	378.104	221.653	336.972	555.024	192.800	242.152	225.500	250.540
2023/12/29	379.681	221.718	337.902	558.559	193.819	243.845	226.756	252.421
2024/01/31	376.748	221.618	336.994	551.309	192.800	239.595	224.741	247.251
2024/02/29	378.041	221.194	336.185	555.938	193.064	242.595	226.168	250.893
2024/03/29	377.512	221.262	336.327	554.290	193.031	241.486	225.933	249.426
2024/04/30	373.000	220.931	334.713	543.451	191.054	235.449	222.150	242.446
2024/05/31	366.662	220.496	332.417	528.266	188.388	226.914	216.973	232.523
2024/06/03	366.780	220.512	332.582	528.439	188.594	226.884	217.251	232.374
2024/06/04	367.524	220.602	333.068	530.010	189.073	227.617	217.869	233.158
2024/06/05	368.566	220.753	333.621	532.293	189.550	228.841	218.727	234.531
2024/06/06	370.348	220.845	334.084	536.753	190.221	231.420	220.124	237.586
2024/06/07	369.892	220.780	333.832	535.763	189.891	230.978	219.712	237.129
2024/06/10	367.935	220.634	333.024	531.153	188.974	228.474	218.091	234.265
2024/06/11	368.187	220.675	333.140	531.717	189.120	228.755	218.345	234.560
2024/06/12	369.165	220.803	333.673	533.858	189.688	229.816	219.144	235.730
2024/06/13	369.840	220.847	333.895	535.503	190.017	230.709	219.628	236.786
2024/06/14	370.822	220.973	334.463	537.628	190.627	231.728	220.388	237.914
2024/06/17	370.530	221.037	334.668	536.588	190.768	230.913	220.128	236.878
2024/06/18	370.003	221.056	334.588	535.179	190.572	230.086	219.720	235.883
2024/06/19	370.528	221.057	334.686	536.549	190.667	230.958	220.169	236.926
2024/06/20	370.236	221.041	334.518	535.896	190.392	230.709	219.683	236.765
2024/06/21	369.547	220.973	334.238	534.285	190.051	229.848	219.027	235.818
2024/06/24	369.096	220.997	334.200	533.046	189.894	229.110	218.541	234.978
2024/06/25	368.791	220.999	334.124	532.262	189.760	228.668	218.297	234.456
2024/06/26	368.012	220.973	333.948	530.275	189.402	227.562	217.599	233.185
2024/06/27	366.735	220.805	333.195	527.527	188.615	226.242	216.557	231.748
2024/06/28	367.658	220.855	333.447	529.824	189.023	227.526	217.488	233.177

出所:NFRC

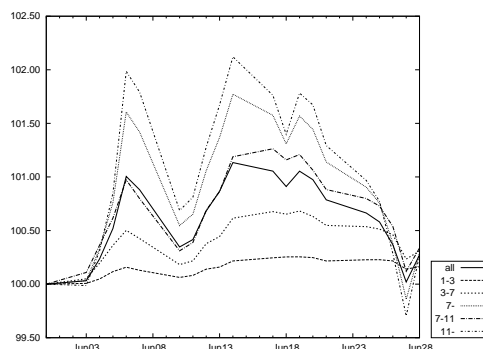
* は 1995年12月末=100。それ以外は、1983年12月末=100。

指数の推移 (月次) 2023年6月末=100に補正。



出所:NFRC

指数の推移 (日次) 2024年5月末=100に補正。



出所:NFRC

このページは空白です。

「除くMBS」残存別・投資収益率(2024年6月末)

	累積投資 収益指数	前月末からの投資収益率			過去からの投資収益率	
		トータル	キャピタル	インカム	前年度末	前年末
除くMBS	357.390	3.60	2.77	0.82	-9.86	-5.93
短期(1-3)	233.539	2.19	1.81	0.38	-0.68	-0.72
中期(3-7)	334.586	4.10	3.46	0.64	-3.33	-2.51
長期(7-)	521.725	3.92	2.80	1.12	-17.26	-9.97
長期(7-11)	190.490	4.46	3.49	0.97	-8.20	-4.80
超長期(11-)	230.386	3.58	2.36	1.22	-22.81	-13.10
(11-15)	218.947	3.25	2.22	1.04	-14.79	-7.99
(15-)	236.104	3.71	2.42	1.29	-25.82	-15.02

出所:NFRC

NOMURA-BPI 総合から MBS を除いたポートフォリオ。投資収益率は年率換算(%)

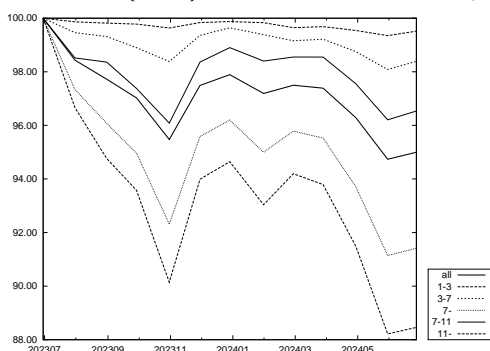
「除くMBS」残存別・投資収益指数の推移

除くMBS 年/月/日	全体	短期 (1-3)	中期 (3-7)	長期 (7-)				
					長期* (7-11)	超長期* (11-)	(11-15)*	(15-)*
2023/06/30	376.216	234.673	340.048	570.712	197.326	260.440	233.847	272.796
2023/07/31	370.329	234.353	338.216	555.520	194.399	251.747	228.449	262.626
2023/08/31	367.653	234.242	337.716	548.310	194.090	246.796	226.946	256.156
2023/09/29	365.021	234.156	336.305	541.973	192.152	243.713	224.345	252.853
2023/10/31	359.183	233.813	334.547	526.856	189.601	234.777	219.285	242.183
2023/11/30	366.774	234.294	337.869	545.524	194.098	244.789	226.737	253.340
2023/12/29	368.287	234.378	338.833	549.012	195.158	246.491	228.028	255.223
2024/01/31	365.643	234.282	337.961	542.163	194.171	242.313	226.063	250.100
2024/02/29	366.803	233.846	337.190	546.648	194.467	245.321	227.518	253.766
2024/03/29	366.395	233.935	337.386	545.189	194.464	244.274	227.333	252.351
2024/04/30	362.243	233.598	335.805	534.764	192.498	238.257	223.564	245.365
2024/05/31	356.406	233.147	333.537	520.160	189.840	229.754	218.402	235.435
2024/06/03	356.528	233.165	333.700	520.354	190.049	229.735	218.682	235.294
2024/06/04	357.232	233.261	334.184	521.893	190.530	230.476	219.310	236.084
2024/06/05	358.206	233.421	334.733	524.101	191.008	231.700	220.168	237.462
2024/06/06	359.843	233.519	335.197	528.386	191.683	234.269	221.565	240.521
2024/06/07	359.414	233.451	334.949	527.418	191.353	233.823	221.155	240.058
2024/06/10	357.599	233.298	334.145	522.967	190.435	231.320	219.531	237.186
2024/06/11	357.835	233.341	334.260	523.514	190.581	231.603	219.784	237.482
2024/06/12	358.752	233.476	334.790	525.596	191.151	232.667	220.585	238.658
2024/06/13	359.378	233.524	335.012	527.185	191.481	233.558	221.071	239.718
2024/06/14	360.304	233.657	335.580	529.262	192.097	234.584	221.837	240.854
2024/06/17	360.059	233.726	335.785	528.294	192.236	233.782	221.585	239.825
2024/06/18	359.581	233.746	335.707	526.943	192.040	232.959	221.176	238.830
2024/06/19	360.056	233.747	335.805	528.247	192.135	233.825	221.620	239.871
2024/06/20	359.778	233.731	335.640	527.594	191.859	233.565	221.135	239.702
2024/06/21	359.143	233.662	335.369	526.045	191.525	232.706	220.492	238.751
2024/06/24	358.736	233.688	335.332	524.858	191.368	231.971	220.008	237.910
2024/06/25	358.454	233.690	335.257	524.099	191.232	231.529	219.760	237.387
2024/06/26	357.739	233.664	335.083	522.184	190.872	230.425	219.062	236.113
2024/06/27	356.536	233.486	334.333	519.503	190.081	229.099	218.016	234.666
2024/06/28	357.390	233.539	334.586	521.725	190.490	230.386	218.947	236.104

出所:NFRC

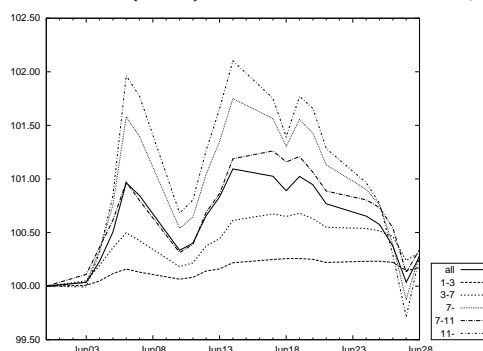
* は 1995年12月末=100。それ以外は、1983年12月末=100。

指数の推移(月次) 2023年6月末=100に補正。



出所:NFRC

指数の推移(日次) 2024年5月末=100に補正。



出所:NFRC

「除く ABS」「SDGs」残存別・投資収益率(2024年6月末)

	累積投資 収益指数	前月末からの投資収益率			過去からの投資収益率	
		トータル	キャピタル	インカム	前年度末	前年末
除く ABS	357.535	3.58	2.76	0.82	-9.84	-5.92
短期 (1-3)	233.504	2.19	1.81	0.38	-0.68	-0.72
中期 (3-7)	334.578	4.10	3.46	0.64	-3.33	-2.51
長期 (7-)	519.993	3.89	2.78	1.11	-17.04	-9.84
長期 (7-11)	190.491	4.46	3.49	0.97	-8.19	-4.79
超長期 (11-)	228.797	3.54	2.34	1.20	-22.25	-12.79
(11-15)	218.950	3.26	2.22	1.04	-14.80	-7.99
(15-)	234.305	3.64	2.39	1.26	-24.92	-14.51
SDGs	98.099	4.21	3.68	0.53	-6.24	-3.53

出所:NFRC

「除く ABS」は NOMURA-BPI 総合から ABS を除いたポートフォリオ。投資収益率は年率換算(%)

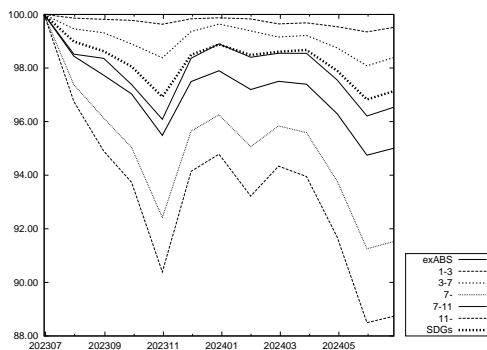
「除く ABS」「SDGs」残存別 投資収益指数の推移

除く ABS 年/月/日	除く ABS	短期 (1-3)	中期 (3-7)	長期 (7-)	長期*				SDGs**
					長期* (7-11)	超長期* (11-)	(11-15)*	(15-)*	
2023/06/30	376.323	234.639	340.042	568.132	197.322	257.833	233.847	269.253	100.988
2023/07/31	370.457	234.319	338.210	553.229	194.397	249.447	228.453	259.578	99.968
2023/08/31	367.790	234.208	337.710	546.157	194.088	244.680	226.950	253.447	99.602
2023/09/29	365.159	234.122	336.298	539.914	192.152	241.680	224.350	250.264	99.026
2023/10/31	359.336	233.779	334.540	525.066	189.603	233.047	219.290	240.102	97.885
2023/11/30	366.905	234.260	337.862	543.410	194.096	242.738	226.740	250.770	99.468
2023/12/29	368.412	234.343	338.826	546.835	195.155	244.387	228.030	252.573	99.855
2024/01/31	365.776	234.247	337.953	540.108	194.169	240.352	226.066	247.694	99.461
2024/02/29	366.930	233.811	337.182	544.489	194.464	243.238	227.521	251.159	99.583
2024/03/29	366.525	233.900	337.379	543.066	194.461	242.236	227.336	249.826	99.650
2024/04/30	362.379	233.563	335.797	532.811	192.497	236.409	223.567	243.146	98.866
2024/05/31	356.555	233.112	333.529	518.448	189.841	228.177	218.404	233.652	97.783
2024/06/03	356.678	233.131	333.693	518.643	190.050	228.164	218.684	233.527	97.825
2024/06/04	357.378	233.226	334.176	520.153	190.530	228.881	219.313	234.283	97.983
2024/06/05	358.350	233.386	334.725	522.327	191.008	230.068	220.171	235.605	98.192
2024/06/06	359.984	233.484	335.190	526.539	191.682	232.553	221.567	238.525	98.479
2024/06/07	359.555	233.416	334.941	525.584	191.353	232.117	221.157	238.076	98.383
2024/06/10	357.744	233.263	334.137	521.206	190.435	229.693	219.534	235.328	98.036
2024/06/11	357.980	233.306	334.253	521.746	190.581	229.968	219.787	235.614	98.083
2024/06/12	358.895	233.441	334.782	523.795	191.151	231.001	220.588	236.743	98.286
2024/06/13	359.520	233.489	335.005	525.358	191.481	231.865	221.074	237.757	98.404
2024/06/14	360.445	233.622	335.572	527.406	192.096	232.864	221.840	238.853	98.610
2024/06/17	360.202	233.691	335.777	526.465	192.235	232.098	221.588	237.886	98.613
2024/06/18	359.726	233.711	335.699	525.139	192.040	231.305	221.179	236.939	98.538
2024/06/19	360.199	233.712	335.797	526.416	192.134	232.137	221.623	237.927	98.606
2024/06/20	359.919	233.696	335.632	525.770	191.858	231.881	221.138	237.756	98.543
2024/06/21	359.286	233.627	335.361	524.247	191.525	231.049	220.494	236.845	98.425
2024/06/24	358.879	233.653	335.324	523.081	191.368	230.339	220.010	236.044	98.367
2024/06/25	358.598	233.655	335.249	522.334	191.232	229.911	219.763	235.543	98.322
2024/06/26	357.885	233.629	335.075	520.452	190.872	228.844	219.064	234.327	98.206
2024/06/27	356.683	233.451	334.325	517.808	190.082	227.551	218.019	232.930	97.936
2024/06/28	357.535	233.504	334.578	519.993	190.491	228.797	218.950	234.305	98.099

出所:NFRC

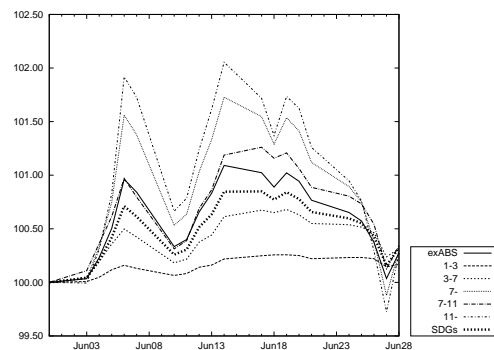
* は 1995 年 12 月末=100。 ** は 2017 年 12 月末=100。それ以外は、1983 年 12 月末=100。

指数の推移(月次) 2023年6月末=100に補正。



出所:NFRC

指数の推移(日次) 2024年5月末=100に補正。



出所:NFRC

「除く国債」残存別・投資収益率(2024年6月末)

	累積投資 収益指数	前月末からの投資収益率			過去からの投資収益率	
		トータル	キャピタル	インカム	前年度末	前年末
除く国債	168.645	3.84	3.16	0.68	-6.25	-3.49
短期(1-3)	133.228	2.52	2.12	0.40	-0.39	-0.42
中期(3-7)	165.731	4.38	3.78	0.59	-2.86	-1.94
長期(7-)	227.905	4.19	3.27	0.92	-12.32	-6.49
長期(7-11)	196.153	4.93	4.05	0.88	-7.24	-3.65
超長期(11-)	230.517	3.71	2.77	0.94	-15.46	-8.24

出所:NFRC

NOMURA-BPI 総合から国債を除いたポートフォリオ。投資収益率は年率換算(%)

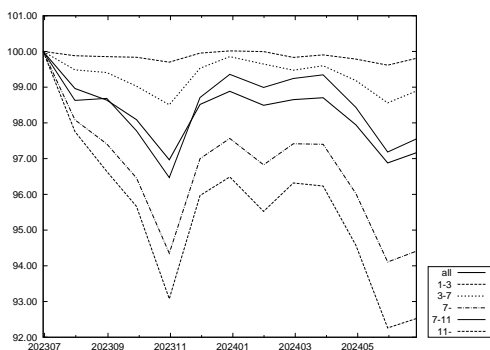
「除く国債」残存別・投資収益指数の推移

除く国債 年/月/日	全体	短期 (1-3)	中期 (3-7)	長期 (7-)	長期*	超長期*
					(7-11)	(11-)
2023/06/30	173.566	133.485	167.588	241.400	201.075	249.147
2023/07/31	171.766	133.327	166.723	236.776	198.319	243.560
2023/08/31	171.201	133.293	166.598	235.153	198.434	240.783
2023/09/29	170.251	133.269	165.958	232.849	196.608	238.336
2023/10/31	168.303	133.086	165.085	227.764	193.978	231.899
2023/11/30	170.991	133.422	166.800	234.156	198.481	239.103
2023/12/29	171.632	133.505	167.346	235.524	199.785	240.393
2024/01/31	170.949	133.481	166.998	233.738	199.050	237.992
2024/02/29	171.225	133.263	166.706	235.165	199.556	239.975
2024/03/29	171.316	133.358	166.920	235.126	199.759	239.759
2024/04/30	170.000	133.200	166.220	231.797	197.926	235.626
2024/05/31	168.150	132.971	165.176	227.176	195.414	229.863
2024/06/03	168.232	132.984	165.254	227.342	195.635	229.971
2024/06/04	168.501	133.040	165.484	227.904	196.115	230.543
2024/06/05	168.850	133.131	165.744	228.654	196.591	231.430
2024/06/06	169.360	133.190	165.972	229.998	197.268	233.150
2024/06/07	169.195	133.153	165.859	229.626	196.951	232.772
2024/06/10	168.585	133.067	165.476	228.159	196.053	231.013
2024/06/11	168.672	133.092	165.532	228.352	196.188	231.231
2024/06/12	169.010	133.169	165.782	229.092	196.762	232.027
2024/06/13	169.219	133.198	165.892	229.619	197.094	232.653
2024/06/14	169.577	133.275	166.167	230.400	197.727	233.471
2024/06/17	169.573	133.318	166.267	230.231	197.853	233.095
2024/06/18	169.441	133.329	166.234	229.826	197.664	232.566
2024/06/19	169.566	133.331	166.281	230.179	197.754	233.084
2024/06/20	169.446	133.323	166.208	229.878	197.480	232.791
2024/06/21	169.246	133.290	166.094	229.389	197.200	232.190
2024/06/24	169.136	133.306	166.080	229.030	197.054	231.704
2024/06/25	169.045	133.308	166.044	228.772	196.900	231.392
2024/06/26	168.825	133.297	165.965	228.157	196.542	230.642
2024/06/27	168.363	133.196	165.605	227.160	195.747	229.587
2024/06/28	168.645	133.228	165.731	227.905	196.153	230.517

出所:NFRC

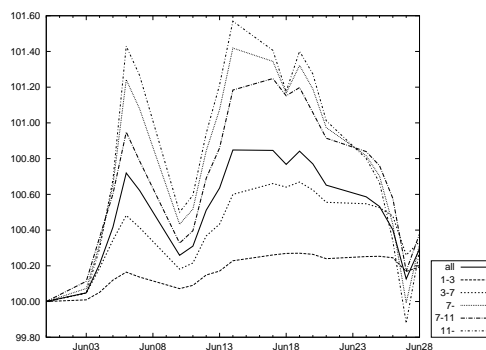
*は1995年12月末=100。それ以外は、1993年12月末=100。

指数の推移(月次) 2023年6月末=100に補正。



出所:NFRC

指数の推移(日次) 2024年5月末=100に補正。



出所:NFRC

銘柄 残存別・月間投資収益率(2024年6月末)

	全体	短期 (1-3)	中期 (3-7)	長期 (7-)	月間投資収益率	
					(7-11)	(11-)
総合	3.58	2.19	4.10	3.89	4.46	3.54
国債	3.54	2.12	4.04	3.84	4.39	3.52
30年国債	3.20	-	4.29	3.18	4.25	3.07
20年国債	3.91	2.30	4.14	4.05	4.14	3.99
10年国債	3.79	2.26	4.05	4.63	4.63	-
5年国債	2.99	2.25	3.86	-	-	-
中期国債	1.44	1.44	-	-	-	-
地方債	4.17	2.36	4.28	4.91	5.14	4.66
東京都債	3.82	2.19	4.08	4.53	4.72	4.23
五大都市債	3.77	2.26	3.96	4.25	4.65	4.03
その他地方債	4.09	2.33	4.17	4.85	4.90	4.78
政保債	3.60	2.32	4.21	3.88	4.27	3.70
公営企業債券	3.15	2.28	4.14	-	-	-
その他政保債	3.67	2.33	4.22	3.88	4.27	3.70
金融債	3.12	2.42	4.03	4.95	4.95	-
特定金融債	-	-	-	-	-	-
事業債	3.88	2.68	4.54	4.29	4.74	3.91
円建外債	3.55	2.21	3.79	10.22	7.55	13.41
MBS	2.51	-	-	2.51	2.78	2.51
ABS	3.99	2.58	4.63	4.62	5.36	3.60

出所:NFRFC

「除く(銘柄)」残存別・月間投資収益率(2024年6月末)

	全体	短期 (1-3)	中期 (3-7)	長期 (7-)	月間投資収益率	
					(7-11)	(11-)
除く国債	3.84	2.52	4.38	4.19	4.93	3.71
除く30年国債	3.65	2.19	4.10	4.18	4.48	3.89
除く20年国債	3.47	2.18	4.09	3.80	4.65	3.30
除く10年国債	3.51	2.16	4.14	3.74	4.34	3.54
除く5年国債	3.66	2.17	4.15	3.89	4.46	3.54
除く中期国債	3.65	2.31	4.10	3.89	4.46	3.54
除く地方債	3.55	2.18	4.08	3.83	4.41	3.50
除く東京都債	3.58	2.19	4.10	3.88	4.46	3.54
除く五大都市債	3.58	2.19	4.10	3.89	4.46	3.54
除くその他地方債	3.56	2.19	4.10	3.85	4.44	3.51
除く政保債	3.58	2.19	4.10	3.89	4.46	3.54
除く公営企業債券	3.58	2.19	4.10	3.89	4.46	3.54
除くその他政保債	3.58	2.19	4.10	3.89	4.46	3.54
除く金融債	3.59	2.19	4.10	3.89	4.46	3.54
除く特定金融債	3.58	2.19	4.10	3.89	4.46	3.54
除く事業債	3.56	2.14	4.06	3.87	4.45	3.53
除く円建外債	3.58	2.19	4.10	3.88	4.46	3.54
除くMBS	3.60	2.19	4.10	3.92	4.46	3.58
除くABS	3.58	2.19	4.10	3.89	4.46	3.54
除くMBS・ABS	3.60	2.19	4.10	3.92	4.46	3.58

出所:NFRFC

- ・月間投資収益率とは、前月末～今月末までの投資収益率を年率換算(%)。
- ・「除く(銘柄)」とは、NOMURA-BPI 総合から表中の各銘柄を除いたポートフォリオ。例えば、上記の「除く国債」は NOMURA-BPI 総合から国債を除いたポートフォリオの、「除く30年国債」は NOMURA-BPI 総合から30年国債を除いたポートフォリオの投資収益率を表す。
- ・中期国債とは、2年国債・4年国債。
- ・五大都市債とは、大阪市債・名古屋市債・京都市債・神戸市債・横浜市債。
- ・特定金融債とは、格付会社4社の格付が翌月ポートフォリオ確定日において、すべてBBB格相当以下の金融債。ただし、金融債に格付が付されていない場合には、当該金融機関が発行する優先債に対する格付をもとに判断する。

事業債 業種別・月間投資収益率(2024年6月末)

	全体	短期 (1-3)	中期 (3-7)	長期 (7-)	月間投資収益率	
					(7-11)	(11-)
事業債 全体	3.88	2.68	4.54	4.29	4.74	3.91
水産・農林業	-	-	-	-	-	-
鉱業	4.16	1.94	5.15	5.52	5.52	-
建設業	3.66	2.53	4.21	4.53	5.02	3.84
食料品	3.62	2.50	4.53	4.36	4.69	3.81
繊維製品	4.39	2.17	5.19	5.06	4.72	5.38
パルプ・紙	2.88	2.14	4.02	2.07	-0.48	4.86
化学	4.05	3.08	4.37	4.70	4.99	4.31
医薬品	4.09	2.55	4.27	4.79	5.85	1.79
石油・石炭製品	4.24	1.98	4.35	5.30	5.50	4.19
ゴム製品	3.71	2.87	4.04	5.95	5.95	-
ガラス・土石製品	4.40	3.00	5.44	4.92	4.80	5.21
鉄鋼	3.81	2.63	4.36	5.58	5.71	4.76
非鉄金属	4.03	2.93	4.56	4.55	4.55	-
金属製品	3.14	2.19	3.52	5.19	5.19	-
機械	3.91	2.77	4.53	5.04	5.04	-
電気機器	3.99	2.50	4.71	5.34	5.34	-
輸送用機器	3.74	3.09	4.50	4.13	4.73	3.26
精密機器	3.99	2.63	4.86	5.10	5.10	-
その他製品	3.90	2.29	4.28	4.41	5.01	4.18
電気・ガス業	2.82	2.60	3.89	2.03	0.92	3.14
陸運業	3.91	2.44	4.46	3.99	5.33	3.33
海運業	3.54	3.26	3.77	3.13	3.13	-
空運業	7.16	4.39	7.93	9.65	8.22	10.05
倉庫・運輸関連業	5.98	2.04	6.40	6.51	2.35	10.51
情報・通信業	4.92	3.08	6.15	6.06	6.55	4.88
卸売業	4.50	2.76	4.69	4.93	5.23	4.15
小売業	3.69	2.17	4.13	6.66	7.21	4.60
銀行業	3.65	2.76	4.54	4.76	4.76	-
証券、商品先物取引業	3.60	3.05	5.21	5.93	5.93	-
保険業	3.73	3.01	4.01	5.28	5.28	-
その他金融業	3.67	2.64	4.39	5.20	5.28	4.51
不動産業	4.88	2.66	4.56	6.37	5.93	7.01
サービス業	10.12	5.62	7.43	23.63	28.19	6.61
財投機関債	4.08	2.51	4.71	4.73	6.11	4.11

出所:NFRFC

- ・月間投資収益率とは、前月末～今月末までの投資収益率を年率換算(%)。
- ・東証33業種分類を参考にNFRFCで分類。財投機関債には、交通債券・放送債券を含む。

事業債 円建外債 格付別・月間投資収益率(2024年6月末)

	全体	短期 (1-3)	中期 (3-7)	長期 (7-)	月間投資収益率	
					(7-11)	(11-)
事業債・円建外債 全体	3.87	2.65	4.51	4.37	4.78	4.01
AAA～AA 格	3.78	2.52	4.42	4.26	4.61	4.01
AAA 格	3.76	2.47	4.60	4.84	5.57	3.50
AA 格	3.78	2.53	4.36	4.20	4.42	4.04
A 格	4.09	2.94	4.69	4.71	5.18	4.04
事業債 全体	3.88	2.68	4.54	4.29	4.74	3.91
AAA～AA 格	3.80	2.54	4.44	4.25	4.59	4.00
AAA 格	3.76	2.47	4.60	4.84	5.57	3.50
AA 格	3.81	2.56	4.39	4.18	4.40	4.04
A 格	4.10	3.03	4.77	4.43	5.08	3.46
円建外債 全体	3.55	2.21	3.79	10.22	7.55	13.41
AAA～AA 格	3.04	2.08	3.75	6.62	6.19	13.54
AAA 格	-	-	-	-	-	-
AA 格	3.04	2.08	3.75	6.62	6.19	13.54
A 格	3.95	2.31	3.83	11.48	8.65	13.40

出所:NFRFC

- ・月間投資収益率とは、前月末～今月末までの投資収益率を年率換算(%)。
- ・格付は、格付会社4社の最高格付をもとに分類

事業債 円建外債 最高格付別・月間投資収益率(2024年6月末)

	全体	短期 (1-3)	中期 (3-7)	長期 (7-)	月間投資収益率	
					(7-11)	(11-)
事業債						
AAA~AA格	3.80	2.54	4.44	4.25	4.59	4.00
AAA~A格	3.88	2.68	4.54	4.29	4.74	3.91
AAA~BBB格	3.88	2.68	4.54	4.29	4.74	3.91
AAA~BB格	3.88	2.68	4.54	4.29	4.74	3.91
AAA格	3.76	2.47	4.60	4.84	5.57	3.50
AA格	3.81	2.56	4.39	4.18	4.40	4.04
A格	4.10	3.03	4.77	4.43	5.08	3.46
BBB格	-	-	-	-	-	-
BB格	-	-	-	-	-	-
B格以下	-	-	-	-	-	-
格付なし	-	-	-	-	-	-
円建外債						
AAA~AA格	3.04	2.08	3.75	6.62	6.19	13.54
AAA~A格	3.55	2.21	3.79	10.22	7.55	13.41
AAA~BBB格	3.55	2.21	3.79	10.22	7.55	13.41
AAA~BB格	3.55	2.21	3.79	10.22	7.55	13.41
AAA格	-	-	-	-	-	-
AA格	3.04	2.08	3.75	6.62	6.19	13.54
A格	3.95	2.31	3.83	11.48	8.65	13.40
BBB格	-	-	-	-	-	-
BB格	-	-	-	-	-	-
B格以下	-	-	-	-	-	-
格付なし	-	-	-	-	-	-

出所:NFRFC

- 月間投資収益率とは、前月末~今月末までの投資収益率を年率換算(%)
- 格付は、格付会社4社の最高格付をもとに分類
- 前ページ下表「格付別・月間投資収益率」と同内容の表である

事業債 円建外債 最低格付別・月間投資収益率(2024年6月末)

	全体	短期 (1-3)	中期 (3-7)	長期 (7-)	月間投資収益率	
					(7-11)	(11-)
事業債						
AAA~AA格	3.73	2.48	4.42	4.28	5.26	3.40
AAA~A格	3.88	2.67	4.55	4.32	4.80	3.90
AAA~BBB格	3.88	2.68	4.54	4.29	4.74	3.91
AAA~BB格	3.88	2.68	4.54	4.29	4.74	3.91
AAA格	-	-	-	-	-	-
AA格	3.73	2.48	4.42	4.28	5.26	3.40
A格	3.92	2.72	4.58	4.32	4.73	3.97
BBB格	3.69	2.92	4.36	3.35	2.55	4.19
BB格	5.13	-	5.07	5.73	-	5.73
B格以下	-	-	-	-	-	-
格付なし	-	-	-	-	-	-
円建外債						
AAA~AA格	3.30	2.31	4.31	7.72	7.72	-
AAA~A格	3.57	2.42	3.88	10.08	8.00	12.92
AAA~BBB格	3.55	2.21	3.79	10.22	7.55	13.41
AAA~BB格	3.55	2.21	3.79	10.22	7.55	13.41
AAA格	-	-	-	-	-	-
AA格	3.30	2.31	4.31	7.72	7.72	-
A格	3.61	2.44	3.81	10.31	8.05	12.92
BBB格	3.50	1.72	3.63	10.41	6.84	13.94
BB格	-	-	-	-	-	-
B格以下	-	-	-	-	-	-
格付なし	-	-	-	-	-	-

出所:NFRFC

- 月間投資収益率とは、前月末~今月末までの投資収益率を年率換算(%)
- 格付は、格付会社4社の最低格付をもとに分類

事業債 円建外債 R&I 格付別・月間投資収益率(2024年6月末)

	全体	短期 (1-3)	中期 (3-7)	長期 (7-)	月間投資収益率	
					(7-11)	(11-)
事業債						
AAA~AA 格	3.97	2.53	4.55	4.59	5.55	3.97
AAA~A 格	3.77	2.60	4.46	4.10	4.40	3.87
AAA~BBB 格	3.78	2.62	4.47	4.12	4.43	3.87
AAA~BB 格	3.78	2.62	4.47	4.12	4.43	3.87
AAA 格	3.27	2.56	4.09	3.86	4.50	2.21
AA 格	3.98	2.52	4.57	4.59	5.57	3.97
A 格	3.47	2.71	4.34	3.17	2.85	3.59
BBB 格	8.77	6.65	7.18	36.59	36.59	-
BB 格	-	-	-	-	-	-
B 格以下	-	-	-	-	-	-
格付なし	4.96	3.32	5.18	7.08	8.12	5.08
円建外債						
AAA~AA 格	2.59	2.59	-	-	-	-
AAA~A 格	3.14	2.08	3.76	8.04	8.04	-
AAA~BBB 格	3.14	2.08	3.76	8.04	8.04	-
AAA~BB 格	3.14	2.08	3.76	8.04	8.04	-
AAA 格	-	-	-	-	-	-
AA 格	2.59	2.59	-	-	-	-
A 格	3.16	2.04	3.76	8.04	8.04	-
BBB 格	-	-	-	-	-	-
BB 格	-	-	-	-	-	-
B 格以下	-	-	-	-	-	-
格付なし	3.68	2.24	3.81	10.47	7.43	13.41

出所:NFRFC

- 月間投資収益率とは、前月末~今月末までの投資収益率を年率換算(%)
- 格付は、R&Iの格付をもとにNFRFCで分類

事業債 円建外債 JCR 格付別・月間投資収益率(2024年6月末)

	全体	短期 (1-3)	中期 (3-7)	長期 (7-)	月間投資収益率	
					(7-11)	(11-)
事業債						
AAA~AA 格	3.63	2.52	4.38	4.02	3.76	4.40
AAA~A 格	3.83	2.68	4.55	4.24	4.43	3.98
AAA~BBB 格	3.83	2.68	4.55	4.24	4.43	3.98
AAA~BB 格	3.83	2.68	4.55	4.24	4.43	3.98
AAA 格	3.80	2.47	4.64	4.84	5.57	3.50
AA 格	3.54	2.56	4.22	3.74	3.05	4.65
A 格	4.30	3.11	4.96	4.70	5.82	3.11
BBB 格	-	-	-	-	-	-
BB 格	-	-	-	-	-	-
B 格以下	-	-	-	-	-	-
格付なし	3.96	2.69	4.53	4.34	5.22	3.87
円建外債						
AAA~AA 格	0.75	0.41	0.73	3.55	1.25	13.54
AAA~A 格	4.20	2.12	3.74	11.11	7.04	13.72
AAA~BBB 格	4.20	2.12	3.74	11.11	7.04	13.72
AAA~BB 格	4.20	2.12	3.74	11.11	7.04	13.72
AAA 格	-	-	-	-	-	-
AA 格	0.75	0.41	0.73	3.55	1.25	13.54
A 格	5.43	2.91	4.78	12.15	8.98	13.72
BBB 格	-	-	-	-	-	-
BB 格	-	-	-	-	-	-
B 格以下	-	-	-	-	-	-
格付なし	3.23	2.25	3.81	8.42	8.01	10.82

出所:NFRFC

- 月間投資収益率とは、前月末~今月末までの投資収益率を年率換算(%)
- 格付は、JCRの格付をもとにNFRFCで分類

事業債 円建外債 Moody's 格付別・月間投資収益率(2024年6月末)

	全体	短期 (1-3)	中期 (3-7)	長期 (7-)	月間投資収益率(%)	
					(7-11)	(11-)
事業債						
AAA~AA格	-	-	-	-	-	-
AAA~A格	3.82	2.56	4.42	4.33	4.48	4.25
AAA~BBB格	3.81	2.56	4.40	4.24	4.23	4.25
AAA~BB格	3.81	2.56	4.40	4.24	4.23	4.25
AAA格	-	-	-	-	-	-
AA格	-	-	-	-	-	-
A格	3.82	2.56	4.42	4.33	4.48	4.25
BBB格	3.59	2.47	4.31	2.93	1.41	4.31
BB格	-	-	-	-	-	-
B格以下	-	-	-	-	-	-
格付なし	3.93	2.74	4.61	4.33	5.00	3.61
円建外債						
AAA~AA格	3.56	2.57	4.17	7.92	7.92	-
AAA~A格	3.61	2.39	3.90	10.07	8.03	12.65
AAA~BBB格	3.66	2.22	3.88	10.28	7.51	13.41
AAA~BB格	3.66	2.22	3.88	10.28	7.51	13.41
AAA格	-	-	-	-	-	-
AA格	3.56	2.57	4.17	7.92	7.92	-
A格	3.66	2.19	3.39	11.11	8.19	12.65
BBB格	3.83	1.53	3.85	10.65	6.41	14.59
BB格	-	-	-	-	-	-
B格以下	-	-	-	-	-	-
格付なし	2.21	2.11	1.77	8.21	8.21	-

出所:NFRFC

- 月間投資収益率は、前月末～今月末までの投資収益率を年率換算(%)
- 格付は、Moody'sの格付をもとにNFRFCで分類

事業債 円建外債 S&P 格付別・月間投資収益率(2024年6月末)

	全体	短期 (1-3)	中期 (3-7)	長期 (7-)	月間投資収益率(%)	
					(7-11)	(11-)
事業債						
AAA~AA格	4.17	2.86	4.37	4.23	4.69	3.97
AAA~A格	3.98	2.48	4.52	4.47	5.00	4.00
AAA~BBB格	3.96	2.49	4.52	4.47	5.00	4.00
AAA~BB格	3.98	2.49	4.54	4.48	5.00	4.02
AAA格	-	-	-	-	-	-
AA格	4.17	2.86	4.37	4.23	4.69	3.97
A格	3.97	2.47	4.52	4.49	5.03	4.01
BBB格	3.52	2.62	4.48	5.04	5.12	4.76
BB格	5.13	-	5.07	5.73	-	5.73
B格以下	-	-	-	-	-	-
格付なし	3.85	2.73	4.55	4.22	4.63	3.87
円建外債						
AAA~AA格	3.48	2.34	4.33	7.72	7.72	-
AAA~A格	3.59	2.41	3.88	10.11	8.01	12.92
AAA~BBB格	3.55	2.18	3.78	10.24	7.55	13.41
AAA~BB格	3.55	2.18	3.78	10.24	7.55	13.41
AAA格	-	-	-	-	-	-
AA格	3.48	2.34	4.33	7.72	7.72	-
A格	3.60	2.42	3.82	10.35	8.07	12.92
BBB格	3.48	1.63	3.59	10.41	6.84	13.94
BB格	-	-	-	-	-	-
B格以下	-	-	-	-	-	-
格付なし	3.26	2.90	4.52	7.54	7.54	-

出所:NFRFC

- 月間投資収益率は、前月末～今月末までの投資収益率を年率換算(%)
- 格付は、S&Pの格付をもとにNFRFCで分類

このページは空白です。

銘柄残存別・ポートフォリオ指標(2024年6月末)

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
総合	1,130,158	95.70	95.84	10.25	0.79	1.00	0.97	8.73	8.67	8.68	4
短期(1-3)	231,504	100.06	100.12	2.00	0.38	0.34	0.34	1.99	1.99	1.99	5
中期(3-7)	304,067	100.25	100.36	4.86	0.65	0.60	0.60	4.78	4.77	4.78	5
長期(7-)	594,588	91.68	91.87	16.21	1.03	1.51	1.45	13.79	13.68	13.70	4
長期(7-11)	204,754	100.34	100.50	8.76	0.98	0.95	0.96	8.40	8.36	8.39	3
超長期(11-)	389,834	87.13	87.34	20.12	1.05	1.85	1.74	17.05	16.89	16.91	4
(11-15)	93,987	95.28	95.47	12.98	0.99	1.41	1.38	12.13	12.05	12.11	4
(15-)	295,847	84.55	84.76	22.39	1.07	2.00	1.87	18.81	18.63	18.64	4
国債	958,319	95.62	95.76	10.75	0.82	1.01	0.97	9.11	9.05	9.06	1
短期(1-3)	190,678	100.14	100.20	2.00	0.38	0.30	0.30	1.99	1.98	1.99	1
中期(3-7)	247,505	100.54	100.63	4.89	0.66	0.55	0.56	4.80	4.79	4.80	0
長期(7-)	520,137	91.63	91.82	16.76	1.05	1.53	1.45	14.21	14.10	14.12	1
長期(7-11)	177,373	100.72	100.86	8.80	1.00	0.92	0.93	8.42	8.38	8.42	0
超長期(11-)	342,763	86.92	87.13	20.87	1.08	1.89	1.76	17.68	17.52	17.53	1
(11-15)	82,224	95.76	95.95	13.05	1.01	1.38	1.35	12.19	12.11	12.17	1
(15-)	260,539	84.13	84.35	23.34	1.10	2.07	1.90	19.65	19.46	19.46	1
地方債	66,869	96.83	96.96	7.39	0.60	0.86	0.87	6.80	6.76	6.77	10
短期(1-3)	12,837	99.92	100.00	2.03	0.38	0.39	0.39	2.02	2.02	2.02	10
中期(3-7)	24,286	99.12	99.23	4.96	0.50	0.66	0.65	4.88	4.87	4.88	9
長期(7-)	29,746	93.63	93.81	11.69	0.77	1.26	1.28	10.65	10.57	10.59	11
政保債	14,390	95.78	95.98	9.13	0.70	0.95	0.91	7.82	7.76	7.79	7
短期(1-3)	3,416	99.66	99.69	1.85	0.18	0.34	0.33	1.85	1.84	1.85	6
中期(3-7)	4,552	100.07	100.25	4.47	0.56	0.58	0.58	4.40	4.39	4.40	6
長期(7-)	6,422	90.67	90.99	16.30	1.07	1.60	1.51	13.96	13.85	13.89	8
金融債	3,439	98.62	98.67	3.12	0.25	0.67	0.66	3.07	3.06	3.07	26
短期(1-3)	2,025	99.19	99.22	2.02	0.15	0.54	0.54	2.02	2.01	2.02	25
中期(3-7)	1,236	98.25	98.33	4.18	0.37	0.78	0.77	4.14	4.12	4.14	27
長期(7-)	178	94.83	94.92	8.22	0.59	1.30	1.27	8.01	7.96	8.01	41
事業債	69,215	95.67	95.84	7.50	0.71	1.13	1.09	6.40	6.35	6.37	38
短期(1-3)	20,785	99.56	99.65	2.02	0.43	0.64	0.64	2.01	2.00	2.01	34
中期(3-7)	24,930	98.76	98.92	4.70	0.67	0.93	0.92	4.61	4.59	4.61	38
長期(7-)	23,500	88.96	89.20	15.33	1.01	1.85	1.73	12.85	12.73	12.75	41
長期(7-11)	10,023	96.63	96.83	8.56	0.94	1.39	1.36	8.21	8.16	8.21	46
超長期(11-)	13,477	83.26	83.53	20.37	1.06	2.25	2.05	16.84	16.67	16.67	37
円建外債	3,090	98.98	99.21	3.75	1.03	1.27	1.26	3.57	3.55	3.57	81
短期(1-3)	1,555	99.68	99.88	2.18	0.94	1.07	1.07	2.15	2.14	2.15	75
中期(3-7)	1,259	98.69	98.94	4.12	0.97	1.30	1.29	4.03	4.01	4.03	80
長期(7-)	276	96.36	96.73	10.91	1.86	2.32	2.27	9.66	9.55	9.63	117
長期(7-11)	150	96.13	96.51	8.55	1.34	1.89	1.85	8.05	7.97	8.04	96
超長期(11-)	126	96.65	97.00	13.74	2.49	2.83	2.77	11.58	11.42	11.52	142
MBS	14,137	94.50	94.53	7.35	0.63	0.86	1.33	6.83	6.79	7.06	22
ABS	699	95.63	95.79	5.64	0.70	1.30	1.26	5.21	5.17	5.20	66
短期(1-3)	209	99.63	99.76	1.86	0.71	0.88	0.88	1.85	1.84	1.85	60
中期(3-7)	299	97.11	97.27	4.95	0.65	1.23	1.21	4.85	4.82	4.85	66
長期(7-)	191	88.92	89.11	10.86	0.78	1.95	1.83	9.95	9.85	9.93	75

出所:NFRIC

「除く」銘柄 残存別・ポートフォリオ指標 (2024年6月末)

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
除く MBS	1,116,021	95.72	95.86	10.28	0.79	1.00	0.97	8.75	8.69	8.70	4
短期 (1-3)	231,504	100.06	100.12	2.00	0.38	0.34	0.34	1.99	1.99	1.99	5
中期 (3-7)	304,067	100.25	100.36	4.86	0.65	0.60	0.60	4.78	4.77	4.78	5
長期 (7-)	580,451	91.61	91.81	16.43	1.04	1.53	1.45	13.96	13.85	13.87	3
長期 (7-11)	204,561	100.34	100.50	8.77	0.98	0.95	0.96	8.40	8.36	8.40	3
超長期 (11-)	375,890	86.86	87.08	20.59	1.07	1.89	1.76	17.46	17.30	17.31	3
(11-15)	93,987	95.28	95.47	12.98	0.99	1.41	1.38	12.13	12.05	12.11	4
(15-)	281,903	84.06	84.28	23.13	1.09	2.07	1.90	19.47	19.28	19.27	3
除く ABS	1,129,459	95.70	95.84	10.25	0.79	1.00	0.97	8.73	8.67	8.69	4
短期 (1-3)	231,294	100.06	100.12	2.00	0.38	0.34	0.34	1.99	1.99	1.99	5
中期 (3-7)	303,768	100.25	100.36	4.86	0.65	0.60	0.60	4.78	4.77	4.78	4
長期 (7-)	594,397	91.68	91.87	16.21	1.03	1.51	1.45	13.79	13.68	13.70	4
長期 (7-11)	204,649	100.34	100.50	8.76	0.98	0.95	0.96	8.40	8.36	8.39	3
超長期 (11-)	389,748	87.13	87.34	20.12	1.05	1.85	1.74	17.05	16.89	16.92	4
(11-15)	93,929	95.28	95.48	12.98	0.99	1.41	1.38	12.13	12.05	12.11	4
(15-)	295,819	84.55	84.76	22.39	1.07	2.00	1.87	18.81	18.63	18.64	4
除く MBS・ABS	1,115,322	95.72	95.86	10.29	0.79	1.00	0.97	8.75	8.69	8.71	4
短期 (1-3)	231,294	100.06	100.12	2.00	0.38	0.34	0.34	1.99	1.99	1.99	5
中期 (3-7)	303,768	100.25	100.36	4.86	0.65	0.60	0.60	4.78	4.77	4.78	4
長期 (7-)	580,260	91.61	91.81	16.43	1.04	1.53	1.45	13.96	13.85	13.87	3
長期 (7-11)	204,456	100.34	100.50	8.77	0.98	0.95	0.96	8.40	8.36	8.40	3
超長期 (11-)	375,804	86.86	87.08	20.59	1.07	1.89	1.76	17.46	17.30	17.31	3
(11-15)	93,929	95.28	95.48	12.98	0.99	1.41	1.38	12.13	12.05	12.11	4
(15-)	281,875	84.06	84.28	23.13	1.09	2.07	1.90	19.47	19.28	19.27	3
除く 国債	171,839	96.15	96.30	7.42	0.66	0.98	1.00	6.58	6.54	6.58	24
短期 (1-3)	40,826	99.67	99.75	2.01	0.40	0.55	0.55	2.00	2.00	2.00	26
中期 (3-7)	56,562	99.00	99.14	4.77	0.59	0.79	0.78	4.69	4.67	4.69	24
長期 (7-)	74,451	92.07	92.25	12.40	0.85	1.40	1.45	10.85	10.76	10.83	23
長期 (7-11)	27,381	97.89	98.11	8.55	0.86	1.15	1.14	8.22	8.17	8.21	24
超長期 (11-)	47,070	88.68	88.84	14.64	0.84	1.55	1.66	12.54	12.42	12.52	22

出所:NFRG

- 「除く国債」とは、NOMURA-BPI 総合から国債を除いたポートフォリオ。
- 「除く MBS」とは、NOMURA-BPI 総合から MBS を除いたポートフォリオ。
- 「除く ABS」とは、NOMURA-BPI 総合から ABS を除いたポートフォリオ。
- 「除く MBS・ABS」とは、NOMURA-BPI 総合から MBS および ABS を除いたポートフォリオ。

銘柄 残存別・ポートフォリオ指標 (2024年6月末、7月ポートフォリオ)

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
総合	1,137,196	95.70	95.84	10.27	0.79	1.01	0.97	8.75	8.69	8.71	4
短期 (1-3)	230,880	100.06	100.13	2.03	0.39	0.35	0.35	2.02	2.01	2.02	5
中期 (3-7)	306,616	100.24	100.34	4.88	0.64	0.60	0.60	4.80	4.78	4.80	5
長期 (7-)	599,699	91.71	91.90	16.21	1.03	1.51	1.45	13.79	13.68	13.70	4
長期 (7-11)	207,908	100.31	100.47	8.79	0.98	0.96	0.96	8.42	8.38	8.41	3
超長期 (11-)	391,791	87.14	87.35	20.15	1.05	1.85	1.74	17.06	16.91	16.93	4
(11-15)	94,354	95.24	95.44	12.99	0.99	1.41	1.38	12.14	12.05	12.11	4
(15-)	297,437	84.57	84.78	22.42	1.07	2.01	1.88	18.82	18.64	18.65	4
国債	965,641	95.63	95.77	10.77	0.82	1.01	0.97	9.13	9.06	9.08	1
短期 (1-3)	190,464	100.15	100.21	2.01	0.38	0.30	0.30	2.00	2.00	2.00	1
中期 (3-7)	249,992	100.53	100.62	4.89	0.66	0.55	0.56	4.80	4.79	4.80	0
長期 (7-)	525,186	91.65	91.84	16.74	1.05	1.53	1.44	14.20	14.08	14.11	1
長期 (7-11)	180,561	100.67	100.82	8.81	0.99	0.93	0.93	8.44	8.40	8.43	0
超長期 (11-)	344,625	86.93	87.14	20.90	1.08	1.89	1.76	17.69	17.53	17.54	1
(11-15)	82,480	95.75	95.95	13.06	1.01	1.38	1.35	12.19	12.11	12.17	1
(15-)	262,145	84.15	84.37	23.36	1.10	2.07	1.90	19.66	19.47	19.47	1
地方債	67,059	96.83	96.96	7.44	0.60	0.87	0.88	6.85	6.81	6.82	10
短期 (1-3)	12,816	99.90	99.98	2.09	0.37	0.40	0.40	2.08	2.07	2.08	10
中期 (3-7)	24,534	99.07	99.18	5.02	0.50	0.66	0.66	4.95	4.93	4.95	9
長期 (7-)	29,710	93.65	93.83	11.75	0.78	1.27	1.29	10.70	10.62	10.64	11
政保債	14,162	95.70	95.91	9.36	0.71	0.97	0.93	8.03	7.97	8.00	7
短期 (1-3)	3,316	99.64	99.69	2.04	0.20	0.36	0.36	2.03	2.03	2.03	6
中期 (3-7)	4,347	100.14	100.32	4.56	0.58	0.59	0.59	4.49	4.48	4.49	6
長期 (7-)	6,499	90.71	91.02	16.30	1.07	1.60	1.51	13.98	13.86	13.91	8
金融債	3,443	98.62	98.67	3.18	0.26	0.67	0.67	3.14	3.12	3.14	27
短期 (1-3)	2,030	99.16	99.19	2.09	0.16	0.55	0.55	2.08	2.07	2.08	25
中期 (3-7)	1,235	98.27	98.35	4.25	0.38	0.79	0.78	4.21	4.19	4.21	28
長期 (7-)	178	94.83	94.92	8.22	0.59	1.30	1.27	8.01	7.96	8.01	41
事業債	68,929	95.65	95.82	7.62	0.72	1.14	1.10	6.50	6.45	6.47	38
短期 (1-3)	20,424	99.54	99.64	2.11	0.44	0.65	0.65	2.10	2.09	2.10	34
中期 (3-7)	25,026	98.71	98.87	4.78	0.67	0.93	0.93	4.70	4.67	4.70	38
長期 (7-)	23,480	89.00	89.24	15.42	1.02	1.86	1.74	12.92	12.79	12.82	41
長期 (7-11)	10,019	96.70	96.90	8.67	0.97	1.41	1.38	8.30	8.25	8.30	47
超長期 (11-)	13,460	83.27	83.54	20.44	1.07	2.25	2.05	16.90	16.72	16.73	36
円建外債	3,078	98.98	99.21	3.76	1.04	1.27	1.26	3.58	3.56	3.58	81
短期 (1-3)	1,605	99.67	99.88	2.22	0.94	1.07	1.06	2.19	2.18	2.19	75
中期 (3-7)	1,197	98.65	98.89	4.18	0.98	1.31	1.30	4.09	4.06	4.09	80
長期 (7-)	276	96.36	96.73	10.91	1.86	2.32	2.27	9.66	9.55	9.63	117
長期 (7-11)	150	96.13	96.51	8.55	1.34	1.89	1.85	8.05	7.97	8.04	96
超長期 (11-)	126	96.65	97.00	13.74	2.49	2.83	2.77	11.58	11.42	11.52	142
MBS	14,185	94.52	94.55	7.38	0.63	0.86	1.33	6.86	6.81	7.08	22
ABS	697	95.62	95.78	5.68	0.71	1.31	1.27	5.24	5.20	5.24	66
短期 (1-3)	227	99.53	99.67	1.98	0.69	0.89	0.89	1.97	1.96	1.97	60
中期 (3-7)	285	96.92	97.08	5.15	0.66	1.25	1.23	5.04	5.01	5.04	66
長期 (7-)	185	88.81	89.00	11.01	0.81	1.97	1.85	10.07	9.97	10.05	76

出所:NFRIC

「除く」銘柄 残存別・ポートフォリオ指標 (2024年6月末、7月ポートフォリオ)

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
除く MBS	1,123,010	95.72	95.86	10.31	0.80	1.01	0.97	8.78	8.72	8.73	4
短期 (1-3)	230,880	100.06	100.13	2.03	0.39	0.35	0.35	2.02	2.01	2.02	5
中期 (3-7)	306,616	100.24	100.34	4.88	0.64	0.60	0.60	4.80	4.78	4.80	5
長期 (7-)	585,514	91.64	91.83	16.42	1.04	1.53	1.45	13.96	13.85	13.87	3
長期 (7-11)	207,716	100.31	100.47	8.80	0.98	0.96	0.96	8.42	8.38	8.42	3
超長期 (11-)	377,798	86.87	87.08	20.62	1.07	1.89	1.76	17.47	17.31	17.32	3
(11-15)	94,354	95.24	95.44	12.99	0.99	1.41	1.38	12.14	12.05	12.11	4
(15-)	283,445	84.08	84.30	23.16	1.09	2.07	1.91	19.48	19.29	19.29	3
除く ABS	1,136,499	95.70	95.84	10.28	0.79	1.01	0.97	8.76	8.69	8.71	4
短期 (1-3)	230,653	100.06	100.13	2.03	0.39	0.35	0.35	2.02	2.01	2.02	5
中期 (3-7)	306,331	100.24	100.34	4.88	0.64	0.60	0.60	4.80	4.78	4.80	4
長期 (7-)	599,514	91.71	91.90	16.21	1.03	1.51	1.45	13.79	13.68	13.70	4
長期 (7-11)	207,807	100.31	100.47	8.79	0.98	0.96	0.96	8.42	8.38	8.41	3
超長期 (11-)	391,707	87.14	87.35	20.15	1.05	1.85	1.74	17.07	16.91	16.93	4
(11-15)	94,298	95.25	95.45	12.99	0.99	1.41	1.38	12.14	12.05	12.11	4
(15-)	297,409	84.57	84.78	22.42	1.07	2.01	1.88	18.82	18.64	18.65	4
除く MBS・ABS	1,122,313	95.72	95.86	10.31	0.80	1.01	0.97	8.78	8.72	8.73	4
短期 (1-3)	230,653	100.06	100.13	2.03	0.39	0.35	0.35	2.02	2.01	2.02	5
中期 (3-7)	306,331	100.24	100.34	4.88	0.64	0.60	0.60	4.80	4.78	4.80	4
長期 (7-)	585,329	91.64	91.83	16.43	1.04	1.53	1.45	13.96	13.85	13.87	3
長期 (7-11)	207,614	100.32	100.47	8.80	0.98	0.96	0.96	8.42	8.38	8.42	3
超長期 (11-)	377,715	86.87	87.09	20.62	1.07	1.89	1.76	17.47	17.31	17.33	3
(11-15)	94,298	95.25	95.45	12.99	0.99	1.41	1.38	12.14	12.05	12.11	4
(15-)	283,417	84.08	84.30	23.16	1.09	2.07	1.91	19.48	19.30	19.29	3
除く 国債	171,555	96.14	96.29	7.50	0.66	0.99	1.01	6.66	6.62	6.66	24
短期 (1-3)	40,417	99.65	99.74	2.10	0.40	0.56	0.56	2.09	2.08	2.09	26
中期 (3-7)	56,625	98.96	99.10	4.85	0.59	0.79	0.79	4.77	4.75	4.77	24
長期 (7-)	74,513	92.09	92.28	12.46	0.86	1.40	1.46	10.90	10.81	10.88	22
長期 (7-11)	27,348	97.94	98.15	8.64	0.88	1.16	1.15	8.30	8.25	8.29	24
超長期 (11-)	47,166	88.71	88.87	14.67	0.84	1.56	1.66	12.56	12.45	12.54	22

出所:NFRG

- ・「除く 国債」とは、NOMURA-BPI 総合から国債を除いたポートフォリオ。
- ・「除く MBS」とは、NOMURA-BPI 総合から MBS を除いたポートフォリオ。
- ・「除く ABS」とは、NOMURA-BPI 総合から ABS を除いたポートフォリオ。
- ・「除く MBS・ABS」とは、NOMURA-BPI 総合から MBS および ABS を除いたポートフォリオ。

特定銘柄 残存別・ポートフォリオ指標 (2024年6月末)

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
30年国債	180,387	90.78	91.05	20.78	1.44	1.85	1.74	17.24	17.09	17.10	2
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	2,403	111.41	111.83	6.14	2.56	0.63	0.66	5.73	5.71	5.72	1
長期 (7-)	177,984	90.50	90.77	20.97	1.43	1.87	1.76	17.44	17.28	17.29	2
長期 (7-11)	13,408	110.37	110.66	9.52	2.15	0.96	1.01	8.68	8.64	8.67	2
超長期 (11-)	164,576	88.88	89.15	21.91	1.37	1.96	1.84	18.32	18.15	18.16	2
20年国債	293,441	97.97	98.17	10.46	1.33	1.07	1.04	9.46	9.40	9.44	1
短期 (1-3)	25,904	103.91	104.23	2.15	2.15	0.31	0.31	2.11	2.10	2.11	1
中期 (3-7)	63,497	107.37	107.67	5.23	2.06	0.57	0.59	4.99	4.97	4.98	1
長期 (7-)	204,041	94.29	94.44	13.14	0.99	1.35	1.30	12.08	12.00	12.05	0
長期 (7-11)	72,067	104.88	105.11	9.11	1.56	0.94	0.96	8.51	8.47	8.50	1
超長期 (11-)	131,974	88.50	88.61	15.35	0.69	1.62	1.53	14.39	14.28	14.35	0
10年国債	288,480	97.55	97.58	5.45	0.21	0.62	0.61	5.36	5.34	5.36	0
短期 (1-3)	68,755	99.61	99.64	2.10	0.16	0.31	0.31	2.10	2.09	2.10	1
中期 (3-7)	127,826	97.53	97.54	5.09	0.10	0.58	0.57	5.06	5.05	5.06	0
長期 (7-)	91,899	96.04	96.10	8.45	0.39	0.91	0.89	8.30	8.27	8.30	-1
5年国債	117,452	99.26	99.28	2.95	0.13	0.39	0.39	2.94	2.93	2.94	0
短期 (1-3)	63,673	99.37	99.37	2.11	0.03	0.31	0.31	2.11	2.10	2.11	1
中期 (3-7)	53,778	99.13	99.17	3.94	0.25	0.48	0.48	3.92	3.91	3.92	0
中期国債	32,346	99.80	99.82	1.42	0.09	0.24	0.24	1.42	1.42	1.42	1
短期 (1-3)	32,346	99.80	99.82	1.42	0.09	0.24	0.24	1.42	1.42	1.42	1
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
地方公共団体	57,033	96.93	97.05	7.19	0.56	0.84	0.85	6.65	6.61	6.63	9
短期 (1-3)	11,218	99.85	99.93	2.02	0.34	0.39	0.39	2.02	2.01	2.02	9
中期 (3-7)	20,861	98.98	99.08	4.93	0.46	0.65	0.64	4.86	4.84	4.86	9
長期 (7-)	24,955	93.89	94.06	11.40	0.75	1.22	1.26	10.44	10.37	10.38	10
東京都債	4,709	98.26	98.50	7.22	0.70	0.84	0.83	6.58	6.54	6.56	9
短期 (1-3)	1,035	99.95	100.09	1.99	0.40	0.38	0.38	1.98	1.98	1.98	9
中期 (3-7)	1,970	99.12	99.30	5.07	0.52	0.66	0.66	4.99	4.97	4.99	9
長期 (7-)	1,704	96.25	96.61	12.88	1.09	1.35	1.31	11.36	11.28	11.32	10
五大都市債	6,229	97.27	97.43	8.12	0.82	0.90	0.93	7.25	7.21	7.21	10
短期 (1-3)	1,142	100.32	100.41	2.03	0.56	0.39	0.39	2.02	2.01	2.02	9
中期 (3-7)	2,183	100.75	100.91	4.74	0.81	0.63	0.63	4.64	4.63	4.64	9
長期 (7-)	2,904	93.45	93.65	13.05	0.94	1.34	1.41	11.57	11.48	11.48	12
その他地方公共団体	46,095	96.74	96.85	7.06	0.51	0.83	0.85	6.58	6.54	6.55	9
短期 (1-3)	9,041	99.78	99.85	2.03	0.30	0.39	0.39	2.02	2.02	2.02	9
中期 (3-7)	16,708	98.73	98.82	4.93	0.41	0.65	0.64	4.87	4.86	4.87	8
長期 (7-)	20,347	93.76	93.91	11.05	0.70	1.19	1.24	10.20	10.13	10.15	9
その他地方債	9,836	96.28	96.46	8.53	0.80	1.02	0.99	7.65	7.61	7.64	15
短期 (1-3)	1,619	100.39	100.50	2.06	0.65	0.45	0.45	2.04	2.04	2.04	15
中期 (3-7)	3,425	99.97	100.12	5.13	0.75	0.72	0.72	5.03	5.01	5.03	15
長期 (7-)	4,792	92.26	92.47	13.15	0.88	1.46	1.39	11.75	11.66	11.71	15
特定金融債	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
政保地方公営企業債	1,730	99.09	99.13	2.79	0.16	0.42	0.42	2.77	2.76	2.77	5
短期 (1-3)	920	99.63	99.67	1.81	0.17	0.33	0.33	1.81	1.80	1.81	6
中期 (3-7)	810	98.47	98.51	3.89	0.14	0.52	0.52	3.88	3.87	3.88	5
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
その他政保債	12,660	95.33	95.55	9.99	0.77	1.03	0.98	8.53	8.47	8.50	7
短期 (1-3)	2,496	99.67	99.70	1.87	0.18	0.34	0.34	1.86	1.86	1.86	6
中期 (3-7)	3,742	100.42	100.63	4.59	0.65	0.59	0.59	4.51	4.50	4.51	6
長期 (7-)	6,422	90.67	90.99	16.30	1.07	1.60	1.51	13.96	13.85	13.89	8
SDGs	16,290	96.07	96.17	7.33	0.51	0.98	0.96	6.60	6.56	6.58	22

出所:NFRC

- 中期国債とは、2年国債・4年国債。
- 五大都市債とは、大阪市債・名古屋市債・京都市債・神戸市債・横浜市債。
- 特定金融債とは、格付会社4社の格付が翌月ポートフォリオ確定日において、すべてBBB格相当以下の金融債。ただし、金融債に格付が付されていない場合には、当該金融機関が発行する優先債に対する格付をもとに判断する。

特定銘柄 残存別・ポートフォリオ指標 (2024年6月末、7月ポートフォリオ)

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
30年国債	181,706	90.77	91.04	20.82	1.44	1.85	1.75	17.28	17.12	17.13	2
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	2,403	111.41	111.83	6.14	2.56	0.63	0.66	5.73	5.71	5.72	1
長期(7-)	179,303	90.49	90.76	21.02	1.43	1.87	1.76	17.47	17.31	17.32	2
長期(7-11)	13,408	110.37	110.66	9.52	2.15	0.96	1.01	8.68	8.64	8.67	2
超長期(11-)	165,895	88.89	89.16	21.95	1.37	1.96	1.84	18.35	18.17	18.19	2
20年国債	293,877	97.95	98.15	10.47	1.32	1.07	1.04	9.47	9.41	9.45	1
短期(1-3)	25,904	103.91	104.23	2.15	2.15	0.31	0.31	2.11	2.10	2.11	1
中期(3-7)	63,502	107.37	107.67	5.23	2.06	0.57	0.59	4.99	4.97	4.98	1
長期(7-)	204,471	94.28	94.42	13.15	0.99	1.35	1.30	12.08	12.00	12.06	0
長期(7-11)	72,070	104.88	105.11	9.11	1.56	0.94	0.96	8.51	8.47	8.50	1
超長期(11-)	132,402	88.50	88.61	15.35	0.69	1.62	1.53	14.39	14.28	14.35	0
10年国債	291,847	97.56	97.59	5.49	0.21	0.62	0.61	5.40	5.38	5.40	0
短期(1-3)	68,755	99.61	99.64	2.10	0.16	0.31	0.31	2.10	2.09	2.10	1
中期(3-7)	128,009	97.53	97.54	5.09	0.10	0.58	0.57	5.06	5.05	5.06	0
長期(7-)	95,083	96.11	96.18	8.49	0.40	0.91	0.89	8.34	8.30	8.34	-1
5年国債	119,751	99.27	99.29	2.98	0.14	0.39	0.39	2.97	2.96	2.97	0
短期(1-3)	63,673	99.37	99.37	2.11	0.03	0.31	0.31	2.11	2.10	2.11	1
中期(3-7)	56,078	99.15	99.20	3.97	0.26	0.48	0.48	3.95	3.94	3.95	0
中期国債	32,132	99.82	99.85	1.51	0.13	0.25	0.25	1.50	1.50	1.50	2
短期(1-3)	32,132	99.82	99.85	1.51	0.13	0.25	0.25	1.50	1.50	1.50	2
中期(3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
地方公共団体	57,257	96.93	97.05	7.24	0.57	0.84	0.86	6.70	6.66	6.67	9
短期(1-3)	11,217	99.83	99.91	2.08	0.33	0.39	0.39	2.07	2.07	2.07	9
中期(3-7)	21,100	98.94	99.04	4.99	0.46	0.65	0.65	4.92	4.91	4.92	9
長期(7-)	24,940	93.92	94.09	11.46	0.76	1.23	1.27	10.49	10.42	10.43	10
東京都債	4,729	98.27	98.50	7.23	0.70	0.84	0.83	6.59	6.55	6.58	9
短期(1-3)	1,035	99.95	100.09	1.99	0.40	0.38	0.38	1.98	1.98	1.98	9
中期(3-7)	1,970	99.12	99.30	5.07	0.52	0.66	0.66	4.99	4.97	4.99	9
長期(7-)	1,724	96.28	96.65	12.84	1.08	1.34	1.31	11.34	11.26	11.29	10
五大都市債	6,305	97.28	97.45	8.17	0.83	0.90	0.94	7.30	7.25	7.25	10
短期(1-3)	1,150	100.31	100.40	2.04	0.55	0.39	0.39	2.03	2.02	2.03	9
中期(3-7)	2,203	100.74	100.90	4.75	0.81	0.63	0.63	4.65	4.64	4.65	9
長期(7-)	2,952	93.52	93.72	13.11	0.95	1.34	1.41	11.62	11.53	11.53	11
その他地方公共団体	46,223	96.74	96.85	7.11	0.52	0.83	0.85	6.63	6.59	6.61	9
短期(1-3)	9,032	99.76	99.82	2.09	0.30	0.39	0.39	2.09	2.08	2.09	9
中期(3-7)	16,927	98.69	98.77	5.01	0.41	0.65	0.65	4.95	4.93	4.95	9
長期(7-)	20,264	93.77	93.92	11.11	0.71	1.20	1.24	10.26	10.19	10.20	9
その他地方債	9,803	96.26	96.44	8.60	0.80	1.03	0.99	7.72	7.67	7.70	15
短期(1-3)	1,599	100.41	100.52	2.13	0.65	0.46	0.46	2.12	2.12	2.12	15
中期(3-7)	3,434	99.89	100.05	5.20	0.74	0.73	0.73	5.09	5.07	5.09	15
長期(7-)	4,770	92.26	92.47	13.22	0.89	1.47	1.40	11.80	11.71	11.76	15
特定金融債	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
政保地方公営企業債	1,605	99.02	99.06	2.92	0.15	0.43	0.43	2.91	2.90	2.91	5
短期(1-3)	845	99.55	99.59	2.00	0.17	0.35	0.35	2.00	1.99	2.00	6
中期(3-7)	760	98.43	98.46	3.95	0.14	0.53	0.53	3.93	3.92	3.93	5
長期(7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
その他政保債	12,557	95.27	95.50	10.18	0.79	1.04	1.00	8.70	8.64	8.67	7
短期(1-3)	2,471	99.67	99.72	2.05	0.21	0.36	0.36	2.05	2.04	2.05	6
中期(3-7)	3,587	100.50	100.72	4.69	0.67	0.60	0.60	4.61	4.60	4.61	6
長期(7-)	6,499	90.71	91.02	16.30	1.07	1.60	1.51	13.98	13.86	13.91	8
SDGs	17,121	96.23	96.33	7.46	0.54	0.99	0.97	6.73	6.69	6.71	22

出所:NFRG

- 中期国債とは、2年国債・4年国債。
- 五大都市債とは、大阪市債・名古屋市債・京都市債・神戸市債・横浜市債。
- 特定金融債とは、格付会社4社の格付が翌月ポートフォリオ確定日において、すべてBBB格相当以下の金融債。ただし、金融債に格付が付されていない場合には、当該金融機関が発行する優先債に対する格付をもとに判断する。

事業債 業種別・ポートフォリオ指標 (1/4) (2024年6月末)

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
事業債 全体	69,215	95.67	95.84	7.50	0.71	1.13	1.09	6.40	6.35	6.37	38
短期 (1-3)	20,785	99.56	99.65	2.02	0.43	0.64	0.64	2.01	2.00	2.01	34
中期 (3-7)	24,930	98.76	98.92	4.70	0.67	0.93	0.92	4.61	4.59	4.61	38
長期 (7-)	23,500	88.96	89.20	15.33	1.01	1.85	1.73	12.85	12.73	12.75	41
長期 (7-11)	10,023	96.63	96.83	8.56	0.94	1.39	1.36	8.21	8.16	8.21	46
超長期 (11-)	13,477	83.26	83.53	20.37	1.06	2.25	2.05	16.84	16.67	16.67	37
水産・農林業	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
鉱業	30	96.08	96.13	5.24	0.21	0.92	0.90	5.14	5.11	5.14	33
短期 (1-3)	10	99.18	99.21	1.72	0.08	0.56	0.56	1.71	1.71	1.71	29
中期 (3-7)	10	95.15	95.24	6.71	0.30	1.08	1.05	6.64	6.61	6.64	35
長期 (7-)	10	93.91	93.96	7.30	0.25	1.16	1.12	7.23	7.19	7.23	36
長期 (7-11)	10	93.91	93.96	7.30	0.25	1.16	1.12	7.23	7.19	7.23	36
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
建設業	1,221	97.65	97.71	4.41	0.43	0.88	0.86	4.24	4.21	4.23	35
短期 (1-3)	424	99.25	99.29	2.02	0.24	0.60	0.60	2.01	2.01	2.01	30
中期 (3-7)	647	98.08	98.17	4.45	0.49	0.90	0.89	4.39	4.37	4.39	37
長期 (7-)	150	91.27	91.30	11.01	0.75	1.62	1.54	10.36	10.27	10.35	42
長期 (7-11)	84	95.61	95.66	8.54	0.78	1.36	1.34	8.26	8.21	8.26	44
超長期 (11-)	66	85.74	85.76	14.14	0.71	1.99	1.84	13.33	13.21	13.31	41
食料品	1,453	97.55	97.65	4.90	0.46	0.89	0.88	4.65	4.63	4.65	32
短期 (1-3)	617	99.30	99.35	2.10	0.26	0.58	0.57	2.09	2.08	2.09	27
中期 (3-7)	526	97.95	98.05	4.63	0.44	0.89	0.88	4.58	4.56	4.58	35
長期 (7-)	310	93.38	93.56	10.94	0.89	1.56	1.50	10.21	10.13	10.19	39
長期 (7-11)	190	96.66	96.80	8.80	0.88	1.31	1.29	8.47	8.41	8.46	36
超長期 (11-)	120	88.18	88.44	14.34	0.92	1.99	1.87	13.23	13.11	13.19	43
繊維製品	275	97.93	98.07	4.38	0.48	0.87	0.85	4.16	4.14	4.16	35
短期 (1-3)	70	99.53	99.61	1.42	0.23	0.51	0.51	1.41	1.41	1.41	29
中期 (3-7)	169	98.60	98.74	3.98	0.47	0.83	0.82	3.93	3.92	3.93	34
長期 (7-)	36	91.66	91.92	11.99	1.03	1.80	1.72	11.12	11.02	11.10	50
長期 (7-11)	16	98.40	98.52	9.41	1.29	1.49	1.47	8.87	8.81	8.87	48
超長期 (11-)	20	86.27	86.64	14.05	0.83	2.10	1.95	13.16	13.03	13.13	52
パルプ・紙	355	96.44	96.53	4.97	0.44	1.05	1.02	4.67	4.64	4.66	47
短期 (1-3)	145	99.13	99.18	1.95	0.29	0.72	0.72	1.94	1.93	1.94	43
中期 (3-7)	140	97.33	97.42	4.81	0.44	1.00	0.98	4.75	4.72	4.75	44
長期 (7-)	70	89.12	89.29	11.54	0.75	1.92	1.81	10.77	10.67	10.75	65
長期 (7-11)	35	92.92	92.98	7.92	0.62	1.69	1.64	7.72	7.66	7.72	80
超長期 (11-)	35	85.32	85.59	15.16	0.88	2.16	2.00	14.07	13.93	14.03	48
化学	2,136	95.42	95.50	5.81	0.48	1.12	1.08	5.37	5.33	5.37	46
短期 (1-3)	640	99.16	99.21	2.17	0.28	0.65	0.65	2.16	2.16	2.16	34
中期 (3-7)	903	97.52	97.60	4.69	0.44	0.97	0.96	4.63	4.61	4.63	42
長期 (7-)	593	88.18	88.31	11.44	0.74	1.92	1.79	10.51	10.41	10.49	66
長期 (7-11)	320	94.42	94.54	8.07	0.66	1.46	1.42	7.84	7.79	7.84	58
超長期 (11-)	273	80.87	81.00	15.40	0.83	2.55	2.30	14.16	13.99	14.11	79
医薬品	715	95.52	95.67	6.31	0.49	1.10	1.07	5.90	5.86	5.90	40
短期 (1-3)	175	99.45	99.53	2.03	0.30	0.57	0.57	2.02	2.02	2.02	27
中期 (3-7)	175	98.70	98.86	4.30	0.53	0.84	0.83	4.24	4.23	4.24	32
長期 (7-)	365	92.12	92.29	9.33	0.56	1.51	1.45	8.76	8.69	8.75	51
長期 (7-11)	265	93.99	94.09	7.35	0.43	1.33	1.29	7.23	7.18	7.23	52
超長期 (11-)	100	87.14	87.53	14.57	0.91	2.03	1.89	13.13	13.00	13.07	48

出所:NFRC

- 東証 33 業種分類を参考に NFRC で分類

事業債 業種別・ポートフォリオ指標 (1/4) (2024年6月末、7月ポートフォリオ)

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
事業債 全体	68,929	95.65	95.82	7.62	0.72	1.14	1.10	6.50	6.45	6.47	38
短期 (1-3)	20,424	99.54	99.64	2.11	0.44	0.65	0.65	2.10	2.09	2.10	34
中期 (3-7)	25,026	98.71	98.87	4.78	0.67	0.93	0.93	4.70	4.67	4.70	38
長期 (7-)	23,480	89.00	89.24	15.42	1.02	1.86	1.74	12.92	12.79	12.82	41
長期 (7-11)	10,019	96.70	96.90	8.67	0.97	1.41	1.38	8.30	8.25	8.30	47
超長期 (11-)	13,460	83.27	83.54	20.44	1.07	2.25	2.05	16.90	16.72	16.73	36
水産・農林業	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
鉱業	30	96.08	96.13	5.24	0.21	0.92	0.90	5.14	5.11	5.14	33
短期 (1-3)	10	99.18	99.21	1.72	0.08	0.56	0.56	1.71	1.71	1.71	29
中期 (3-7)	10	95.15	95.24	6.71	0.30	1.08	1.05	6.64	6.61	6.64	35
長期 (7-)	10	93.91	93.96	7.30	0.25	1.16	1.12	7.23	7.19	7.23	36
長期 (7-11)	10	93.91	93.96	7.30	0.25	1.16	1.12	7.23	7.19	7.23	36
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
建設業	1,176	97.57	97.63	4.54	0.44	0.89	0.88	4.36	4.34	4.36	36
短期 (1-3)	408	99.18	99.23	2.20	0.26	0.63	0.63	2.19	2.19	2.19	31
中期 (3-7)	618	98.04	98.12	4.51	0.49	0.90	0.89	4.45	4.43	4.45	37
長期 (7-)	150	91.27	91.30	11.01	0.75	1.62	1.54	10.36	10.27	10.35	42
長期 (7-11)	84	95.61	95.66	8.54	0.78	1.36	1.34	8.26	8.21	8.26	44
超長期 (11-)	66	85.74	85.76	14.14	0.71	1.99	1.84	13.33	13.21	13.31	41
食料品	1,418	97.49	97.58	5.00	0.46	0.90	0.89	4.74	4.72	4.74	32
短期 (1-3)	598	99.24	99.29	2.18	0.25	0.59	0.59	2.17	2.17	2.17	27
中期 (3-7)	510	97.92	98.02	4.68	0.44	0.90	0.89	4.63	4.60	4.63	35
長期 (7-)	310	93.38	93.56	10.94	0.89	1.56	1.50	10.21	10.13	10.19	39
長期 (7-11)	190	96.66	96.80	8.80	0.88	1.31	1.29	8.47	8.41	8.46	36
超長期 (11-)	120	88.18	88.44	14.34	0.92	1.99	1.87	13.23	13.11	13.19	43
繊維製品	235	97.61	97.76	4.94	0.52	0.94	0.93	4.70	4.68	4.70	37
短期 (1-3)	90	99.13	99.26	2.66	0.32	0.66	0.65	2.65	2.64	2.65	30
中期 (3-7)	109	98.31	98.44	4.50	0.52	0.92	0.91	4.44	4.42	4.44	38
長期 (7-)	36	91.66	91.92	11.99	1.03	1.80	1.72	11.12	11.02	11.10	50
長期 (7-11)	16	98.40	98.52	9.41	1.29	1.49	1.47	8.87	8.81	8.87	48
超長期 (11-)	20	86.27	86.64	14.05	0.83	2.10	1.95	13.16	13.03	13.13	52
パルプ・紙	340	96.30	96.39	5.14	0.45	1.08	1.05	4.83	4.80	4.83	48
短期 (1-3)	140	98.98	99.03	2.12	0.31	0.79	0.78	2.12	2.11	2.12	48
中期 (3-7)	130	97.29	97.37	4.95	0.44	0.98	0.97	4.88	4.86	4.88	41
長期 (7-)	70	89.12	89.29	11.54	0.75	1.92	1.81	10.77	10.67	10.75	65
長期 (7-11)	35	92.92	92.98	7.92	0.62	1.69	1.64	7.72	7.66	7.72	80
超長期 (11-)	35	85.32	85.59	15.16	0.88	2.16	2.00	14.07	13.93	14.03	48
化学	2,136	95.42	95.50	5.81	0.48	1.12	1.08	5.37	5.33	5.37	46
短期 (1-3)	645	99.16	99.21	2.18	0.28	0.66	0.65	2.17	2.16	2.17	34
中期 (3-7)	908	97.48	97.56	4.72	0.44	0.97	0.96	4.66	4.64	4.66	42
長期 (7-)	583	88.08	88.20	11.52	0.75	1.94	1.81	10.58	10.47	10.55	67
長期 (7-11)	310	94.43	94.55	8.10	0.68	1.47	1.43	7.87	7.82	7.87	58
超長期 (11-)	273	80.87	81.00	15.40	0.83	2.55	2.30	14.16	13.99	14.11	79
医薬品	715	95.52	95.67	6.31	0.49	1.10	1.07	5.90	5.86	5.90	40
短期 (1-3)	175	99.45	99.53	2.03	0.30	0.57	0.57	2.02	2.02	2.02	27
中期 (3-7)	175	98.70	98.86	4.30	0.53	0.84	0.83	4.24	4.23	4.24	32
長期 (7-)	365	92.12	92.29	9.33	0.56	1.51	1.45	8.76	8.69	8.75	51
長期 (7-11)	265	93.99	94.09	7.35	0.43	1.33	1.29	7.23	7.18	7.23	52
超長期 (11-)	100	87.14	87.53	14.57	0.91	2.03	1.89	13.13	13.00	13.07	48

出所:NFRC

- 東証 33 業種分類を参考に NFRC で分類

事業債 業種別・ポートフォリオ指標 (2/4) (2024年6月末)

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
石油・石炭製品	305	96.14	96.24	6.13	0.55	1.14	1.11	5.78	5.74	5.77	46
短期 (1-3)	70	99.38	99.45	1.58	0.20	0.57	0.57	1.58	1.57	1.58	33
中期 (3-7)	85	97.43	97.56	4.69	0.42	0.95	0.94	4.62	4.60	4.62	40
長期 (7-)	150	93.89	93.99	9.06	0.79	1.53	1.48	8.53	8.47	8.52	56
長期 (7-11)	125	95.36	95.45	7.75	0.72	1.39	1.36	7.54	7.48	7.53	55
超長期 (11-)	25	86.56	86.73	15.61	1.13	2.32	2.16	14.02	13.86	13.95	64
ゴム製品	330	98.02	98.10	4.03	0.39	0.86	0.85	3.96	3.94	3.96	37
短期 (1-3)	140	99.13	99.18	2.36	0.28	0.65	0.65	2.35	2.34	2.35	32
中期 (3-7)	160	97.56	97.64	4.74	0.41	0.94	0.93	4.69	4.67	4.69	38
長期 (7-)	30	95.30	95.47	8.08	0.74	1.39	1.36	7.83	7.77	7.82	52
長期 (7-11)	30	95.30	95.47	8.08	0.74	1.39	1.36	7.83	7.77	7.82	52
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
ガラス・土石製品	272	96.22	96.30	5.45	0.48	1.04	1.01	5.09	5.06	5.09	42
短期 (1-3)	98	99.30	99.33	2.02	0.26	0.60	0.60	2.01	2.00	2.01	31
中期 (3-7)	97	97.47	97.54	4.60	0.43	0.98	0.97	4.54	4.51	4.54	44
長期 (7-)	77	90.74	90.92	10.86	0.81	1.72	1.63	10.08	10.00	10.07	53
長期 (7-11)	52	95.51	95.64	8.72	0.82	1.40	1.37	8.41	8.36	8.41	45
超長期 (11-)	25	80.77	81.06	15.35	0.80	2.51	2.26	14.21	14.05	14.17	73
鉄鋼	470	98.17	98.25	4.13	0.50	0.90	0.89	4.00	3.98	4.00	41
短期 (1-3)	190	99.27	99.33	2.01	0.29	0.64	0.64	2.01	2.00	2.01	34
中期 (3-7)	217	98.09	98.16	4.44	0.53	0.95	0.94	4.38	4.36	4.38	42
長期 (7-)	63	95.14	95.32	9.46	1.02	1.56	1.52	8.90	8.83	8.89	54
長期 (7-11)	53	97.02	97.23	8.61	1.03	1.43	1.41	8.22	8.17	8.22	51
超長期 (11-)	10	85.19	85.23	13.96	0.95	2.36	2.19	13.01	12.87	12.98	77
非鉄金属	375	97.91	98.04	4.53	0.46	0.93	0.92	4.43	4.40	4.42	40
短期 (1-3)	120	98.95	99.01	2.31	0.25	0.71	0.71	2.30	2.29	2.30	38
中期 (3-7)	195	98.01	98.13	4.61	0.52	0.96	0.95	4.54	4.52	4.54	41
長期 (7-)	60	95.49	95.81	8.74	0.72	1.32	1.29	8.44	8.39	8.44	36
長期 (7-11)	60	95.49	95.81	8.74	0.72	1.32	1.29	8.44	8.39	8.44	36
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
金属製品	175	98.35	98.46	3.49	0.39	0.83	0.82	3.43	3.42	3.43	39
短期 (1-3)	60	99.34	99.40	1.64	0.22	0.60	0.60	1.63	1.63	1.63	35
中期 (3-7)	106	98.09	98.22	4.15	0.46	0.91	0.90	4.10	4.08	4.10	41
長期 (7-)	9	94.80	95.03	8.16	0.70	1.42	1.38	7.92	7.87	7.92	52
長期 (7-11)	9	94.80	95.03	8.16	0.70	1.42	1.38	7.92	7.87	7.92	52
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
機械	1,303	97.80	97.89	4.24	0.41	0.89	0.88	4.14	4.12	4.14	38
短期 (1-3)	521	99.19	99.25	2.05	0.26	0.65	0.64	2.04	2.04	2.04	35
中期 (3-7)	549	97.57	97.67	4.64	0.44	0.95	0.94	4.58	4.56	4.58	40
長期 (7-)	233	95.25	95.41	8.18	0.65	1.31	1.28	7.95	7.90	7.95	42
長期 (7-11)	233	95.25	95.41	8.18	0.65	1.31	1.28	7.95	7.90	7.95	42
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
電気機器	2,175	98.37	98.48	4.17	0.49	0.87	0.86	4.07	4.05	4.07	37
短期 (1-3)	780	99.43	99.50	1.92	0.30	0.60	0.60	1.92	1.91	1.92	31
中期 (3-7)	1,130	98.01	98.13	4.62	0.50	0.93	0.92	4.56	4.53	4.56	39
長期 (7-)	265	96.76	97.02	8.88	1.00	1.43	1.41	8.48	8.42	8.48	47
長期 (7-11)	265	96.76	97.02	8.88	1.00	1.43	1.41	8.48	8.42	8.48	47
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
輸送用機器	1,097	97.15	97.25	4.60	0.40	0.92	0.91	4.39	4.37	4.39	38
短期 (1-3)	525	99.07	99.14	2.17	0.27	0.69	0.69	2.16	2.15	2.16	38
中期 (3-7)	363	97.65	97.74	4.75	0.42	0.91	0.90	4.68	4.66	4.68	36
長期 (7-)	209	91.47	91.62	10.47	0.68	1.58	1.51	9.93	9.86	9.92	43
長期 (7-11)	119	95.55	95.64	8.49	0.69	1.29	1.27	8.23	8.18	8.23	37
超長期 (11-)	90	86.08	86.29	13.10	0.67	2.00	1.86	12.43	12.31	12.41	51

出所:NFRC

- 東証 33 業種分類を参考に NFRC で分類

事業債 業種別・ポートフォリオ指標 (2/4) (2024年6月末、7月ポートフォリオ)

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
石油・石炭製品	295	96.02	96.12	6.30	0.56	1.16	1.14	5.95	5.90	5.94	47
短期 (1-3)	70	99.30	99.39	1.87	0.24	0.61	0.61	1.86	1.85	1.86	34
中期 (3-7)	105	96.30	96.42	5.52	0.39	1.06	1.04	5.43	5.40	5.43	43
長期 (7-)	120	93.85	93.94	9.56	0.90	1.60	1.55	8.93	8.86	8.91	58
長期 (7-11)	95	95.77	95.84	7.97	0.84	1.43	1.40	7.72	7.66	7.71	57
超長期 (11-)	25	86.56	86.73	15.61	1.13	2.32	2.16	14.02	13.86	13.95	64
ゴム製品	330	98.02	98.10	4.03	0.39	0.86	0.85	3.96	3.94	3.96	37
短期 (1-3)	140	99.13	99.18	2.36	0.28	0.65	0.65	2.35	2.34	2.35	32
中期 (3-7)	160	97.56	97.64	4.74	0.41	0.94	0.93	4.69	4.67	4.69	38
長期 (7-)	30	95.30	95.47	8.08	0.74	1.39	1.36	7.83	7.77	7.82	52
長期 (7-11)	30	95.30	95.47	8.08	0.74	1.39	1.36	7.83	7.77	7.82	52
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
ガラス・土石製品	272	96.22	96.30	5.45	0.48	1.04	1.01	5.09	5.06	5.09	42
短期 (1-3)	98	99.30	99.33	2.02	0.26	0.60	0.60	2.01	2.00	2.01	31
中期 (3-7)	97	97.47	97.54	4.60	0.43	0.98	0.97	4.54	4.51	4.54	44
長期 (7-)	77	90.74	90.92	10.86	0.81	1.72	1.63	10.08	10.00	10.07	53
長期 (7-11)	52	95.51	95.64	8.72	0.82	1.40	1.37	8.41	8.36	8.41	45
超長期 (11-)	25	80.77	81.06	15.35	0.80	2.51	2.26	14.21	14.05	14.17	73
鉄鋼	440	98.06	98.14	4.34	0.52	0.93	0.92	4.20	4.18	4.20	41
短期 (1-3)	160	99.18	99.23	2.20	0.30	0.67	0.67	2.19	2.18	2.19	35
中期 (3-7)	217	98.09	98.16	4.44	0.53	0.95	0.94	4.38	4.36	4.38	42
長期 (7-)	63	95.14	95.32	9.46	1.02	1.56	1.52	8.90	8.83	8.89	54
長期 (7-11)	53	97.02	97.23	8.61	1.03	1.43	1.41	8.22	8.17	8.22	51
超長期 (11-)	10	85.19	85.23	13.96	0.95	2.36	2.19	13.01	12.87	12.98	77
非鉄金属	375	97.91	98.04	4.53	0.46	0.93	0.92	4.43	4.40	4.42	40
短期 (1-3)	130	98.95	99.02	2.36	0.27	0.73	0.72	2.35	2.34	2.35	39
中期 (3-7)	185	97.96	98.07	4.69	0.52	0.96	0.95	4.62	4.60	4.62	41
長期 (7-)	60	95.49	95.81	8.74	0.72	1.32	1.29	8.44	8.39	8.44	36
長期 (7-11)	60	95.49	95.81	8.74	0.72	1.32	1.29	8.44	8.39	8.44	36
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
金属製品	150	98.13	98.24	3.90	0.42	0.88	0.87	3.84	3.82	3.84	40
短期 (1-3)	35	99.10	99.13	2.06	0.23	0.67	0.67	2.06	2.05	2.06	37
中期 (3-7)	106	98.09	98.22	4.15	0.46	0.91	0.90	4.10	4.08	4.10	41
長期 (7-)	9	94.80	95.03	8.16	0.70	1.42	1.38	7.92	7.87	7.92	52
長期 (7-11)	9	94.80	95.03	8.16	0.70	1.42	1.38	7.92	7.87	7.92	52
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
機械	1,278	97.77	97.86	4.30	0.41	0.89	0.88	4.20	4.18	4.20	38
短期 (1-3)	496	99.17	99.22	2.10	0.26	0.65	0.65	2.09	2.09	2.09	35
中期 (3-7)	549	97.57	97.67	4.64	0.44	0.95	0.94	4.58	4.56	4.58	40
長期 (7-)	233	95.25	95.41	8.18	0.65	1.31	1.28	7.95	7.90	7.95	42
長期 (7-11)	233	95.25	95.41	8.18	0.65	1.31	1.28	7.95	7.90	7.95	42
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
電気機器	2,075	98.30	98.42	4.32	0.50	0.89	0.88	4.22	4.20	4.22	37
短期 (1-3)	770	99.34	99.42	2.17	0.33	0.63	0.63	2.16	2.15	2.16	32
中期 (3-7)	1,040	97.92	98.04	4.76	0.51	0.95	0.94	4.69	4.67	4.69	39
長期 (7-)	265	96.76	97.02	8.88	1.00	1.43	1.41	8.48	8.42	8.48	47
長期 (7-11)	265	96.76	97.02	8.88	1.00	1.43	1.41	8.48	8.42	8.48	47
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
輸送用機器	1,087	97.12	97.21	4.64	0.39	0.93	0.91	4.43	4.40	4.42	38
短期 (1-3)	515	99.04	99.11	2.19	0.25	0.70	0.69	2.18	2.17	2.18	38
中期 (3-7)	373	97.54	97.64	4.81	0.42	0.92	0.91	4.74	4.72	4.74	36
長期 (7-)	199	91.36	91.51	10.65	0.70	1.60	1.52	10.09	10.01	10.08	42
長期 (7-11)	109	95.72	95.81	8.62	0.73	1.30	1.27	8.35	8.30	8.34	36
超長期 (11-)	90	86.08	86.29	13.10	0.67	2.00	1.86	12.43	12.31	12.41	51

出所:NFRG

- 東証 33 業種分類を参考に NFRG で分類

事業債 業種別・ポートフォリオ指標 (3/4) (2024年6月末)

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
精密機器	265	98.11	98.22	4.36	0.55	0.94	0.93	4.24	4.22	4.24	43
短期 (1-3)	105	99.56	99.63	2.09	0.36	0.60	0.59	2.08	2.07	2.08	30
中期 (3-7)	125	97.57	97.69	5.13	0.60	1.07	1.06	5.05	5.02	5.05	49
長期 (7-)	35	95.72	95.91	8.38	0.97	1.56	1.53	8.04	7.98	8.04	65
長期 (7-11)	35	95.72	95.91	8.38	0.97	1.56	1.53	8.04	7.98	8.04	65
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
その他製品	200	94.94	95.05	6.73	0.47	1.10	1.06	6.26	6.22	6.26	36
短期 (1-3)	40	99.26	99.33	1.62	0.21	0.61	0.61	1.61	1.61	1.61	37
中期 (3-7)	100	97.82	97.91	5.21	0.49	0.93	0.92	5.14	5.12	5.14	34
長期 (7-)	60	87.26	87.44	12.69	0.61	1.76	1.64	11.89	11.79	11.87	37
長期 (7-11)	15	96.27	96.44	7.19	0.55	1.11	1.09	7.04	7.01	7.04	34
超長期 (11-)	45	84.25	84.44	14.53	0.63	2.01	1.85	13.73	13.61	13.71	38
電気・ガス業	12,328	94.66	94.83	8.01	0.77	1.30	1.25	7.02	6.96	7.00	47
短期 (1-3)	2,817	99.58	99.68	2.08	0.46	0.65	0.65	2.06	2.06	2.06	35
中期 (3-7)	4,160	98.30	98.47	4.92	0.73	1.06	1.05	4.82	4.79	4.82	50
長期 (7-)	5,351	89.24	89.46	13.54	0.97	1.88	1.77	11.81	11.70	11.76	52
長期 (7-11)	2,494	95.90	96.11	8.65	0.94	1.49	1.46	8.28	8.22	8.28	55
超長期 (11-)	2,857	83.42	83.65	17.81	0.99	2.28	2.09	15.36	15.19	15.26	50
陸運業	5,919	90.19	90.47	13.53	1.01	1.50	1.39	10.29	10.19	10.18	34
短期 (1-3)	759	100.46	100.66	1.97	0.76	0.57	0.57	1.96	1.95	1.96	28
中期 (3-7)	1,587	100.79	101.08	5.13	1.11	0.88	0.89	4.98	4.96	4.98	31
長期 (7-)	3,573	83.30	83.59	19.71	1.01	2.07	1.87	15.27	15.11	15.08	36
長期 (7-11)	1,000	98.72	99.03	8.81	1.11	1.28	1.27	8.37	8.32	8.37	34
超長期 (11-)	2,573	77.31	77.60	23.95	0.98	2.47	2.16	18.70	18.49	18.40	37
海運業	141	98.84	99.07	4.92	0.88	1.05	1.05	4.76	4.73	4.76	49
短期 (1-3)	25	101.11	101.21	1.84	1.26	0.70	0.70	1.82	1.81	1.82	42
中期 (3-7)	86	98.23	98.43	4.50	0.59	1.00	0.99	4.44	4.42	4.44	47
長期 (7-)	30	98.71	99.14	8.69	1.41	1.51	1.50	8.16	8.10	8.15	59
長期 (7-11)	30	98.71	99.14	8.69	1.41	1.51	1.50	8.16	8.10	8.15	59
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
空運業	235	91.70	91.79	7.45	0.72	1.65	1.56	6.62	6.55	6.61	80
短期 (1-3)	90	99.37	99.47	2.13	0.65	0.96	0.95	2.12	2.11	2.12	64
中期 (3-7)	40	95.77	95.82	4.86	0.36	1.27	1.24	4.81	4.78	4.81	69
長期 (7-)	105	83.58	83.67	12.99	0.92	2.53	2.31	12.00	11.86	11.98	100
長期 (7-11)	20	96.26	96.29	8.97	1.20	1.68	1.65	8.52	8.45	8.51	71
超長期 (11-)	85	80.59	80.70	13.94	0.86	2.77	2.50	12.98	12.82	12.95	108
倉庫・運輸関連業	124	95.08	95.20	6.92	0.58	1.24	1.20	6.50	6.46	6.50	47
短期 (1-3)	12	99.89	99.91	1.40	0.42	0.52	0.52	1.40	1.39	1.40	29
中期 (3-7)	75	96.77	96.87	5.19	0.44	1.09	1.07	5.11	5.09	5.11	49
長期 (7-)	37	90.02	90.24	12.30	0.93	1.84	1.74	11.42	11.32	11.41	49
長期 (7-11)	17	97.29	97.63	9.51	1.18	1.50	1.48	8.99	8.93	8.98	48
超長期 (11-)	20	84.01	84.14	14.59	0.72	2.16	1.98	13.75	13.62	13.72	51
情報・通信業	2,179	96.72	96.93	4.57	0.86	1.45	1.41	4.23	4.19	4.22	90
短期 (1-3)	841	99.27	99.42	1.90	0.62	0.99	0.99	1.88	1.87	1.88	71
中期 (3-7)	970	97.43	97.65	4.66	0.89	1.44	1.42	4.54	4.51	4.54	88
長期 (7-)	368	88.98	89.31	10.46	1.34	2.64	2.48	9.30	9.18	9.28	144
長期 (7-11)	250	92.77	93.08	8.48	1.16	2.18	2.10	8.03	7.94	8.02	121
超長期 (11-)	118	80.94	81.28	14.66	1.73	3.76	3.40	12.41	12.20	12.34	198
卸売業	1,257	97.73	97.96	6.59	0.90	1.10	1.08	6.20	6.16	6.20	38
短期 (1-3)	178	100.74	100.92	2.08	1.01	0.65	0.65	2.06	2.05	2.06	35
中期 (3-7)	600	99.36	99.59	4.86	0.80	0.94	0.94	4.76	4.73	4.76	39
長期 (7-)	479	94.58	94.82	10.44	0.98	1.49	1.44	9.73	9.66	9.72	37
長期 (7-11)	334	98.19	98.42	8.76	1.04	1.27	1.26	8.36	8.31	8.35	34
超長期 (11-)	145	86.26	86.54	14.32	0.82	2.06	1.92	13.34	13.21	13.31	47

出所:NFRC

- 東証 33 業種分類を参考に NFRC で分類

事業債 業種別・ポートフォリオ指標 (3/4) (2024年6月末、7月ポートフォリオ)

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
精密機器	240	97.94	98.05	4.70	0.58	0.99	0.98	4.58	4.55	4.58	44
短期 (1-3)	80	99.50	99.57	2.41	0.39	0.63	0.62	2.40	2.39	2.40	29
中期 (3-7)	125	97.57	97.69	5.13	0.60	1.07	1.06	5.05	5.02	5.05	49
長期 (7-)	35	95.72	95.91	8.38	0.97	1.56	1.53	8.04	7.98	8.04	65
長期 (7-11)	35	95.72	95.91	8.38	0.97	1.56	1.53	8.04	7.98	8.04	65
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
その他製品	175	94.26	94.38	7.55	0.51	1.18	1.14	7.06	7.01	7.05	36
短期 (1-3)	15	98.55	98.56	2.61	0.20	0.78	0.77	2.60	2.59	2.60	41
中期 (3-7)	100	97.82	97.91	5.21	0.49	0.93	0.92	5.14	5.12	5.14	34
長期 (7-)	60	87.26	87.44	12.69	0.61	1.76	1.64	11.89	11.79	11.87	37
長期 (7-11)	15	96.27	96.44	7.19	0.55	1.11	1.09	7.04	7.01	7.04	34
超長期 (11-)	45	84.25	84.44	14.53	0.63	2.01	1.85	13.73	13.61	13.71	38
電気・ガス業	12,218	94.59	94.77	8.23	0.79	1.32	1.27	7.21	7.16	7.19	47
短期 (1-3)	2,665	99.54	99.63	2.22	0.46	0.67	0.66	2.21	2.20	2.21	35
中期 (3-7)	4,100	98.25	98.42	5.00	0.73	1.07	1.06	4.89	4.87	4.89	50
長期 (7-)	5,453	89.43	89.65	13.59	0.99	1.88	1.77	11.85	11.73	11.79	52
長期 (7-11)	2,640	95.93	96.15	8.78	0.97	1.50	1.48	8.39	8.33	8.39	55
超長期 (11-)	2,813	83.33	83.54	18.09	1.00	2.29	2.10	15.58	15.41	15.47	49
陸運業	5,909	90.18	90.45	13.62	1.02	1.51	1.40	10.38	10.28	10.27	34
短期 (1-3)	714	100.48	100.69	2.07	0.80	0.59	0.59	2.06	2.05	2.06	29
中期 (3-7)	1,627	100.77	101.05	5.19	1.11	0.89	0.89	5.03	5.01	5.03	32
長期 (7-)	3,568	83.28	83.57	19.78	1.02	2.08	1.87	15.34	15.18	15.14	36
長期 (7-11)	1,005	98.70	99.01	8.94	1.12	1.29	1.28	8.48	8.43	8.48	34
超長期 (11-)	2,563	77.24	77.52	24.03	0.98	2.47	2.17	18.77	18.56	18.47	37
海運業	163	98.83	99.05	5.34	0.92	1.09	1.08	5.15	5.12	5.15	48
短期 (1-3)	20	101.42	101.50	2.03	1.46	0.72	0.72	2.01	2.00	2.01	42
中期 (3-7)	103	98.41	98.60	4.57	0.63	1.00	0.99	4.50	4.48	4.50	46
長期 (7-)	40	98.62	98.97	8.99	1.38	1.51	1.50	8.44	8.38	8.43	56
長期 (7-11)	40	98.62	98.97	8.99	1.38	1.51	1.50	8.44	8.38	8.43	56
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
空運業	315	93.52	93.63	8.31	0.98	1.71	1.64	7.48	7.41	7.47	79
短期 (1-3)	90	99.37	99.47	2.13	0.65	0.96	0.95	2.12	2.11	2.12	64
中期 (3-7)	40	95.77	95.82	4.86	0.36	1.27	1.24	4.81	4.78	4.81	69
長期 (7-)	185	90.19	90.31	12.06	1.28	2.22	2.10	10.97	10.85	10.94	88
長期 (7-11)	85	98.34	98.47	9.68	1.53	1.74	1.72	9.01	8.94	9.00	71
超長期 (11-)	100	83.26	83.38	14.08	1.07	2.71	2.48	12.92	12.76	12.89	106
倉庫・運輸関連業	124	95.08	95.20	6.92	0.58	1.24	1.20	6.50	6.46	6.50	47
短期 (1-3)	12	99.89	99.91	1.40	0.42	0.52	0.52	1.40	1.39	1.40	29
中期 (3-7)	75	96.77	96.87	5.19	0.44	1.09	1.07	5.11	5.09	5.11	49
長期 (7-)	37	90.02	90.24	12.30	0.93	1.84	1.74	11.42	11.32	11.41	49
長期 (7-11)	17	97.29	97.63	9.51	1.18	1.50	1.48	8.99	8.93	8.98	48
超長期 (11-)	20	84.01	84.14	14.59	0.72	2.16	1.98	13.75	13.62	13.72	51
情報・通信業	2,159	96.69	96.90	4.73	0.89	1.48	1.44	4.38	4.34	4.38	91
短期 (1-3)	781	99.21	99.36	2.06	0.65	1.03	1.03	2.04	2.03	2.04	73
中期 (3-7)	1,040	97.41	97.62	4.78	0.91	1.45	1.43	4.65	4.61	4.65	88
長期 (7-)	338	88.66	88.99	10.76	1.40	2.72	2.55	9.52	9.40	9.50	148
長期 (7-11)	220	92.78	93.10	8.67	1.23	2.23	2.15	8.18	8.09	8.17	124
超長期 (11-)	118	80.94	81.28	14.66	1.73	3.76	3.40	12.41	12.20	12.34	198
卸売業	1,257	97.73	97.96	6.59	0.90	1.10	1.08	6.20	6.16	6.20	38
短期 (1-3)	198	100.57	100.75	2.18	0.94	0.65	0.65	2.16	2.15	2.16	34
中期 (3-7)	605	99.49	99.73	5.01	0.84	0.96	0.95	4.90	4.87	4.90	39
長期 (7-)	454	94.16	94.39	10.63	0.95	1.51	1.46	9.92	9.84	9.90	37
長期 (7-11)	309	97.87	98.07	8.90	1.02	1.29	1.27	8.50	8.44	8.49	33
超長期 (11-)	145	86.26	86.54	14.32	0.82	2.06	1.92	13.34	13.21	13.31	47

出所:NFRC

- 東証 33 業種分類を参考に NFRC で分類

事業債 業種別・ポートフォリオ指標 (4/4) (2024年6月末)

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
小売業	1,209	98.61	98.70	4.10	0.56	0.86	0.86	3.95	3.93	3.95	37
短期 (1-3)	484	99.55	99.60	1.78	0.35	0.57	0.57	1.77	1.77	1.77	30
中期 (3-7)	548	98.75	98.87	4.30	0.60	0.92	0.91	4.24	4.22	4.24	41
長期 (7-)	177	95.57	95.73	9.86	1.03	1.52	1.48	9.27	9.20	9.26	46
長期 (7-11)	137	97.85	98.06	8.66	1.07	1.39	1.37	8.27	8.21	8.26	46
超長期 (11-)	40	87.75	87.77	13.93	0.88	2.01	1.88	13.07	12.95	13.05	46
銀行業	1,377	100.27	100.49	3.43	1.23	1.05	1.05	3.34	3.32	3.34	63
短期 (1-3)	687	101.09	101.34	1.99	1.44	0.93	0.94	1.96	1.95	1.96	65
中期 (3-7)	672	99.55	99.74	4.77	1.02	1.16	1.16	4.64	4.62	4.64	62
長期 (7-)	18	96.20	96.27	8.68	0.83	1.32	1.29	8.38	8.32	8.37	38
長期 (7-11)	18	96.20	96.27	8.68	0.83	1.32	1.29	8.38	8.32	8.37	38
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
証券、商品先物取引業	1,083	99.35	99.52	2.43	0.88	1.09	1.08	2.40	2.38	2.40	75
短期 (1-3)	805	99.57	99.74	1.90	0.87	1.03	1.03	1.89	1.88	1.89	75
中期 (3-7)	274	98.79	98.98	3.90	0.90	1.23	1.22	3.83	3.81	3.83	75
長期 (7-)	5	93.18	93.46	8.18	0.90	1.86	1.80	7.87	7.80	7.87	94
長期 (7-11)	5	93.18	93.46	8.18	0.90	1.86	1.80	7.87	7.80	7.87	94
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
保険業	335	98.15	98.22	3.70	0.38	0.86	0.85	3.63	3.61	3.63	40
短期 (1-3)	155	98.83	98.86	2.34	0.19	0.70	0.70	2.33	2.33	2.33	37
中期 (3-7)	130	98.66	98.75	3.57	0.45	0.84	0.83	3.54	3.52	3.54	39
長期 (7-)	50	94.74	94.89	8.30	0.75	1.46	1.42	8.04	7.98	8.04	55
長期 (7-11)	50	94.74	94.89	8.30	0.75	1.46	1.42	8.04	7.98	8.04	55
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
その他金融業	6,056	98.14	98.22	3.92	0.44	0.87	0.86	3.81	3.79	3.81	40
短期 (1-3)	2,772	99.24	99.30	2.00	0.31	0.69	0.68	2.00	1.99	2.00	39
中期 (3-7)	2,599	98.02	98.12	4.62	0.50	0.93	0.92	4.56	4.54	4.56	38
長期 (7-)	686	94.17	94.28	8.98	0.75	1.47	1.42	8.57	8.51	8.56	49
長期 (7-11)	608	95.43	95.55	8.29	0.72	1.37	1.33	8.04	7.99	8.04	46
超長期 (11-)	78	84.28	84.43	14.37	0.96	2.42	2.23	13.24	13.09	13.20	78
不動産業	2,602	94.85	95.02	7.73	0.71	1.25	1.20	6.70	6.64	6.67	46
短期 (1-3)	464	99.42	99.52	2.11	0.40	0.69	0.69	2.10	2.09	2.10	39
中期 (3-7)	1,103	98.08	98.23	4.65	0.59	0.98	0.97	4.57	4.55	4.57	44
長期 (7-)	1,036	89.38	89.60	13.53	0.98	1.84	1.73	11.46	11.35	11.39	52
長期 (7-11)	563	96.55	96.74	8.63	0.97	1.42	1.39	8.27	8.21	8.26	49
超長期 (11-)	473	80.84	81.09	19.36	1.00	2.45	2.21	16.00	15.82	15.84	58
サービス業	787	90.35	90.44	4.94	0.57	2.15	1.93	4.38	4.32	4.38	141
短期 (1-3)	280	98.31	98.37	1.76	0.29	1.08	1.06	1.75	1.74	1.75	80
中期 (3-7)	297	96.37	96.49	4.76	0.44	1.23	1.19	4.69	4.67	4.69	64
長期 (7-)	210	71.21	71.30	9.44	1.14	5.92	4.97	8.64	8.43	8.63	400
長期 (7-11)	160	74.07	74.15	8.32	1.04	5.59	4.79	7.84	7.66	7.84	393
超長期 (11-)	50	62.06	62.19	13.00	1.45	7.19	5.65	11.70	11.39	11.66	430
財投機関債	20,432	95.55	95.75	9.50	0.78	1.06	1.01	7.86	7.80	7.80	17
短期 (1-3)	5,687	99.75	99.84	2.04	0.34	0.46	0.46	2.03	2.02	2.03	16
中期 (3-7)	6,094	100.06	100.25	4.63	0.72	0.69	0.69	4.54	4.52	4.54	16
長期 (7-)	8,652	89.62	89.90	17.84	1.12	1.78	1.67	14.72	14.58	14.58	19
長期 (7-11)	2,422	99.44	99.65	8.66	1.01	1.09	1.08	8.28	8.23	8.27	17
超長期 (11-)	6,230	85.81	86.12	21.41	1.16	2.09	1.94	17.62	17.44	17.43	19

出所:NFRG

- 東証 33 業種分類を参考に NFRG で分類
- 財投機関債には、交通債券・放送債券を含む

事業債 業種別・ポートフォリオ指標 (4/4) (2024年6月末、7月ポートフォリオ)

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
小売業	1,199	98.59	98.68	4.13	0.56	0.87	0.86	3.98	3.96	3.98	37
短期 (1-3)	474	99.53	99.57	1.79	0.34	0.58	0.57	1.79	1.78	1.79	30
中期 (3-7)	548	98.75	98.87	4.30	0.60	0.92	0.91	4.24	4.22	4.24	41
長期 (7-)	177	95.57	95.73	9.86	1.03	1.52	1.48	9.27	9.20	9.26	46
長期 (7-11)	137	97.85	98.06	8.66	1.07	1.39	1.37	8.27	8.21	8.26	46
超長期 (11-)	40	87.75	87.77	13.93	0.88	2.01	1.88	13.07	12.95	13.05	46
銀行業	1,337	100.29	100.51	3.51	1.26	1.06	1.06	3.41	3.39	3.41	63
短期 (1-3)	667	101.20	101.47	2.07	1.51	0.94	0.95	2.04	2.04	2.04	65
中期 (3-7)	652	99.47	99.65	4.83	1.01	1.17	1.17	4.70	4.67	4.70	62
長期 (7-)	18	96.20	96.27	8.68	0.83	1.32	1.29	8.38	8.32	8.37	38
長期 (7-11)	18	96.20	96.27	8.68	0.83	1.32	1.29	8.38	8.32	8.37	38
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
証券、商品先物取引業	1,031	99.32	99.48	2.50	0.87	1.09	1.08	2.47	2.45	2.47	74
短期 (1-3)	775	99.54	99.70	1.99	0.87	1.04	1.04	1.97	1.96	1.97	75
中期 (3-7)	252	98.74	98.90	3.97	0.87	1.21	1.20	3.91	3.88	3.90	72
長期 (7-)	5	93.18	93.46	8.18	0.90	1.86	1.80	7.87	7.80	7.87	94
長期 (7-11)	5	93.18	93.46	8.18	0.90	1.86	1.80	7.87	7.80	7.87	94
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
保険業	335	98.15	98.22	3.70	0.38	0.86	0.85	3.63	3.61	3.63	40
短期 (1-3)	165	98.84	98.87	2.38	0.20	0.70	0.70	2.38	2.37	2.38	36
中期 (3-7)	120	98.64	98.72	3.61	0.46	0.84	0.84	3.58	3.56	3.58	39
長期 (7-)	50	94.74	94.89	8.30	0.75	1.46	1.42	8.04	7.98	8.04	55
長期 (7-11)	50	94.74	94.89	8.30	0.75	1.46	1.42	8.04	7.98	8.04	55
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
その他金融業	6,150	98.17	98.25	3.96	0.45	0.88	0.87	3.85	3.83	3.85	40
短期 (1-3)	2,833	99.23	99.30	2.06	0.31	0.69	0.69	2.05	2.05	2.05	39
中期 (3-7)	2,652	98.02	98.12	4.71	0.52	0.94	0.93	4.64	4.62	4.64	39
長期 (7-)	666	94.23	94.35	9.06	0.77	1.48	1.42	8.64	8.57	8.63	48
長期 (7-11)	588	95.55	95.66	8.36	0.74	1.36	1.33	8.10	8.04	8.09	45
超長期 (11-)	78	84.28	84.43	14.37	0.96	2.42	2.23	13.24	13.09	13.20	78
不動産業	2,602	94.85	95.01	7.83	0.73	1.26	1.21	6.80	6.74	6.77	46
短期 (1-3)	529	99.33	99.44	2.34	0.41	0.71	0.71	2.33	2.32	2.33	38
中期 (3-7)	1,023	97.94	98.09	4.83	0.61	1.01	1.00	4.75	4.72	4.75	45
長期 (7-)	1,051	89.58	89.80	13.52	1.00	1.84	1.72	11.46	11.36	11.40	51
長期 (7-11)	578	96.73	96.92	8.74	1.00	1.41	1.39	8.36	8.30	8.35	47
超長期 (11-)	473	80.84	81.09	19.36	1.00	2.45	2.21	16.00	15.82	15.84	58
サービス業	737	89.71	89.80	5.21	0.60	2.28	2.05	4.64	4.57	4.64	150
短期 (1-3)	240	98.04	98.08	1.97	0.30	1.19	1.18	1.95	1.94	1.95	89
中期 (3-7)	287	96.28	96.39	4.82	0.45	1.25	1.21	4.75	4.73	4.75	66
長期 (7-)	210	71.21	71.30	9.44	1.14	5.92	4.97	8.64	8.43	8.63	400
長期 (7-11)	160	74.07	74.15	8.32	1.04	5.59	4.79	7.84	7.66	7.84	393
超長期 (11-)	50	62.06	62.19	13.00	1.45	7.19	5.65	11.70	11.39	11.66	430
財投機関債	20,628	95.59	95.79	9.49	0.79	1.06	1.01	7.86	7.80	7.81	17
短期 (1-3)	5,687	99.78	99.87	2.06	0.35	0.46	0.46	2.05	2.05	2.05	16
中期 (3-7)	6,387	99.92	100.10	4.71	0.70	0.70	0.70	4.62	4.60	4.62	16
長期 (7-)	8,554	89.58	89.86	18.00	1.14	1.79	1.68	14.84	14.70	14.71	19
長期 (7-11)	2,302	99.69	99.91	8.77	1.06	1.10	1.09	8.36	8.32	8.36	17
超長期 (11-)	6,252	85.85	86.16	21.40	1.16	2.09	1.93	17.61	17.43	17.42	19

出所:NFRC

- 東証 33 業種分類を参考に NFRC で分類
- 財投機関債には、交通債券・放送債券を含む

事業債 円建外債 格付別・ポートフォリオ指標(2024年6月末)

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
AAA~AA 格	51,383	95.49	95.66	8.12	0.71	1.08	1.04	6.78	6.73	6.74	30
短期 (1-3)	15,272	99.65	99.74	2.04	0.41	0.58	0.58	2.03	2.03	2.03	28
中期 (3-7)	17,768	99.09	99.24	4.69	0.67	0.85	0.84	4.61	4.59	4.61	31
長期 (7-)	18,344	88.55	88.79	16.49	1.00	1.80	1.68	13.58	13.45	13.46	30
長期 (7-11)	7,119	97.37	97.56	8.56	0.89	1.25	1.23	8.22	8.17	8.22	33
超長期 (11-)	11,225	82.95	83.23	21.53	1.07	2.21	2.02	17.56	17.38	17.37	28
AAA~A 格	72,305	95.81	95.98	7.34	0.73	1.13	1.10	6.28	6.23	6.25	40
短期 (1-3)	22,340	99.57	99.67	2.03	0.46	0.67	0.67	2.02	2.01	2.02	37
中期 (3-7)	26,189	98.75	98.92	4.67	0.68	0.94	0.94	4.58	4.56	4.58	40
長期 (7-)	23,777	89.05	89.29	15.28	1.02	1.86	1.74	12.81	12.69	12.71	42
長期 (7-11)	10,174	96.62	96.83	8.56	0.94	1.40	1.37	8.21	8.15	8.20	47
超長期 (11-)	13,603	83.38	83.66	20.31	1.08	2.26	2.06	16.79	16.61	16.62	38
AAA~BBB 格	72,305	95.81	95.98	7.34	0.73	1.13	1.10	6.28	6.23	6.25	40
短期 (1-3)	22,340	99.57	99.67	2.03	0.46	0.67	0.67	2.02	2.01	2.02	37
中期 (3-7)	26,189	98.75	98.92	4.67	0.68	0.94	0.94	4.58	4.56	4.58	40
長期 (7-)	23,777	89.05	89.29	15.28	1.02	1.86	1.74	12.81	12.69	12.71	42
長期 (7-11)	10,174	96.62	96.83	8.56	0.94	1.40	1.37	8.21	8.15	8.20	47
超長期 (11-)	13,603	83.38	83.66	20.31	1.08	2.26	2.06	16.79	16.61	16.62	38
AAA~BB 格	72,305	95.81	95.98	7.34	0.73	1.13	1.10	6.28	6.23	6.25	40
短期 (1-3)	22,340	99.57	99.67	2.03	0.46	0.67	0.67	2.02	2.01	2.02	37
中期 (3-7)	26,189	98.75	98.92	4.67	0.68	0.94	0.94	4.58	4.56	4.58	40
長期 (7-)	23,777	89.05	89.29	15.28	1.02	1.86	1.74	12.81	12.69	12.71	42
長期 (7-11)	10,174	96.62	96.83	8.56	0.94	1.40	1.37	8.21	8.15	8.20	47
超長期 (11-)	13,603	83.38	83.66	20.31	1.08	2.26	2.06	16.79	16.61	16.62	38
AAA 格	10,900	96.96	97.04	5.58	0.38	0.77	0.75	4.80	4.77	4.78	20
短期 (1-3)	4,380	99.34	99.37	1.99	0.16	0.49	0.48	1.99	1.99	1.99	19
中期 (3-7)	4,550	98.48	98.58	4.58	0.42	0.74	0.73	4.53	4.51	4.52	20
長期 (7-)	1,970	88.17	88.33	15.85	0.80	1.60	1.47	12.55	12.44	12.42	24
長期 (7-11)	1,168	96.44	96.55	8.35	0.65	1.13	1.11	8.12	8.07	8.11	23
超長期 (11-)	802	76.12	76.36	26.76	1.02	2.46	2.14	20.71	20.48	20.36	24
AA 格	40,484	95.10	95.29	8.80	0.80	1.17	1.12	7.33	7.27	7.28	32
短期 (1-3)	10,892	99.78	99.89	2.06	0.51	0.62	0.62	2.05	2.04	2.05	32
中期 (3-7)	13,218	99.29	99.47	4.73	0.75	0.89	0.88	4.63	4.61	4.63	34
長期 (7-)	16,374	88.59	88.85	16.57	1.03	1.83	1.70	13.70	13.58	13.59	31
長期 (7-11)	5,951	97.55	97.76	8.60	0.94	1.27	1.25	8.24	8.19	8.24	35
超長期 (11-)	10,423	83.48	83.76	21.12	1.08	2.20	2.01	17.34	17.16	17.16	28
A 格	20,922	96.60	96.78	5.45	0.76	1.27	1.23	5.05	5.01	5.04	64
短期 (1-3)	7,068	99.39	99.51	2.00	0.57	0.86	0.86	1.99	1.98	1.99	57
中期 (3-7)	8,421	98.05	98.23	4.63	0.72	1.14	1.13	4.54	4.51	4.54	60
長期 (7-)	5,433	90.73	90.97	11.20	1.07	2.05	1.93	10.25	10.15	10.23	81
長期 (7-11)	3,055	94.87	95.11	8.58	1.05	1.77	1.70	8.17	8.10	8.17	80
超長期 (11-)	2,379	85.43	85.66	14.56	1.09	2.44	2.26	13.22	13.07	13.18	81
BBB 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
BB 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
B 格以下	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
格付なし	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

出所:NFRC

- 格付は、格付会社 4 社の最高格付をもとに分類

事業債 円建外債 格付別・ポートフォリオ指標 (2024年6月末、7月ポートフォリオ)

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
AAA~AA 格	51,472	95.49	95.66	8.18	0.72	1.09	1.05	6.85	6.80	6.81	30
短期 (1-3)	15,126	99.65	99.74	2.10	0.42	0.59	0.59	2.09	2.08	2.09	28
中期 (3-7)	18,066	99.04	99.19	4.76	0.67	0.86	0.85	4.67	4.65	4.67	31
長期 (7-)	18,280	88.55	88.80	16.60	1.02	1.81	1.69	13.67	13.54	13.55	30
長期 (7-11)	7,015	97.45	97.64	8.65	0.92	1.26	1.24	8.30	8.25	8.30	33
超長期 (11-)	11,265	83.01	83.29	21.55	1.08	2.22	2.02	17.58	17.40	17.38	28
AAA~A 格	72,008	95.79	95.96	7.45	0.74	1.15	1.11	6.37	6.33	6.35	40
短期 (1-3)	22,028	99.55	99.66	2.12	0.47	0.68	0.68	2.11	2.10	2.11	37
中期 (3-7)	26,224	98.71	98.87	4.76	0.69	0.95	0.94	4.67	4.65	4.67	40
長期 (7-)	23,756	89.09	89.33	15.37	1.03	1.87	1.75	12.87	12.75	12.78	42
長期 (7-11)	10,170	96.69	96.90	8.67	0.97	1.42	1.39	8.30	8.24	8.29	47
超長期 (11-)	13,586	83.39	83.67	20.38	1.08	2.26	2.06	16.84	16.66	16.67	37
AAA~BBB 格	72,008	95.79	95.96	7.45	0.74	1.15	1.11	6.37	6.33	6.35	40
短期 (1-3)	22,028	99.55	99.66	2.12	0.47	0.68	0.68	2.11	2.10	2.11	37
中期 (3-7)	26,224	98.71	98.87	4.76	0.69	0.95	0.94	4.67	4.65	4.67	40
長期 (7-)	23,756	89.09	89.33	15.37	1.03	1.87	1.75	12.87	12.75	12.78	42
長期 (7-11)	10,170	96.69	96.90	8.67	0.97	1.42	1.39	8.30	8.24	8.29	47
超長期 (11-)	13,586	83.39	83.67	20.38	1.08	2.26	2.06	16.84	16.66	16.67	37
AAA~BB 格	72,008	95.79	95.96	7.45	0.74	1.15	1.11	6.37	6.33	6.35	40
短期 (1-3)	22,028	99.55	99.66	2.12	0.47	0.68	0.68	2.11	2.10	2.11	37
中期 (3-7)	26,224	98.71	98.87	4.76	0.69	0.95	0.94	4.67	4.65	4.67	40
長期 (7-)	23,756	89.09	89.33	15.37	1.03	1.87	1.75	12.87	12.75	12.78	42
長期 (7-11)	10,170	96.69	96.90	8.67	0.97	1.42	1.39	8.30	8.24	8.29	47
超長期 (11-)	13,586	83.39	83.67	20.38	1.08	2.26	2.06	16.84	16.66	16.67	37
AAA 格	11,060	97.00	97.08	5.60	0.39	0.78	0.75	4.83	4.81	4.81	20
短期 (1-3)	4,350	99.33	99.36	2.02	0.16	0.49	0.49	2.02	2.01	2.02	19
中期 (3-7)	4,842	98.45	98.54	4.66	0.43	0.74	0.74	4.61	4.59	4.61	20
長期 (7-)	1,869	87.84	88.01	16.33	0.84	1.64	1.51	12.88	12.76	12.75	24
長期 (7-11)	1,067	96.65	96.76	8.50	0.71	1.15	1.13	8.24	8.19	8.24	24
超長期 (11-)	802	76.12	76.36	26.76	1.02	2.46	2.14	20.71	20.48	20.36	24
AA 格	40,411	95.08	95.27	8.89	0.81	1.17	1.13	7.41	7.35	7.36	32
短期 (1-3)	10,776	99.78	99.90	2.13	0.53	0.63	0.63	2.12	2.11	2.12	32
中期 (3-7)	13,225	99.26	99.43	4.80	0.76	0.90	0.89	4.70	4.68	4.70	35
長期 (7-)	16,411	88.63	88.89	16.63	1.04	1.83	1.71	13.76	13.63	13.64	31
長期 (7-11)	5,948	97.60	97.80	8.68	0.96	1.27	1.26	8.31	8.26	8.31	35
超長期 (11-)	10,463	83.54	83.82	21.15	1.08	2.20	2.01	17.36	17.18	17.18	28
A 格	20,536	96.54	96.71	5.61	0.78	1.29	1.25	5.20	5.16	5.20	64
短期 (1-3)	6,903	99.34	99.47	2.16	0.59	0.88	0.88	2.15	2.14	2.15	57
中期 (3-7)	8,157	97.97	98.14	4.75	0.73	1.16	1.15	4.65	4.63	4.65	61
長期 (7-)	5,476	90.87	91.10	11.25	1.09	2.05	1.94	10.30	10.20	10.28	81
長期 (7-11)	3,155	94.99	95.23	8.72	1.09	1.78	1.72	8.29	8.22	8.28	80
超長期 (11-)	2,322	85.27	85.49	14.70	1.10	2.46	2.27	13.34	13.19	13.30	82
BBB 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
BB 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
B 格以下	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
格付なし	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

出所:NFRC

- 格付は、格付会社 4 社の最高格付をもとに分類

事業債 最高格付別・ポートフォリオ指標 (2024年6月末)

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
AAA~AA格	50,017	95.39	95.55	8.25	0.71	1.08	1.04	6.88	6.83	6.84	29
短期 (1-3)	14,578	99.65	99.73	2.04	0.40	0.57	0.57	2.03	2.02	2.03	27
中期 (3-7)	17,167	99.08	99.24	4.71	0.66	0.84	0.84	4.62	4.60	4.62	30
長期 (7-)	18,273	88.51	88.76	16.52	1.00	1.80	1.68	13.60	13.48	13.49	30
長期 (7-11)	7,052	97.37	97.56	8.56	0.89	1.24	1.23	8.22	8.17	8.22	33
超長期 (11-)	11,221	82.95	83.23	21.53	1.07	2.21	2.02	17.57	17.38	17.37	28
AAA~A格	69,215	95.67	95.84	7.50	0.71	1.13	1.09	6.40	6.35	6.37	38
短期 (1-3)	20,785	99.56	99.65	2.02	0.43	0.64	0.64	2.01	2.00	2.01	34
中期 (3-7)	24,930	98.76	98.92	4.70	0.67	0.93	0.92	4.61	4.59	4.61	38
長期 (7-)	23,500	88.96	89.20	15.33	1.01	1.85	1.73	12.85	12.73	12.75	41
長期 (7-11)	10,023	96.63	96.83	8.56	0.94	1.39	1.36	8.21	8.16	8.21	46
超長期 (11-)	13,477	83.26	83.53	20.37	1.06	2.25	2.05	16.84	16.67	16.67	37
AAA~BBB格	69,215	95.67	95.84	7.50	0.71	1.13	1.09	6.40	6.35	6.37	38
短期 (1-3)	20,785	99.56	99.65	2.02	0.43	0.64	0.64	2.01	2.00	2.01	34
中期 (3-7)	24,930	98.76	98.92	4.70	0.67	0.93	0.92	4.61	4.59	4.61	38
長期 (7-)	23,500	88.96	89.20	15.33	1.01	1.85	1.73	12.85	12.73	12.75	41
長期 (7-11)	10,023	96.63	96.83	8.56	0.94	1.39	1.36	8.21	8.16	8.21	46
超長期 (11-)	13,477	83.26	83.53	20.37	1.06	2.25	2.05	16.84	16.67	16.67	37
AAA~BB格	69,215	95.67	95.84	7.50	0.71	1.13	1.09	6.40	6.35	6.37	38
短期 (1-3)	20,785	99.56	99.65	2.02	0.43	0.64	0.64	2.01	2.00	2.01	34
中期 (3-7)	24,930	98.76	98.92	4.70	0.67	0.93	0.92	4.61	4.59	4.61	38
長期 (7-)	23,500	88.96	89.20	15.33	1.01	1.85	1.73	12.85	12.73	12.75	41
長期 (7-11)	10,023	96.63	96.83	8.56	0.94	1.39	1.36	8.21	8.16	8.21	46
超長期 (11-)	13,477	83.26	83.53	20.37	1.06	2.25	2.05	16.84	16.67	16.67	37
AAA格	10,900	96.96	97.04	5.58	0.38	0.77	0.75	4.80	4.77	4.78	20
短期 (1-3)	4,380	99.34	99.37	1.99	0.16	0.49	0.48	1.99	1.99	1.99	19
中期 (3-7)	4,550	98.48	98.58	4.58	0.42	0.74	0.73	4.53	4.51	4.52	20
長期 (7-)	1,970	88.17	88.33	15.85	0.80	1.60	1.47	12.55	12.44	12.42	24
長期 (7-11)	1,168	96.44	96.55	8.35	0.65	1.13	1.11	8.12	8.07	8.11	23
超長期 (11-)	802	76.12	76.36	26.76	1.02	2.46	2.14	20.71	20.48	20.36	24
AA格	39,118	94.95	95.14	8.99	0.80	1.17	1.12	7.47	7.41	7.43	31
短期 (1-3)	10,199	99.78	99.89	2.06	0.50	0.60	0.60	2.05	2.04	2.05	30
中期 (3-7)	12,616	99.30	99.48	4.75	0.74	0.88	0.87	4.66	4.64	4.66	33
長期 (7-)	16,303	88.56	88.81	16.60	1.03	1.83	1.71	13.73	13.60	13.61	31
長期 (7-11)	5,884	97.56	97.76	8.60	0.94	1.26	1.25	8.25	8.19	8.24	34
超長期 (11-)	10,419	83.47	83.76	21.13	1.08	2.20	2.01	17.35	17.17	17.16	28
A格	19,198	96.42	96.58	5.57	0.72	1.25	1.21	5.16	5.12	5.16	61
短期 (1-3)	6,207	99.36	99.47	1.97	0.50	0.81	0.80	1.96	1.95	1.96	52
中期 (3-7)	7,764	98.03	98.21	4.68	0.70	1.12	1.11	4.59	4.56	4.59	57
長期 (7-)	5,228	90.52	90.75	11.18	1.03	2.03	1.91	10.26	10.16	10.24	79
長期 (7-11)	2,971	94.86	95.09	8.58	1.04	1.76	1.69	8.18	8.11	8.17	79
超長期 (11-)	2,257	84.82	85.04	14.61	1.01	2.42	2.22	13.32	13.18	13.28	78
BBB格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
BB格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
B格以下	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
格付なし	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

出所:NFRC

- 格付は、格付会社4社の最高格付をもとに分類

事業債 最高格付別・ポートフォリオ指標 (2024年6月末、7月ポートフォリオ)

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
AAA~AA格	50,117	95.39	95.56	8.31	0.72	1.09	1.05	6.95	6.89	6.91	29
短期(1-3)	14,443	99.65	99.74	2.10	0.41	0.57	0.57	2.09	2.08	2.09	27
中期(3-7)	17,465	99.03	99.19	4.78	0.66	0.85	0.84	4.69	4.67	4.69	30
長期(7-)	18,209	88.52	88.76	16.63	1.02	1.81	1.69	13.69	13.56	13.57	30
長期(7-11)	6,948	97.46	97.64	8.65	0.92	1.25	1.24	8.31	8.25	8.30	33
超長期(11-)	11,260	83.00	83.29	21.55	1.08	2.22	2.02	17.58	17.40	17.39	28
AAA~A格	68,929	95.65	95.82	7.62	0.72	1.14	1.10	6.50	6.45	6.47	38
短期(1-3)	20,424	99.54	99.64	2.11	0.44	0.65	0.65	2.10	2.09	2.10	34
中期(3-7)	25,026	98.71	98.87	4.78	0.67	0.93	0.93	4.70	4.67	4.70	38
長期(7-)	23,480	89.00	89.24	15.42	1.02	1.86	1.74	12.92	12.79	12.82	41
長期(7-11)	10,019	96.70	96.90	8.67	0.97	1.41	1.38	8.30	8.25	8.30	47
超長期(11-)	13,460	83.27	83.54	20.44	1.07	2.25	2.05	16.90	16.72	16.73	36
AAA~BBB格	68,929	95.65	95.82	7.62	0.72	1.14	1.10	6.50	6.45	6.47	38
短期(1-3)	20,424	99.54	99.64	2.11	0.44	0.65	0.65	2.10	2.09	2.10	34
中期(3-7)	25,026	98.71	98.87	4.78	0.67	0.93	0.93	4.70	4.67	4.70	38
長期(7-)	23,480	89.00	89.24	15.42	1.02	1.86	1.74	12.92	12.79	12.82	41
長期(7-11)	10,019	96.70	96.90	8.67	0.97	1.41	1.38	8.30	8.25	8.30	47
超長期(11-)	13,460	83.27	83.54	20.44	1.07	2.25	2.05	16.90	16.72	16.73	36
AAA~BB格	68,929	95.65	95.82	7.62	0.72	1.14	1.10	6.50	6.45	6.47	38
短期(1-3)	20,424	99.54	99.64	2.11	0.44	0.65	0.65	2.10	2.09	2.10	34
中期(3-7)	25,026	98.71	98.87	4.78	0.67	0.93	0.93	4.70	4.67	4.70	38
長期(7-)	23,480	89.00	89.24	15.42	1.02	1.86	1.74	12.92	12.79	12.82	41
長期(7-11)	10,019	96.70	96.90	8.67	0.97	1.41	1.38	8.30	8.25	8.30	47
超長期(11-)	13,460	83.27	83.54	20.44	1.07	2.25	2.05	16.90	16.72	16.73	36
AAA格	11,060	97.00	97.08	5.60	0.39	0.78	0.75	4.83	4.81	4.81	20
短期(1-3)	4,350	99.33	99.36	2.02	0.16	0.49	0.49	2.02	2.01	2.02	19
中期(3-7)	4,842	98.45	98.54	4.66	0.43	0.74	0.74	4.61	4.59	4.61	20
長期(7-)	1,869	87.84	88.01	16.33	0.84	1.64	1.51	12.88	12.76	12.75	24
長期(7-11)	1,067	96.65	96.76	8.50	0.71	1.15	1.13	8.24	8.19	8.24	24
超長期(11-)	802	76.12	76.36	26.76	1.02	2.46	2.14	20.71	20.48	20.36	24
AA格	39,056	94.93	95.13	9.08	0.81	1.18	1.13	7.56	7.50	7.51	32
短期(1-3)	10,093	99.78	99.90	2.13	0.51	0.61	0.61	2.12	2.11	2.12	30
中期(3-7)	12,623	99.26	99.43	4.82	0.75	0.89	0.88	4.73	4.71	4.73	33
長期(7-)	16,340	88.60	88.85	16.66	1.04	1.83	1.71	13.78	13.65	13.67	31
長期(7-11)	5,881	97.60	97.80	8.68	0.95	1.27	1.26	8.32	8.27	8.31	34
超長期(11-)	10,458	83.53	83.82	21.15	1.08	2.20	2.01	17.37	17.19	17.18	28
A格	18,813	96.34	96.51	5.76	0.74	1.27	1.23	5.34	5.30	5.33	61
短期(1-3)	5,981	99.30	99.41	2.14	0.51	0.83	0.83	2.12	2.12	2.12	52
中期(3-7)	7,561	97.96	98.13	4.79	0.71	1.13	1.12	4.70	4.67	4.70	57
長期(7-)	5,271	90.66	90.89	11.24	1.05	2.03	1.91	10.31	10.20	10.28	79
長期(7-11)	3,071	94.98	95.22	8.72	1.08	1.77	1.71	8.29	8.22	8.29	79
超長期(11-)	2,200	84.64	84.85	14.76	1.02	2.44	2.24	13.45	13.31	13.41	78
BBB格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
BB格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
B格以下	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
格付なし	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

出所:NFRG

- 格付は、格付会社4社の最高格付をもとに分類

事業債 最低格付別・ポートフォリオ指標 (2024年6月末)

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
AAA~AA格	11,044	95.41	95.52	7.22	0.61	1.03	0.99	5.94	5.90	5.90	33
短期(1-3)	3,594	99.62	99.69	2.02	0.42	0.59	0.59	2.01	2.01	2.01	30
中期(3-7)	4,425	98.62	98.73	4.59	0.59	0.89	0.89	4.52	4.50	4.52	36
長期(7-)	3,025	85.70	85.88	17.22	0.89	1.86	1.71	13.74	13.60	13.60	34
長期(7-11)	1,270	96.52	96.66	8.67	0.83	1.29	1.27	8.35	8.30	8.35	36
超長期(11-)	1,755	77.88	78.08	23.41	0.93	2.37	2.10	18.56	18.36	18.30	32
AAA~A格	66,770	95.65	95.81	7.55	0.71	1.12	1.08	6.43	6.38	6.40	37
短期(1-3)	20,161	99.57	99.67	2.02	0.43	0.63	0.63	2.01	2.00	2.01	34
中期(3-7)	23,742	98.74	98.90	4.70	0.66	0.91	0.91	4.61	4.59	4.61	37
長期(7-)	22,868	88.97	89.22	15.37	1.01	1.85	1.73	12.86	12.74	12.77	41
長期(7-11)	9,737	96.66	96.86	8.56	0.94	1.39	1.36	8.21	8.15	8.20	46
超長期(11-)	13,131	83.27	83.55	20.42	1.06	2.25	2.05	16.86	16.69	16.69	36
AAA~BBB格	68,975	95.66	95.82	7.51	0.71	1.13	1.08	6.41	6.36	6.38	37
短期(1-3)	20,785	99.56	99.65	2.02	0.43	0.64	0.64	2.01	2.00	2.01	34
中期(3-7)	24,715	98.73	98.89	4.70	0.66	0.92	0.91	4.61	4.59	4.61	37
長期(7-)	23,475	88.96	89.20	15.33	1.01	1.85	1.73	12.85	12.73	12.75	41
長期(7-11)	10,023	96.63	96.83	8.56	0.94	1.39	1.36	8.21	8.16	8.21	46
超長期(11-)	13,452	83.24	83.52	20.38	1.06	2.25	2.05	16.85	16.67	16.68	36
AAA~BB格	69,215	95.67	95.84	7.50	0.71	1.13	1.09	6.40	6.35	6.37	38
短期(1-3)	20,785	99.56	99.65	2.02	0.43	0.64	0.64	2.01	2.00	2.01	34
中期(3-7)	24,930	98.76	98.92	4.70	0.67	0.93	0.92	4.61	4.59	4.61	38
長期(7-)	23,500	88.96	89.20	15.33	1.01	1.85	1.73	12.85	12.73	12.75	41
長期(7-11)	10,023	96.63	96.83	8.56	0.94	1.39	1.36	8.21	8.16	8.21	46
超長期(11-)	13,477	83.26	83.53	20.37	1.06	2.25	2.05	16.84	16.67	16.67	37
AAA格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA格	11,044	95.41	95.52	7.22	0.61	1.03	0.99	5.94	5.90	5.90	33
短期(1-3)	3,594	99.62	99.69	2.02	0.42	0.59	0.59	2.01	2.01	2.01	30
中期(3-7)	4,425	98.62	98.73	4.59	0.59	0.89	0.89	4.52	4.50	4.52	36
長期(7-)	3,025	85.70	85.88	17.22	0.89	1.86	1.71	13.74	13.60	13.60	34
長期(7-11)	1,270	96.52	96.66	8.67	0.83	1.29	1.27	8.35	8.30	8.35	36
超長期(11-)	1,755	77.88	78.08	23.41	0.93	2.37	2.10	18.56	18.36	18.30	32
A格	55,726	95.69	95.87	7.61	0.73	1.14	1.10	6.52	6.47	6.49	38
短期(1-3)	16,567	99.57	99.66	2.02	0.43	0.64	0.64	2.01	2.00	2.01	35
中期(3-7)	19,316	98.77	98.94	4.72	0.67	0.92	0.91	4.63	4.61	4.63	37
長期(7-)	19,843	89.47	89.72	15.09	1.03	1.85	1.73	12.74	12.62	12.65	42
長期(7-11)	8,466	96.68	96.89	8.55	0.95	1.40	1.37	8.19	8.13	8.18	48
超長期(11-)	11,377	84.10	84.39	19.96	1.08	2.23	2.04	16.62	16.45	16.46	37
BBB格	2,205	95.92	96.06	6.46	0.66	1.17	1.13	5.78	5.73	5.76	48
短期(1-3)	624	99.11	99.20	2.01	0.42	0.82	0.81	2.00	1.99	2.00	52
中期(3-7)	974	98.53	98.66	4.68	0.65	0.98	0.98	4.61	4.58	4.61	44
長期(7-)	608	88.46	88.65	13.86	0.92	1.90	1.78	12.21	12.09	12.15	50
長期(7-11)	287	95.56	95.73	8.58	0.88	1.49	1.45	8.26	8.20	8.25	54
超長期(11-)	321	82.12	82.33	18.58	0.95	2.34	2.12	16.31	16.13	16.20	45
BB格	240	100.46	100.91	5.92	2.26	2.01	2.01	5.34	5.28	5.33	138
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	215	101.46	101.93	4.75	2.25	1.90	1.91	4.51	4.47	4.51	137
長期(7-)	25	91.88	92.08	15.92	2.37	3.13	3.01	13.19	12.99	13.09	149
長期(7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期(11-)	25	91.88	92.08	15.92	2.37	3.13	3.01	13.19	12.99	13.09	149
B格以下	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
格付なし	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

出所:NFRC

- 格付は、格付会社4社の最低格付をもとに分類

事業債 最低格付別・ポートフォリオ指標 (2024年6月末、7月ポートフォリオ)

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
AAA~AA格	10,944	95.37	95.48	7.28	0.62	1.04	1.00	6.00	5.95	5.96	33
短期(1-3)	3,489	99.60	99.68	2.07	0.42	0.60	0.60	2.06	2.05	2.06	30
中期(3-7)	4,445	98.61	98.72	4.62	0.59	0.90	0.89	4.54	4.52	4.54	36
長期(7-)	3,010	85.66	85.84	17.27	0.89	1.87	1.71	13.77	13.64	13.63	34
長期(7-11)	1,255	96.55	96.69	8.69	0.83	1.29	1.27	8.37	8.32	8.37	35
超長期(11-)	1,755	77.88	78.08	23.41	0.93	2.37	2.10	18.56	18.36	18.30	32
AAA~A格	66,508	95.63	95.79	7.65	0.72	1.13	1.09	6.53	6.48	6.50	37
短期(1-3)	19,824	99.56	99.65	2.11	0.44	0.64	0.64	2.10	2.09	2.10	34
中期(3-7)	23,858	98.69	98.85	4.79	0.66	0.92	0.91	4.70	4.68	4.70	37
長期(7-)	22,826	89.00	89.25	15.46	1.03	1.86	1.74	12.94	12.81	12.84	41
長期(7-11)	9,707	96.73	96.93	8.67	0.97	1.41	1.38	8.30	8.24	8.29	46
超長期(11-)	13,119	83.29	83.56	20.49	1.07	2.25	2.05	16.92	16.74	16.74	36
AAA~BBB格	68,689	95.63	95.80	7.62	0.72	1.14	1.10	6.51	6.46	6.48	38
短期(1-3)	20,424	99.54	99.64	2.11	0.44	0.65	0.65	2.10	2.09	2.10	34
中期(3-7)	24,811	98.69	98.84	4.78	0.66	0.92	0.92	4.70	4.68	4.70	37
長期(7-)	23,455	89.00	89.24	15.42	1.02	1.86	1.74	12.92	12.79	12.82	41
長期(7-11)	10,019	96.70	96.90	8.67	0.97	1.41	1.38	8.30	8.25	8.30	47
超長期(11-)	13,435	83.25	83.53	20.45	1.07	2.25	2.05	16.91	16.73	16.73	36
AAA~BB格	68,929	95.65	95.82	7.62	0.72	1.14	1.10	6.50	6.45	6.47	38
短期(1-3)	20,424	99.54	99.64	2.11	0.44	0.65	0.65	2.10	2.09	2.10	34
中期(3-7)	25,026	98.71	98.87	4.78	0.67	0.93	0.93	4.70	4.67	4.70	38
長期(7-)	23,480	89.00	89.24	15.42	1.02	1.86	1.74	12.92	12.79	12.82	41
長期(7-11)	10,019	96.70	96.90	8.67	0.97	1.41	1.38	8.30	8.25	8.30	47
超長期(11-)	13,460	83.27	83.54	20.44	1.07	2.25	2.05	16.90	16.72	16.73	36
AAA格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA格	10,944	95.37	95.48	7.28	0.62	1.04	1.00	6.00	5.95	5.96	33
短期(1-3)	3,489	99.60	99.68	2.07	0.42	0.60	0.60	2.06	2.05	2.06	30
中期(3-7)	4,445	98.61	98.72	4.62	0.59	0.90	0.89	4.54	4.52	4.54	36
長期(7-)	3,010	85.66	85.84	17.27	0.89	1.87	1.71	13.77	13.64	13.63	34
長期(7-11)	1,255	96.55	96.69	8.69	0.83	1.29	1.27	8.37	8.32	8.37	35
超長期(11-)	1,755	77.88	78.08	23.41	0.93	2.37	2.10	18.56	18.36	18.30	32
A格	55,564	95.68	95.85	7.73	0.74	1.15	1.11	6.63	6.58	6.60	38
短期(1-3)	16,336	99.55	99.65	2.12	0.44	0.65	0.65	2.11	2.10	2.11	35
中期(3-7)	19,413	98.71	98.88	4.83	0.68	0.93	0.92	4.73	4.71	4.73	37
長期(7-)	19,816	89.51	89.76	15.19	1.05	1.86	1.74	12.81	12.69	12.72	42
長期(7-11)	8,452	96.75	96.97	8.67	0.99	1.42	1.39	8.29	8.23	8.28	48
超長期(11-)	11,364	84.12	84.41	20.04	1.09	2.23	2.04	16.68	16.51	16.52	36
BBB格	2,182	95.85	95.99	6.65	0.68	1.19	1.15	5.95	5.91	5.94	48
短期(1-3)	599	99.03	99.13	2.15	0.43	0.85	0.84	2.14	2.13	2.14	53
中期(3-7)	954	98.52	98.66	4.74	0.66	0.99	0.98	4.66	4.63	4.66	44
長期(7-)	629	88.77	88.95	13.85	0.94	1.90	1.78	12.18	12.07	12.12	50
長期(7-11)	313	95.70	95.87	8.72	0.91	1.50	1.46	8.38	8.32	8.37	54
超長期(11-)	316	81.92	82.12	18.91	0.97	2.36	2.15	16.57	16.39	16.45	45
BB格	240	100.46	100.91	5.92	2.26	2.01	2.01	5.34	5.28	5.33	138
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	215	101.46	101.93	4.75	2.25	1.90	1.91	4.51	4.47	4.51	137
長期(7-)	25	91.88	92.08	15.92	2.37	3.13	3.01	13.19	12.99	13.09	149
長期(7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期(11-)	25	91.88	92.08	15.92	2.37	3.13	3.01	13.19	12.99	13.09	149
B格以下	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
格付なし	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

出所:NFRC

- 格付は、格付会社4社の最低格付をもとに分類

事業債 R&I 格付別・ポートフォリオ指標 (2024年6月末)

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
AAA~AA 格	37,931	95.22	95.41	8.92	0.76	1.08	1.04	7.29	7.24	7.24	25
短期 (1-3)	10,714	99.72	99.81	2.05	0.39	0.53	0.53	2.04	2.03	2.04	23
中期 (3-7)	12,514	99.58	99.76	4.67	0.72	0.80	0.79	4.59	4.57	4.59	26
長期 (7-)	14,702	88.23	88.49	17.54	1.06	1.81	1.69	14.21	14.08	14.08	26
長期 (7-11)	5,163	98.21	98.41	8.68	0.96	1.19	1.18	8.32	8.27	8.31	27
超長期 (11-)	9,539	82.83	83.13	22.34	1.11	2.21	2.01	17.99	17.80	17.77	25
AAA~A 格	63,048	95.60	95.77	7.73	0.72	1.12	1.08	6.56	6.51	6.52	35
短期 (1-3)	18,767	99.59	99.68	2.02	0.41	0.61	0.61	2.01	2.01	2.01	32
中期 (3-7)	22,167	98.89	99.06	4.70	0.68	0.90	0.90	4.61	4.59	4.61	36
長期 (7-)	22,114	88.92	89.16	15.63	1.01	1.83	1.71	13.03	12.91	12.93	38
長期 (7-11)	9,146	96.92	97.12	8.58	0.92	1.33	1.31	8.23	8.17	8.22	41
超長期 (11-)	12,967	83.27	83.55	20.60	1.07	2.24	2.05	16.97	16.79	16.80	35
AAA~BBB 格	63,188	95.60	95.77	7.73	0.72	1.12	1.08	6.55	6.50	6.52	36
短期 (1-3)	18,830	99.58	99.67	2.02	0.41	0.62	0.62	2.01	2.01	2.01	32
中期 (3-7)	22,233	98.89	99.05	4.70	0.68	0.91	0.90	4.61	4.59	4.61	36
長期 (7-)	22,125	88.91	89.16	15.62	1.01	1.83	1.72	13.03	12.91	12.93	38
長期 (7-11)	9,157	96.90	97.10	8.58	0.92	1.34	1.32	8.23	8.17	8.22	41
超長期 (11-)	12,967	83.27	83.55	20.60	1.07	2.24	2.05	16.97	16.79	16.80	35
AAA~BB 格	63,188	95.60	95.77	7.73	0.72	1.12	1.08	6.55	6.50	6.52	36
短期 (1-3)	18,830	99.58	99.67	2.02	0.41	0.62	0.62	2.01	2.01	2.01	32
中期 (3-7)	22,233	98.89	99.05	4.70	0.68	0.91	0.90	4.61	4.59	4.61	36
長期 (7-)	22,125	88.91	89.16	15.62	1.01	1.83	1.72	13.03	12.91	12.93	38
長期 (7-11)	9,157	96.90	97.10	8.58	0.92	1.34	1.32	8.23	8.17	8.22	41
超長期 (11-)	12,967	83.27	83.55	20.60	1.07	2.24	2.05	16.97	16.79	16.80	35
AAA 格	955	98.13	98.19	3.87	0.31	0.73	0.72	3.77	3.76	3.77	26
短期 (1-3)	490	99.21	99.24	2.16	0.19	0.56	0.56	2.16	2.15	2.16	25
中期 (3-7)	365	98.12	98.21	4.56	0.40	0.80	0.79	4.51	4.49	4.51	26
長期 (7-)	100	92.90	92.94	9.73	0.57	1.36	1.31	9.40	9.34	9.39	29
長期 (7-11)	70	95.39	95.43	8.64	0.62	1.21	1.19	8.41	8.36	8.41	27
超長期 (11-)	30	87.10	87.13	12.26	0.45	1.72	1.61	11.91	11.81	11.90	32
AA 格	36,976	95.15	95.34	9.05	0.77	1.09	1.05	7.39	7.33	7.34	25
短期 (1-3)	10,224	99.75	99.84	2.04	0.40	0.53	0.53	2.03	2.03	2.03	23
中期 (3-7)	12,149	99.63	99.81	4.68	0.73	0.80	0.79	4.59	4.57	4.59	26
長期 (7-)	14,602	88.20	88.46	17.60	1.06	1.82	1.69	14.25	14.11	14.11	26
長期 (7-11)	5,093	98.25	98.45	8.68	0.97	1.19	1.18	8.31	8.26	8.31	27
超長期 (11-)	9,509	82.81	83.11	22.37	1.11	2.22	2.01	18.01	17.82	17.79	25
A 格	25,117	96.17	96.32	5.94	0.65	1.17	1.13	5.45	5.41	5.44	50
短期 (1-3)	8,053	99.40	99.50	1.99	0.43	0.72	0.72	1.98	1.97	1.98	43
中期 (3-7)	9,653	98.00	98.15	4.73	0.63	1.05	1.04	4.64	4.62	4.64	50
長期 (7-)	7,411	90.28	90.49	11.83	0.92	1.86	1.77	10.74	10.64	10.72	61
長期 (7-11)	3,983	95.25	95.46	8.44	0.87	1.52	1.49	8.11	8.05	8.11	60
超長期 (11-)	3,428	84.50	84.72	15.77	0.98	2.32	2.13	14.19	14.04	14.13	62
BBB 格	140	95.46	95.56	3.75	0.95	2.12	2.05	3.60	3.56	3.60	160
短期 (1-3)	63	97.37	97.44	2.39	0.82	1.96	1.94	2.37	2.35	2.37	160
中期 (3-7)	66	96.74	96.89	4.41	1.06	1.83	1.79	4.31	4.27	4.31	128
長期 (7-)	11	76.86	76.90	7.47	1.07	5.42	4.79	7.15	6.98	7.15	401
長期 (7-11)	11	76.86	76.90	7.47	1.07	5.42	4.79	7.15	6.98	7.15	401
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
BB 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
B 格以下	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
格付なし	6,028	96.43	96.55	5.19	0.67	1.23	1.19	4.87	4.83	4.87	62
短期 (1-3)	1,955	99.38	99.48	1.98	0.57	0.86	0.85	1.97	1.96	1.97	56
中期 (3-7)	2,697	97.67	97.78	4.72	0.58	1.08	1.07	4.64	4.62	4.64	53
長期 (7-)	1,376	89.79	89.98	10.68	1.00	2.15	1.98	9.91	9.81	9.90	90
長期 (7-11)	866	93.77	93.97	8.42	1.09	2.00	1.87	8.03	7.95	8.02	99
超長期 (11-)	510	83.04	83.21	14.51	0.85	2.45	2.19	13.52	13.38	13.49	74

出所:NFRC

- 格付は、R&Iの格付をもとにNFRCで分類

事業債 R&I 格付別・ポートフォリオ指標 (2024年6月末、7月ポートフォリオ)

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
AAA~AA 格	38,076	95.24	95.42	8.97	0.76	1.09	1.04	7.34	7.28	7.29	25
短期 (1-3)	10,689	99.73	99.83	2.10	0.41	0.54	0.54	2.09	2.08	2.09	23
中期 (3-7)	12,773	99.52	99.70	4.75	0.71	0.80	0.80	4.66	4.64	4.66	26
長期 (7-)	14,614	88.20	88.47	17.68	1.07	1.83	1.70	14.32	14.18	14.18	26
長期 (7-11)	5,038	98.30	98.51	8.79	0.99	1.20	1.19	8.40	8.35	8.40	27
超長期 (11-)	9,575	82.89	83.19	22.35	1.11	2.21	2.01	18.00	17.81	17.78	25
AAA~A 格	62,890	95.58	95.75	7.84	0.73	1.13	1.09	6.66	6.61	6.62	35
短期 (1-3)	18,501	99.57	99.66	2.12	0.42	0.62	0.62	2.11	2.10	2.11	32
中期 (3-7)	22,297	98.84	99.00	4.79	0.68	0.91	0.91	4.70	4.68	4.70	36
長期 (7-)	22,093	88.95	89.20	15.72	1.03	1.84	1.72	13.11	12.98	13.01	38
長期 (7-11)	9,143	96.99	97.20	8.70	0.95	1.35	1.33	8.33	8.27	8.32	42
超長期 (11-)	12,950	83.28	83.55	20.68	1.08	2.24	2.05	17.03	16.85	16.85	35
AAA~BBB 格	63,030	95.58	95.75	7.83	0.73	1.13	1.09	6.65	6.60	6.62	36
短期 (1-3)	18,564	99.56	99.66	2.12	0.42	0.63	0.63	2.11	2.10	2.11	32
中期 (3-7)	22,363	98.84	99.00	4.79	0.68	0.91	0.91	4.70	4.68	4.70	36
長期 (7-)	22,104	88.95	89.20	15.71	1.03	1.84	1.73	13.10	12.98	13.00	38
長期 (7-11)	9,154	96.97	97.17	8.70	0.95	1.35	1.33	8.32	8.27	8.32	42
超長期 (11-)	12,950	83.28	83.55	20.68	1.08	2.24	2.05	17.03	16.85	16.85	35
AAA~BB 格	63,030	95.58	95.75	7.83	0.73	1.13	1.09	6.65	6.60	6.62	36
短期 (1-3)	18,564	99.56	99.66	2.12	0.42	0.63	0.63	2.11	2.10	2.11	32
中期 (3-7)	22,363	98.84	99.00	4.79	0.68	0.91	0.91	4.70	4.68	4.70	36
長期 (7-)	22,104	88.95	89.20	15.71	1.03	1.84	1.73	13.10	12.98	13.00	38
長期 (7-11)	9,154	96.97	97.17	8.70	0.95	1.35	1.33	8.32	8.27	8.32	42
超長期 (11-)	12,950	83.28	83.55	20.68	1.08	2.24	2.05	17.03	16.85	16.85	35
AAA 格	955	98.13	98.19	3.87	0.31	0.73	0.72	3.77	3.76	3.77	26
短期 (1-3)	505	99.20	99.23	2.19	0.19	0.56	0.56	2.19	2.18	2.19	25
中期 (3-7)	350	98.10	98.18	4.63	0.41	0.80	0.80	4.57	4.55	4.57	26
長期 (7-)	100	92.90	92.94	9.73	0.57	1.36	1.31	9.40	9.34	9.39	29
長期 (7-11)	70	95.39	95.43	8.64	0.62	1.21	1.19	8.41	8.36	8.41	27
超長期 (11-)	30	87.10	87.13	12.26	0.45	1.72	1.61	11.91	11.81	11.90	32
AA 格	37,121	95.16	95.35	9.10	0.78	1.10	1.05	7.44	7.38	7.39	25
短期 (1-3)	10,184	99.76	99.86	2.09	0.42	0.54	0.54	2.08	2.08	2.08	23
中期 (3-7)	12,423	99.56	99.74	4.76	0.72	0.80	0.80	4.66	4.64	4.66	26
長期 (7-)	14,514	88.17	88.44	17.73	1.07	1.83	1.70	14.35	14.22	14.21	26
長期 (7-11)	4,968	98.34	98.55	8.79	1.00	1.20	1.20	8.40	8.35	8.40	27
超長期 (11-)	9,545	82.87	83.17	22.38	1.11	2.22	2.02	18.02	17.83	17.80	25
A 格	24,815	96.11	96.26	6.12	0.67	1.19	1.15	5.62	5.57	5.61	51
短期 (1-3)	7,812	99.35	99.44	2.15	0.44	0.74	0.74	2.14	2.13	2.14	43
中期 (3-7)	9,524	97.93	98.07	4.84	0.64	1.06	1.05	4.75	4.72	4.75	50
長期 (7-)	7,479	90.42	90.64	11.89	0.94	1.87	1.77	10.79	10.69	10.76	61
長期 (7-11)	4,104	95.39	95.60	8.58	0.91	1.53	1.50	8.23	8.16	8.22	60
超長期 (11-)	3,375	84.39	84.60	15.92	0.98	2.33	2.14	14.32	14.17	14.26	62
BBB 格	140	95.46	95.56	3.75	0.95	2.12	2.05	3.60	3.56	3.60	160
短期 (1-3)	63	97.37	97.44	2.39	0.82	1.96	1.94	2.37	2.35	2.37	160
中期 (3-7)	66	96.74	96.89	4.41	1.06	1.83	1.79	4.31	4.27	4.31	128
長期 (7-)	11	76.86	76.90	7.47	1.07	5.42	4.79	7.15	6.98	7.15	401
長期 (7-11)	11	76.86	76.90	7.47	1.07	5.42	4.79	7.15	6.98	7.15	401
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
BB 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
B 格以下	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
格付なし	5,899	96.36	96.49	5.28	0.68	1.25	1.20	4.95	4.92	4.95	62
短期 (1-3)	1,860	99.36	99.46	2.03	0.58	0.88	0.87	2.01	2.00	2.01	58
中期 (3-7)	2,663	97.65	97.76	4.76	0.59	1.08	1.07	4.68	4.65	4.68	53
長期 (7-)	1,376	89.82	90.01	10.70	1.00	2.15	1.98	9.93	9.83	9.92	90
長期 (7-11)	866	93.81	94.01	8.45	1.10	2.00	1.87	8.06	7.98	8.05	99
超長期 (11-)	510	83.04	83.21	14.51	0.85	2.45	2.19	13.52	13.38	13.49	74

出所:NFRC

- 格付は、R&Iの格付をもとに NFRC で分類

事業債 JCR 格付別・ポートフォリオ指標 (2024年6月末)

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
AAA~AA格	28,954	96.39	96.51	6.05	0.53	0.97	0.94	5.37	5.34	5.36	33
短期(1-3)	9,988	99.48	99.54	2.02	0.34	0.59	0.59	2.01	2.00	2.01	29
中期(3-7)	11,393	98.27	98.38	4.67	0.51	0.87	0.86	4.60	4.58	4.60	33
長期(7-)	7,573	89.49	89.67	13.44	0.82	1.69	1.59	11.57	11.47	11.51	39
長期(7-11)	4,165	95.87	96.02	8.38	0.73	1.29	1.27	8.11	8.06	8.11	39
超長期(11-)	3,409	81.70	81.92	19.62	0.92	2.27	2.05	16.53	16.36	16.38	39
AAA~A格	41,025	96.26	96.40	5.97	0.60	1.08	1.05	5.36	5.32	5.35	43
短期(1-3)	13,644	99.43	99.51	2.01	0.38	0.65	0.65	2.00	1.99	2.00	36
中期(3-7)	16,158	98.23	98.36	4.67	0.59	0.96	0.95	4.59	4.57	4.59	42
長期(7-)	11,222	89.59	89.79	12.65	0.89	1.85	1.73	11.10	11.00	11.06	56
長期(7-11)	6,219	95.09	95.27	8.44	0.82	1.50	1.45	8.13	8.07	8.12	56
超長期(11-)	5,003	82.76	82.99	17.88	0.97	2.34	2.13	15.35	15.19	15.24	55
AAA~BBB格	41,025	96.26	96.40	5.97	0.60	1.08	1.05	5.36	5.32	5.35	43
短期(1-3)	13,644	99.43	99.51	2.01	0.38	0.65	0.65	2.00	1.99	2.00	36
中期(3-7)	16,158	98.23	98.36	4.67	0.59	0.96	0.95	4.59	4.57	4.59	42
長期(7-)	11,222	89.59	89.79	12.65	0.89	1.85	1.73	11.10	11.00	11.06	56
長期(7-11)	6,219	95.09	95.27	8.44	0.82	1.50	1.45	8.13	8.07	8.12	56
超長期(11-)	5,003	82.76	82.99	17.88	0.97	2.34	2.13	15.35	15.19	15.24	55
AAA~BB格	41,025	96.26	96.40	5.97	0.60	1.08	1.05	5.36	5.32	5.35	43
短期(1-3)	13,644	99.43	99.51	2.01	0.38	0.65	0.65	2.00	1.99	2.00	36
中期(3-7)	16,158	98.23	98.36	4.67	0.59	0.96	0.95	4.59	4.57	4.59	42
長期(7-)	11,222	89.59	89.79	12.65	0.89	1.85	1.73	11.10	11.00	11.06	56
長期(7-11)	6,219	95.09	95.27	8.44	0.82	1.50	1.45	8.13	8.07	8.12	56
超長期(11-)	5,003	82.76	82.99	17.88	0.97	2.34	2.13	15.35	15.19	15.24	55
AAA格	10,355	96.84	96.93	5.71	0.39	0.78	0.76	4.90	4.87	4.88	20
短期(1-3)	4,070	99.33	99.37	1.99	0.15	0.48	0.48	1.98	1.98	1.98	19
中期(3-7)	4,315	98.46	98.55	4.61	0.41	0.73	0.73	4.55	4.53	4.55	20
長期(7-)	1,970	88.17	88.33	15.85	0.80	1.60	1.47	12.55	12.44	12.42	24
長期(7-11)	1,168	96.44	96.55	8.35	0.65	1.13	1.11	8.12	8.07	8.11	23
超長期(11-)	802	76.12	76.36	26.76	1.02	2.46	2.14	20.71	20.48	20.36	24
AA格	18,599	96.14	96.27	6.23	0.61	1.07	1.04	5.64	5.60	5.62	40
短期(1-3)	5,918	99.58	99.67	2.04	0.47	0.66	0.66	2.03	2.02	2.03	36
中期(3-7)	7,078	98.16	98.28	4.70	0.57	0.95	0.94	4.63	4.60	4.63	41
長期(7-)	5,603	89.96	90.14	12.59	0.82	1.73	1.63	11.24	11.14	11.20	44
長期(7-11)	2,997	95.65	95.81	8.39	0.76	1.36	1.33	8.11	8.06	8.11	45
超長期(11-)	2,607	83.42	83.63	17.42	0.89	2.21	2.02	15.36	15.20	15.27	43
A格	12,071	95.96	96.15	5.78	0.78	1.35	1.31	5.34	5.29	5.33	69
短期(1-3)	3,657	99.28	99.40	1.98	0.50	0.84	0.83	1.97	1.96	1.97	54
中期(3-7)	4,766	98.12	98.32	4.69	0.79	1.19	1.18	4.59	4.56	4.59	64
長期(7-)	3,649	89.80	90.04	11.00	1.04	2.16	2.03	10.13	10.03	10.12	91
長期(7-11)	2,055	93.51	93.75	8.56	1.01	1.92	1.83	8.16	8.09	8.16	93
超長期(11-)	1,595	85.03	85.27	14.15	1.08	2.50	2.30	12.93	12.78	12.89	88
BBB格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
BB格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
B格以下	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
格付なし	28,191	94.81	95.03	9.74	0.87	1.20	1.15	7.94	7.87	7.88	30
短期(1-3)	7,141	99.82	99.93	2.04	0.51	0.61	0.61	2.03	2.02	2.03	31
中期(3-7)	8,772	99.73	99.93	4.75	0.81	0.86	0.85	4.65	4.63	4.65	31
長期(7-)	12,278	88.38	88.67	17.79	1.12	1.86	1.73	14.46	14.32	14.32	27
長期(7-11)	3,804	99.14	99.38	8.77	1.12	1.23	1.22	8.34	8.29	8.33	30
超長期(11-)	8,474	83.55	83.86	21.84	1.12	2.19	2.00	17.71	17.53	17.51	26

出所:NFRC

- 格付は、JCRの格付をもとにNFRCで分類

事業債 JCR 格付別・ポートフォリオ指標 (2024年6月末、7月ポートフォリオ)

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
AAA~AA 格	29,202	96.41	96.53	6.11	0.54	0.98	0.95	5.43	5.40	5.42	33
短期 (1-3)	9,952	99.46	99.53	2.08	0.35	0.60	0.60	2.07	2.07	2.07	29
中期 (3-7)	11,729	98.24	98.35	4.74	0.52	0.88	0.87	4.67	4.65	4.67	33
長期 (7-)	7,521	89.53	89.71	13.56	0.84	1.71	1.60	11.67	11.57	11.61	39
長期 (7-11)	4,100	96.01	96.16	8.48	0.76	1.31	1.28	8.20	8.14	8.19	39
超長期 (11-)	3,421	81.76	81.97	19.65	0.93	2.27	2.05	16.56	16.38	16.41	39
AAA~A 格	41,050	96.26	96.39	6.06	0.62	1.09	1.06	5.45	5.42	5.44	43
短期 (1-3)	13,380	99.41	99.49	2.09	0.39	0.66	0.66	2.08	2.07	2.08	36
中期 (3-7)	16,450	98.19	98.32	4.75	0.60	0.97	0.96	4.67	4.64	4.67	42
長期 (7-)	11,220	89.69	89.88	12.73	0.92	1.86	1.74	11.17	11.07	11.13	56
長期 (7-11)	6,259	95.23	95.42	8.57	0.87	1.52	1.47	8.23	8.17	8.23	57
超長期 (11-)	4,960	82.68	82.90	17.99	0.97	2.35	2.14	15.45	15.28	15.33	54
AAA~BBB 格	41,050	96.26	96.39	6.06	0.62	1.09	1.06	5.45	5.42	5.44	43
短期 (1-3)	13,380	99.41	99.49	2.09	0.39	0.66	0.66	2.08	2.07	2.08	36
中期 (3-7)	16,450	98.19	98.32	4.75	0.60	0.97	0.96	4.67	4.64	4.67	42
長期 (7-)	11,220	89.69	89.88	12.73	0.92	1.86	1.74	11.17	11.07	11.13	56
長期 (7-11)	6,259	95.23	95.42	8.57	0.87	1.52	1.47	8.23	8.17	8.23	57
超長期 (11-)	4,960	82.68	82.90	17.99	0.97	2.35	2.14	15.45	15.28	15.33	54
AAA~BB 格	41,050	96.26	96.39	6.06	0.62	1.09	1.06	5.45	5.42	5.44	43
短期 (1-3)	13,380	99.41	99.49	2.09	0.39	0.66	0.66	2.08	2.07	2.08	36
中期 (3-7)	16,450	98.19	98.32	4.75	0.60	0.97	0.96	4.67	4.64	4.67	42
長期 (7-)	11,220	89.69	89.88	12.73	0.92	1.86	1.74	11.17	11.07	11.13	56
長期 (7-11)	6,259	95.23	95.42	8.57	0.87	1.52	1.47	8.23	8.17	8.23	57
超長期 (11-)	4,960	82.68	82.90	17.99	0.97	2.35	2.14	15.45	15.28	15.33	54
AAA 格	10,515	96.89	96.97	5.73	0.40	0.78	0.76	4.93	4.90	4.91	20
短期 (1-3)	4,025	99.33	99.36	2.01	0.16	0.48	0.48	2.01	2.00	2.01	19
中期 (3-7)	4,622	98.43	98.52	4.69	0.42	0.74	0.74	4.63	4.61	4.63	20
長期 (7-)	1,869	87.84	88.01	16.33	0.84	1.64	1.51	12.88	12.76	12.75	24
長期 (7-11)	1,067	96.65	96.76	8.50	0.71	1.15	1.13	8.24	8.19	8.24	24
超長期 (11-)	802	76.12	76.36	26.76	1.02	2.46	2.14	20.71	20.48	20.36	24
AA 格	18,686	96.14	96.27	6.32	0.63	1.09	1.05	5.72	5.68	5.70	40
短期 (1-3)	5,928	99.56	99.65	2.13	0.48	0.67	0.67	2.12	2.11	2.12	37
中期 (3-7)	7,108	98.11	98.24	4.77	0.58	0.97	0.96	4.69	4.67	4.69	41
長期 (7-)	5,651	90.08	90.27	12.64	0.84	1.73	1.63	11.28	11.18	11.24	43
長期 (7-11)	3,033	95.78	95.94	8.47	0.79	1.36	1.33	8.18	8.13	8.18	44
超長期 (11-)	2,619	83.48	83.69	17.48	0.90	2.21	2.03	15.40	15.24	15.30	43
A 格	11,848	95.88	96.07	5.96	0.80	1.38	1.33	5.51	5.47	5.51	69
短期 (1-3)	3,428	99.24	99.36	2.11	0.52	0.86	0.86	2.10	2.09	2.10	55
中期 (3-7)	4,721	98.05	98.24	4.77	0.79	1.20	1.18	4.66	4.64	4.66	64
長期 (7-)	3,699	90.01	90.25	11.05	1.07	2.16	2.03	10.17	10.07	10.15	91
長期 (7-11)	2,160	93.76	94.02	8.74	1.07	1.93	1.84	8.31	8.23	8.30	92
超長期 (11-)	1,540	84.74	84.97	14.30	1.07	2.53	2.32	13.06	12.92	13.03	89
BBB 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
BB 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
B 格以下	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
格付なし	27,880	94.75	94.97	9.90	0.88	1.21	1.16	8.07	8.01	8.01	30
短期 (1-3)	7,044	99.81	99.93	2.16	0.52	0.62	0.62	2.14	2.13	2.14	31
中期 (3-7)	8,576	99.72	99.92	4.85	0.82	0.86	0.86	4.75	4.73	4.75	31
長期 (7-)	12,260	88.37	88.65	17.88	1.12	1.87	1.74	14.53	14.39	14.39	27
長期 (7-11)	3,760	99.13	99.37	8.85	1.13	1.24	1.23	8.41	8.36	8.40	30
超長期 (11-)	8,500	83.61	83.91	21.87	1.12	2.20	2.01	17.74	17.55	17.53	26

出所:NFRC

- 格付は、JCR の格付をもとに NFRC で分類

事業債 Moody's 格付別・ポートフォリオ指標 (2024年6月末)

	額面 (10 億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
AAA~AA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AAA~A 格	22,665	95.80	96.01	8.73	0.77	1.08	1.04	7.30	7.24	7.26	25
短期 (1-3)	6,607	99.67	99.76	2.06	0.37	0.53	0.53	2.05	2.04	2.05	23
中期 (3-7)	7,131	99.42	99.61	4.62	0.67	0.77	0.76	4.54	4.52	4.54	23
長期 (7-)	8,928	90.06	90.35	16.95	1.13	1.80	1.70	14.03	13.90	13.91	27
長期 (7-11)	3,091	98.27	98.49	8.73	0.98	1.22	1.21	8.35	8.30	8.35	29
超長期 (11-)	5,837	85.71	86.05	21.30	1.21	2.16	2.00	17.46	17.28	17.28	26
AAA~BBB 格	24,713	95.83	96.03	8.60	0.77	1.09	1.05	7.22	7.16	7.18	27
短期 (1-3)	6,961	99.65	99.75	2.05	0.37	0.53	0.53	2.04	2.04	2.04	23
中期 (3-7)	8,207	99.39	99.59	4.64	0.71	0.81	0.81	4.55	4.53	4.55	28
長期 (7-)	9,545	89.97	90.26	16.77	1.12	1.81	1.70	13.92	13.79	13.81	29
長期 (7-11)	3,362	98.11	98.33	8.72	0.97	1.23	1.22	8.35	8.30	8.34	30
超長期 (11-)	6,183	85.55	85.88	21.14	1.21	2.17	2.01	17.39	17.21	17.21	28
AAA~BB 格	24,713	95.83	96.03	8.60	0.77	1.09	1.05	7.22	7.16	7.18	27
短期 (1-3)	6,961	99.65	99.75	2.05	0.37	0.53	0.53	2.04	2.04	2.04	23
中期 (3-7)	8,207	99.39	99.59	4.64	0.71	0.81	0.81	4.55	4.53	4.55	28
長期 (7-)	9,545	89.97	90.26	16.77	1.12	1.81	1.70	13.92	13.79	13.81	29
長期 (7-11)	3,362	98.11	98.33	8.72	0.97	1.23	1.22	8.35	8.30	8.34	30
超長期 (11-)	6,183	85.55	85.88	21.14	1.21	2.17	2.01	17.39	17.21	17.21	28
AAA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
A 格	22,665	95.80	96.01	8.73	0.77	1.08	1.04	7.30	7.24	7.26	25
短期 (1-3)	6,607	99.67	99.76	2.06	0.37	0.53	0.53	2.05	2.04	2.05	23
中期 (3-7)	7,131	99.42	99.61	4.62	0.67	0.77	0.76	4.54	4.52	4.54	23
長期 (7-)	8,928	90.06	90.35	16.95	1.13	1.80	1.70	14.03	13.90	13.91	27
長期 (7-11)	3,091	98.27	98.49	8.73	0.98	1.22	1.21	8.35	8.30	8.35	29
超長期 (11-)	5,837	85.71	86.05	21.30	1.21	2.16	2.00	17.46	17.28	17.28	26
BBB 格	2,048	96.09	96.26	7.10	0.84	1.24	1.20	6.32	6.27	6.30	49
短期 (1-3)	355	99.35	99.42	2.00	0.29	0.59	0.59	1.99	1.99	1.99	30
中期 (3-7)	1,076	99.21	99.41	4.76	0.94	1.11	1.11	4.65	4.62	4.65	57
長期 (7-)	617	88.77	88.96	14.10	0.97	1.90	1.78	12.36	12.24	12.30	48
長期 (7-11)	271	96.36	96.53	8.63	0.87	1.36	1.33	8.30	8.24	8.30	42
超長期 (11-)	346	82.83	83.03	18.39	1.05	2.40	2.19	16.06	15.88	15.95	53
BB 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
B 格以下	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
格付なし	44,502	95.58	95.73	6.90	0.68	1.15	1.11	5.95	5.90	5.92	44
短期 (1-3)	13,824	99.51	99.61	2.00	0.46	0.69	0.69	1.99	1.98	1.99	40
中期 (3-7)	16,723	98.44	98.59	4.73	0.65	0.98	0.97	4.64	4.62	4.64	43
長期 (7-)	13,956	88.27	88.48	14.35	0.93	1.88	1.75	12.10	11.98	12.02	50
長期 (7-11)	6,661	95.88	96.07	8.48	0.92	1.48	1.44	8.14	8.08	8.13	55
超長期 (11-)	7,295	81.32	81.55	19.72	0.94	2.32	2.09	16.36	16.18	16.19	44

出所:NFRFC

- 格付は、Moody's の格付をもとに NFRFC で分類

事業債 Moody's 格付別・ポートフォリオ指標 (2024年6月末、7月ポートフォリオ)

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
AAA~AA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AAA~A 格	22,918	95.84	96.05	8.78	0.78	1.08	1.05	7.36	7.30	7.31	25
短期 (1-3)	6,666	99.69	99.79	2.11	0.39	0.54	0.54	2.10	2.10	2.10	23
中期 (3-7)	7,278	99.32	99.50	4.72	0.66	0.77	0.77	4.63	4.62	4.63	23
長期 (7-)	8,974	90.17	90.46	17.04	1.16	1.81	1.71	14.09	13.96	13.97	27
長期 (7-11)	3,073	98.45	98.68	8.85	1.03	1.23	1.23	8.45	8.40	8.44	29
超長期 (11-)	5,901	85.85	86.18	21.30	1.22	2.16	2.00	17.46	17.28	17.27	26
AAA~BBB 格	24,942	95.86	96.06	8.67	0.78	1.10	1.06	7.29	7.23	7.25	27
短期 (1-3)	6,996	99.67	99.77	2.12	0.39	0.54	0.54	2.11	2.10	2.11	23
中期 (3-7)	8,334	99.30	99.49	4.73	0.70	0.82	0.81	4.64	4.62	4.64	27
長期 (7-)	9,613	90.09	90.38	16.84	1.15	1.82	1.71	13.98	13.85	13.86	29
長期 (7-11)	3,370	98.28	98.49	8.85	1.02	1.25	1.24	8.45	8.39	8.44	31
超長期 (11-)	6,243	85.67	86.00	21.15	1.21	2.17	2.01	17.40	17.22	17.21	28
AAA~BB 格	24,942	95.86	96.06	8.67	0.78	1.10	1.06	7.29	7.23	7.25	27
短期 (1-3)	6,996	99.67	99.77	2.12	0.39	0.54	0.54	2.11	2.10	2.11	23
中期 (3-7)	8,334	99.30	99.49	4.73	0.70	0.82	0.81	4.64	4.62	4.64	27
長期 (7-)	9,613	90.09	90.38	16.84	1.15	1.82	1.71	13.98	13.85	13.86	29
長期 (7-11)	3,370	98.28	98.49	8.85	1.02	1.25	1.24	8.45	8.39	8.44	31
超長期 (11-)	6,243	85.67	86.00	21.15	1.21	2.17	2.01	17.40	17.22	17.21	28
AAA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
A 格	22,918	95.84	96.05	8.78	0.78	1.08	1.05	7.36	7.30	7.31	25
短期 (1-3)	6,666	99.69	99.79	2.11	0.39	0.54	0.54	2.10	2.10	2.10	23
中期 (3-7)	7,278	99.32	99.50	4.72	0.66	0.77	0.77	4.63	4.62	4.63	23
長期 (7-)	8,974	90.17	90.46	17.04	1.16	1.81	1.71	14.09	13.96	13.97	27
長期 (7-11)	3,073	98.45	98.68	8.85	1.03	1.23	1.23	8.45	8.40	8.44	29
超長期 (11-)	5,901	85.85	86.18	21.30	1.22	2.16	2.00	17.46	17.28	17.27	26
BBB 格	2,024	96.02	96.19	7.32	0.86	1.26	1.23	6.52	6.47	6.50	50
短期 (1-3)	330	99.24	99.29	2.25	0.29	0.62	0.62	2.24	2.24	2.24	30
中期 (3-7)	1,056	99.22	99.42	4.81	0.96	1.12	1.12	4.70	4.67	4.70	57
長期 (7-)	638	89.06	89.25	14.08	0.99	1.90	1.78	12.33	12.21	12.27	48
長期 (7-11)	297	96.44	96.61	8.78	0.91	1.38	1.35	8.42	8.37	8.42	43
超長期 (11-)	341	82.65	82.85	18.69	1.07	2.43	2.22	16.29	16.11	16.18	53
BB 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
B 格以下	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
格付なし	43,987	95.53	95.68	7.02	0.69	1.16	1.12	6.06	6.01	6.03	44
短期 (1-3)	13,428	99.48	99.57	2.11	0.46	0.71	0.70	2.10	2.09	2.10	40
中期 (3-7)	16,692	98.41	98.56	4.81	0.66	0.99	0.98	4.72	4.70	4.72	43
長期 (7-)	13,867	88.24	88.45	14.44	0.94	1.89	1.76	12.16	12.05	12.08	50
長期 (7-11)	6,649	95.90	96.09	8.59	0.94	1.49	1.45	8.23	8.17	8.22	55
超長期 (11-)	7,218	81.19	81.41	19.83	0.94	2.33	2.09	16.45	16.27	16.28	44

出所:NFRC

- 格付は、Moody's の格付をもとに NFRC で分類

事業債 S&P 格付別・ポートフォリオ指標 (2024年6月末)

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
AAA~AA 格	810	84.08	84.23	18.01	0.95	1.84	1.65	13.87	13.73	13.73	31
短期 (1-3)	40	103.08	103.14	2.49	1.75	0.58	0.59	2.45	2.44	2.45	25
中期 (3-7)	100	96.28	96.31	5.56	0.23	0.91	0.90	5.51	5.48	5.51	29
長期 (7-)	670	81.12	81.30	20.80	1.00	2.11	1.86	16.21	16.04	16.04	31
長期 (7-11)	202	99.71	99.89	8.70	1.17	1.22	1.22	8.27	8.22	8.26	30
超長期 (11-)	468	73.10	73.27	26.02	0.93	2.63	2.24	20.89	20.65	20.62	32
AAA~A 格	16,191	94.41	94.56	9.14	0.73	1.11	1.06	7.48	7.43	7.44	25
短期 (1-3)	3,918	99.85	99.92	2.05	0.43	0.52	0.52	2.04	2.04	2.04	23
中期 (3-7)	5,414	99.19	99.33	4.92	0.67	0.82	0.81	4.83	4.81	4.83	26
長期 (7-)	6,858	87.52	87.74	16.52	0.95	1.76	1.62	13.40	13.27	13.28	27
長期 (7-11)	2,830	98.57	98.76	8.57	1.00	1.18	1.17	8.20	8.16	8.20	27
超長期 (11-)	4,029	79.76	80.00	22.09	0.93	2.27	2.02	17.90	17.71	17.69	27
AAA~BBB 格	16,663	94.52	94.68	8.98	0.73	1.11	1.05	7.36	7.30	7.32	26
短期 (1-3)	4,175	99.81	99.89	2.05	0.43	0.54	0.54	2.04	2.03	2.04	25
中期 (3-7)	5,585	99.17	99.31	4.89	0.67	0.82	0.82	4.80	4.78	4.80	26
長期 (7-)	6,903	87.57	87.78	16.47	0.95	1.76	1.62	13.37	13.24	13.25	27
長期 (7-11)	2,864	98.55	98.74	8.57	1.00	1.18	1.17	8.20	8.15	8.20	27
超長期 (11-)	4,039	79.78	80.01	22.07	0.93	2.27	2.02	17.89	17.70	17.67	28
AAA~BB 格	16,903	94.61	94.77	8.93	0.75	1.12	1.07	7.33	7.27	7.29	28
短期 (1-3)	4,175	99.81	99.89	2.05	0.43	0.54	0.54	2.04	2.03	2.04	25
中期 (3-7)	5,800	99.26	99.41	4.89	0.73	0.86	0.86	4.79	4.77	4.79	31
長期 (7-)	6,928	87.58	87.80	16.47	0.96	1.77	1.63	13.37	13.24	13.25	28
長期 (7-11)	2,864	98.55	98.74	8.57	1.00	1.18	1.17	8.20	8.15	8.20	27
超長期 (11-)	4,064	79.85	80.08	22.04	0.93	2.27	2.03	17.86	17.67	17.64	28
AAA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA 格	810	84.08	84.23	18.01	0.95	1.84	1.65	13.87	13.73	13.73	31
短期 (1-3)	40	103.08	103.14	2.49	1.75	0.58	0.59	2.45	2.44	2.45	25
中期 (3-7)	100	96.28	96.31	5.56	0.23	0.91	0.90	5.51	5.48	5.51	29
長期 (7-)	670	81.12	81.30	20.80	1.00	2.11	1.86	16.21	16.04	16.04	31
長期 (7-11)	202	99.71	99.89	8.70	1.17	1.22	1.22	8.27	8.22	8.26	30
超長期 (11-)	468	73.10	73.27	26.02	0.93	2.63	2.24	20.89	20.65	20.62	32
A 格	15,381	94.95	95.11	8.67	0.72	1.08	1.03	7.19	7.13	7.14	25
短期 (1-3)	3,878	99.82	99.89	2.05	0.42	0.52	0.52	2.04	2.03	2.04	23
中期 (3-7)	5,314	99.24	99.38	4.91	0.68	0.81	0.81	4.81	4.79	4.81	26
長期 (7-)	6,188	88.21	88.44	16.05	0.95	1.73	1.60	13.12	13.00	13.01	27
長期 (7-11)	2,628	98.48	98.68	8.56	0.98	1.17	1.17	8.20	8.15	8.20	27
超長期 (11-)	3,561	80.64	80.88	21.58	0.92	2.23	1.99	17.55	17.36	17.34	27
BBB 格	473	98.51	98.64	3.44	0.58	0.95	0.95	3.33	3.31	3.33	52
短期 (1-3)	257	99.21	99.34	1.97	0.48	0.83	0.82	1.96	1.95	1.96	53
中期 (3-7)	172	98.57	98.68	4.06	0.63	0.98	0.98	4.00	3.98	4.00	49
長期 (7-)	45	94.23	94.45	9.51	0.97	1.60	1.55	8.92	8.85	8.91	57
長期 (7-11)	35	96.85	97.12	8.22	0.97	1.41	1.39	7.88	7.83	7.88	53
超長期 (11-)	10	85.19	85.23	13.96	0.95	2.36	2.19	13.01	12.87	12.98	77
BB 格	240	100.46	100.91	5.92	2.26	2.01	2.01	5.34	5.28	5.33	138
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	215	101.46	101.93	4.75	2.25	1.90	1.91	4.51	4.47	4.51	137
長期 (7-)	25	91.88	92.08	15.92	2.37	3.13	3.01	13.19	12.99	13.09	149
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	25	91.88	92.08	15.92	2.37	3.13	3.01	13.19	12.99	13.09	149
B 格以下	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
格付なし	52,312	96.02	96.19	7.04	0.70	1.13	1.09	6.11	6.06	6.08	41
短期 (1-3)	16,610	99.50	99.59	2.01	0.43	0.66	0.66	2.00	1.99	2.00	37
中期 (3-7)	19,130	98.60	98.77	4.64	0.65	0.95	0.94	4.56	4.54	4.56	40
長期 (7-)	16,573	89.54	89.79	14.86	1.03	1.89	1.77	12.63	12.51	12.55	46
長期 (7-11)	7,159	95.86	96.06	8.56	0.91	1.48	1.44	8.21	8.16	8.21	54
超長期 (11-)	9,414	84.73	85.02	19.65	1.12	2.24	2.06	16.43	16.26	16.28	40

出所:NFRC

- 格付は、S&P の格付をもとに NFRC で分類

事業債 S&P 格付別・ポートフォリオ指標 (2024年6月末、7月ポートフォリオ)

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
AAA~AA 格	851	84.82	84.97	17.88	0.98	1.83	1.65	13.81	13.67	13.68	30
短期 (1-3)	40	103.08	103.14	2.49	1.75	0.58	0.59	2.45	2.44	2.45	25
中期 (3-7)	115	96.00	96.03	5.75	0.22	0.93	0.91	5.70	5.67	5.70	29
長期 (7-)	696	81.92	82.10	20.77	1.06	2.10	1.87	16.20	16.03	16.03	31
長期 (7-11)	212	100.10	100.28	8.96	1.25	1.24	1.24	8.48	8.43	8.47	30
超長期 (11-)	484	73.96	74.14	25.94	0.98	2.61	2.24	20.78	20.54	20.51	32
AAA~A 格	16,203	94.41	94.57	9.17	0.74	1.12	1.06	7.52	7.46	7.47	25
短期 (1-3)	3,995	99.84	99.92	2.10	0.43	0.53	0.53	2.09	2.09	2.09	23
中期 (3-7)	5,446	99.15	99.29	5.01	0.67	0.82	0.82	4.92	4.90	4.92	26
長期 (7-)	6,762	87.39	87.60	16.70	0.96	1.78	1.64	13.54	13.42	13.42	27
長期 (7-11)	2,738	98.61	98.81	8.68	1.02	1.19	1.18	8.30	8.25	8.29	27
超長期 (11-)	4,025	79.75	79.98	22.16	0.93	2.27	2.02	17.95	17.76	17.73	27
AAA~BBB 格	16,675	94.53	94.68	9.01	0.73	1.11	1.06	7.39	7.34	7.35	26
短期 (1-3)	4,251	99.80	99.88	2.10	0.44	0.55	0.55	2.09	2.08	2.09	25
中期 (3-7)	5,617	99.13	99.27	4.99	0.67	0.83	0.82	4.89	4.87	4.89	26
長期 (7-)	6,807	87.43	87.65	16.65	0.96	1.78	1.64	13.51	13.38	13.39	27
長期 (7-11)	2,772	98.59	98.78	8.67	1.02	1.19	1.19	8.29	8.24	8.29	27
超長期 (11-)	4,035	79.76	79.99	22.14	0.93	2.27	2.02	17.94	17.75	17.72	28
AAA~BB 格	16,915	94.61	94.77	8.97	0.75	1.13	1.07	7.36	7.31	7.32	28
短期 (1-3)	4,251	99.80	99.88	2.10	0.44	0.55	0.55	2.09	2.08	2.09	25
中期 (3-7)	5,832	99.22	99.37	4.98	0.73	0.87	0.86	4.88	4.86	4.88	30
長期 (7-)	6,832	87.45	87.66	16.65	0.97	1.78	1.64	13.51	13.38	13.39	28
長期 (7-11)	2,772	98.59	98.78	8.67	1.02	1.19	1.19	8.29	8.24	8.29	27
超長期 (11-)	4,060	79.84	80.07	22.10	0.94	2.28	2.03	17.90	17.71	17.69	28
AAA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA 格	851	84.82	84.97	17.88	0.98	1.83	1.65	13.81	13.67	13.68	30
短期 (1-3)	40	103.08	103.14	2.49	1.75	0.58	0.59	2.45	2.44	2.45	25
中期 (3-7)	115	96.00	96.03	5.75	0.22	0.93	0.91	5.70	5.67	5.70	29
長期 (7-)	696	81.92	82.10	20.77	1.06	2.10	1.87	16.20	16.03	16.03	31
長期 (7-11)	212	100.10	100.28	8.96	1.25	1.24	1.24	8.48	8.43	8.47	30
超長期 (11-)	484	73.96	74.14	25.94	0.98	2.61	2.24	20.78	20.54	20.51	32
A 格	15,352	94.94	95.10	8.69	0.72	1.08	1.03	7.21	7.15	7.16	25
短期 (1-3)	3,955	99.81	99.88	2.10	0.42	0.53	0.53	2.09	2.09	2.09	23
中期 (3-7)	5,331	99.22	99.36	5.00	0.68	0.82	0.82	4.90	4.88	4.90	26
長期 (7-)	6,066	88.01	88.23	16.23	0.95	1.74	1.61	13.26	13.14	13.14	27
長期 (7-11)	2,526	98.49	98.68	8.66	1.00	1.19	1.18	8.28	8.23	8.28	27
超長期 (11-)	3,541	80.54	80.78	21.64	0.92	2.23	2.00	17.60	17.41	17.39	27
BBB 格	473	98.51	98.64	3.44	0.58	0.95	0.95	3.33	3.31	3.33	52
短期 (1-3)	257	99.21	99.34	1.97	0.48	0.83	0.82	1.96	1.95	1.96	53
中期 (3-7)	172	98.57	98.68	4.06	0.63	0.98	0.98	4.00	3.98	4.00	49
長期 (7-)	45	94.23	94.45	9.51	0.97	1.60	1.55	8.92	8.85	8.91	57
長期 (7-11)	35	96.85	97.12	8.22	0.97	1.41	1.39	7.88	7.83	7.88	53
超長期 (11-)	10	85.19	85.23	13.96	0.95	2.36	2.19	13.01	12.87	12.98	77
BB 格	240	100.46	100.91	5.92	2.26	2.01	2.01	5.34	5.28	5.33	138
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	215	101.46	101.93	4.75	2.25	1.90	1.91	4.51	4.47	4.51	137
長期 (7-)	25	91.88	92.08	15.92	2.37	3.13	3.01	13.19	12.99	13.09	149
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	25	91.88	92.08	15.92	2.37	3.13	3.01	13.19	12.99	13.09	149
B 格以下	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
格付なし	52,014	95.99	96.16	7.18	0.71	1.14	1.11	6.23	6.18	6.20	41
短期 (1-3)	16,173	99.48	99.58	2.12	0.44	0.68	0.67	2.10	2.10	2.10	37
中期 (3-7)	19,194	98.55	98.71	4.73	0.66	0.95	0.94	4.64	4.62	4.64	40
長期 (7-)	16,648	89.64	89.89	14.92	1.05	1.89	1.78	12.68	12.56	12.59	46
長期 (7-11)	7,247	95.97	96.18	8.67	0.95	1.49	1.45	8.31	8.25	8.30	54
超長期 (11-)	9,400	84.75	85.04	19.73	1.12	2.24	2.06	16.49	16.32	16.33	40

出所:NFRC

- 格付は、S&P の格付をもとに NFRC で分類

円建外債 最高格付別・ポートフォリオ指標 (2024年6月末)

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
AAA~AA格	1,366	99.35	99.57	3.36	0.83	1.01	1.01	3.28	3.26	3.28	59
短期(1-3)	694	99.70	99.92	2.08	0.71	0.86	0.85	2.06	2.05	2.06	55
中期(3-7)	601	99.21	99.42	4.20	0.92	1.12	1.12	4.11	4.09	4.11	62
長期(7-)	71	97.10	97.40	8.85	1.21	1.61	1.59	8.33	8.26	8.32	67
長期(7-11)	67	97.25	97.55	8.51	1.16	1.56	1.54	8.09	8.03	8.09	65
超長期(11-)	4	94.59	95.17	14.26	1.99	2.51	2.44	12.20	12.05	12.13	104
AAA~A格	3,090	98.98	99.21	3.75	1.03	1.27	1.26	3.57	3.55	3.57	81
短期(1-3)	1,555	99.68	99.88	2.18	0.94	1.07	1.07	2.15	2.14	2.15	75
中期(3-7)	1,259	98.69	98.94	4.12	0.97	1.30	1.29	4.03	4.01	4.03	80
長期(7-)	276	96.36	96.73	10.91	1.86	2.32	2.27	9.66	9.55	9.63	117
長期(7-11)	150	96.13	96.51	8.55	1.34	1.89	1.85	8.05	7.97	8.04	96
超長期(11-)	126	96.65	97.00	13.74	2.49	2.83	2.77	11.58	11.42	11.52	142
AAA~BBB格	3,090	98.98	99.21	3.75	1.03	1.27	1.26	3.57	3.55	3.57	81
短期(1-3)	1,555	99.68	99.88	2.18	0.94	1.07	1.07	2.15	2.14	2.15	75
中期(3-7)	1,259	98.69	98.94	4.12	0.97	1.30	1.29	4.03	4.01	4.03	80
長期(7-)	276	96.36	96.73	10.91	1.86	2.32	2.27	9.66	9.55	9.63	117
長期(7-11)	150	96.13	96.51	8.55	1.34	1.89	1.85	8.05	7.97	8.04	96
超長期(11-)	126	96.65	97.00	13.74	2.49	2.83	2.77	11.58	11.42	11.52	142
AAA~BB格	3,090	98.98	99.21	3.75	1.03	1.27	1.26	3.57	3.55	3.57	81
短期(1-3)	1,555	99.68	99.88	2.18	0.94	1.07	1.07	2.15	2.14	2.15	75
中期(3-7)	1,259	98.69	98.94	4.12	0.97	1.30	1.29	4.03	4.01	4.03	80
長期(7-)	276	96.36	96.73	10.91	1.86	2.32	2.27	9.66	9.55	9.63	117
長期(7-11)	150	96.13	96.51	8.55	1.34	1.89	1.85	8.05	7.97	8.04	96
超長期(11-)	126	96.65	97.00	13.74	2.49	2.83	2.77	11.58	11.42	11.52	142
AAA格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA格	1,366	99.35	99.57	3.36	0.83	1.01	1.01	3.28	3.26	3.28	59
短期(1-3)	694	99.70	99.92	2.08	0.71	0.86	0.85	2.06	2.05	2.06	55
中期(3-7)	601	99.21	99.42	4.20	0.92	1.12	1.12	4.11	4.09	4.11	62
長期(7-)	71	97.10	97.40	8.85	1.21	1.61	1.59	8.33	8.26	8.32	67
長期(7-11)	67	97.25	97.55	8.51	1.16	1.56	1.54	8.09	8.03	8.09	65
超長期(11-)	4	94.59	95.17	14.26	1.99	2.51	2.44	12.20	12.05	12.13	104
A格	1,724	98.69	98.94	4.06	1.20	1.48	1.46	3.80	3.77	3.80	98
短期(1-3)	861	99.66	99.85	2.26	1.12	1.24	1.24	2.23	2.22	2.23	92
中期(3-7)	658	98.22	98.51	4.05	1.01	1.46	1.45	3.96	3.93	3.96	96
長期(7-)	205	96.11	96.50	11.63	2.09	2.56	2.51	10.13	10.00	10.09	134
長期(7-11)	84	95.23	95.68	8.58	1.47	2.15	2.11	8.01	7.93	8.00	121
超長期(11-)	122	96.72	97.06	13.72	2.51	2.84	2.78	11.56	11.40	11.50	143
BBB格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
BB格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
B格以下	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
格付なし	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

出所:NFRC

- 格付は、格付会社4社の最高格付をもとに分類

円建外債 最高格付別・ポートフォリオ指標 (2024年6月末、7月ポートフォリオ)

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
AAA~AA 格	1,355	99.35	99.56	3.38	0.83	1.01	1.01	3.30	3.28	3.30	58
短期 (1-3)	683	99.70	99.91	2.09	0.71	0.85	0.85	2.07	2.06	2.07	55
中期 (3-7)	601	99.21	99.42	4.20	0.92	1.12	1.12	4.11	4.09	4.11	62
長期 (7-)	71	97.10	97.40	8.85	1.21	1.61	1.59	8.33	8.26	8.32	67
長期 (7-11)	67	97.25	97.55	8.51	1.16	1.56	1.54	8.09	8.03	8.09	65
超長期 (11-)	4	94.59	95.17	14.26	1.99	2.51	2.44	12.20	12.05	12.13	104
AAA~A 格	3,078	98.98	99.21	3.76	1.04	1.27	1.26	3.58	3.56	3.58	81
短期 (1-3)	1,605	99.67	99.88	2.22	0.94	1.07	1.06	2.19	2.18	2.19	75
中期 (3-7)	1,197	98.65	98.89	4.18	0.98	1.31	1.30	4.09	4.06	4.09	80
長期 (7-)	276	96.36	96.73	10.91	1.86	2.32	2.27	9.66	9.55	9.63	117
長期 (7-11)	150	96.13	96.51	8.55	1.34	1.89	1.85	8.05	7.97	8.04	96
超長期 (11-)	126	96.65	97.00	13.74	2.49	2.83	2.77	11.58	11.42	11.52	142
AAA~BBB 格	3,078	98.98	99.21	3.76	1.04	1.27	1.26	3.58	3.56	3.58	81
短期 (1-3)	1,605	99.67	99.88	2.22	0.94	1.07	1.06	2.19	2.18	2.19	75
中期 (3-7)	1,197	98.65	98.89	4.18	0.98	1.31	1.30	4.09	4.06	4.09	80
長期 (7-)	276	96.36	96.73	10.91	1.86	2.32	2.27	9.66	9.55	9.63	117
長期 (7-11)	150	96.13	96.51	8.55	1.34	1.89	1.85	8.05	7.97	8.04	96
超長期 (11-)	126	96.65	97.00	13.74	2.49	2.83	2.77	11.58	11.42	11.52	142
AAA~BB 格	3,078	98.98	99.21	3.76	1.04	1.27	1.26	3.58	3.56	3.58	81
短期 (1-3)	1,605	99.67	99.88	2.22	0.94	1.07	1.06	2.19	2.18	2.19	75
中期 (3-7)	1,197	98.65	98.89	4.18	0.98	1.31	1.30	4.09	4.06	4.09	80
長期 (7-)	276	96.36	96.73	10.91	1.86	2.32	2.27	9.66	9.55	9.63	117
長期 (7-11)	150	96.13	96.51	8.55	1.34	1.89	1.85	8.05	7.97	8.04	96
超長期 (11-)	126	96.65	97.00	13.74	2.49	2.83	2.77	11.58	11.42	11.52	142
AAA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA 格	1,355	99.35	99.56	3.38	0.83	1.01	1.01	3.30	3.28	3.30	58
短期 (1-3)	683	99.70	99.91	2.09	0.71	0.85	0.85	2.07	2.06	2.07	55
中期 (3-7)	601	99.21	99.42	4.20	0.92	1.12	1.12	4.11	4.09	4.11	62
長期 (7-)	71	97.10	97.40	8.85	1.21	1.61	1.59	8.33	8.26	8.32	67
長期 (7-11)	67	97.25	97.55	8.51	1.16	1.56	1.54	8.09	8.03	8.09	65
超長期 (11-)	4	94.59	95.17	14.26	1.99	2.51	2.44	12.20	12.05	12.13	104
A 格	1,723	98.69	98.94	4.06	1.20	1.48	1.46	3.81	3.77	3.80	98
短期 (1-3)	922	99.65	99.85	2.31	1.10	1.22	1.22	2.28	2.27	2.28	90
中期 (3-7)	596	98.09	98.36	4.15	1.03	1.50	1.49	4.06	4.03	4.06	100
長期 (7-)	205	96.11	96.50	11.63	2.09	2.56	2.51	10.13	10.00	10.09	134
長期 (7-11)	84	95.23	95.68	8.58	1.47	2.15	2.11	8.01	7.93	8.00	121
超長期 (11-)	122	96.72	97.06	13.72	2.51	2.84	2.78	11.56	11.40	11.50	143
BBB 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
BB 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
B 格以下	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
格付なし	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

出所:NFRG

- 格付は、格付会社4社の最高格付をもとに分類

円建外債 最低格付別・ポートフォリオ指標 (2024年6月末)

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
AAA~AA格	281	99.21	99.46	3.19	0.75	0.98	0.98	3.12	3.11	3.12	58
短期(1-3)	163	99.67	99.94	2.01	0.72	0.88	0.88	1.99	1.98	1.99	59
中期(3-7)	104	98.77	98.99	4.35	0.78	1.09	1.08	4.28	4.25	4.28	57
長期(7-)	14	97.03	97.33	8.38	0.94	1.38	1.36	8.05	8.00	8.05	47
長期(7-11)	14	97.03	97.33	8.38	0.94	1.38	1.36	8.05	8.00	8.05	47
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AAA~A格	2,041	99.57	99.76	3.58	0.96	1.09	1.09	3.45	3.42	3.44	65
短期(1-3)	1,077	99.81	99.98	2.15	0.87	0.96	0.95	2.13	2.12	2.13	65
中期(3-7)	812	99.21	99.43	4.11	0.94	1.13	1.13	4.03	4.01	4.03	64
長期(7-)	152	99.75	100.05	10.81	1.76	1.88	1.89	9.68	9.59	9.65	79
長期(7-11)	91	96.79	97.06	8.55	1.09	1.56	1.53	8.15	8.09	8.15	64
超長期(11-)	62	104.11	104.43	14.13	2.73	2.32	2.36	11.78	11.64	11.71	99
AAA~BBB格	3,090	98.98	99.21	3.75	1.03	1.27	1.26	3.57	3.55	3.57	81
短期(1-3)	1,555	99.68	99.88	2.18	0.94	1.07	1.07	2.15	2.14	2.15	75
中期(3-7)	1,259	98.69	98.94	4.12	0.97	1.30	1.29	4.03	4.01	4.03	80
長期(7-)	276	96.36	96.73	10.91	1.86	2.32	2.27	9.66	9.55	9.63	117
長期(7-11)	150	96.13	96.51	8.55	1.34	1.89	1.85	8.05	7.97	8.04	96
超長期(11-)	126	96.65	97.00	13.74	2.49	2.83	2.77	11.58	11.42	11.52	142
AAA~BB格	3,090	98.98	99.21	3.75	1.03	1.27	1.26	3.57	3.55	3.57	81
短期(1-3)	1,555	99.68	99.88	2.18	0.94	1.07	1.07	2.15	2.14	2.15	75
中期(3-7)	1,259	98.69	98.94	4.12	0.97	1.30	1.29	4.03	4.01	4.03	80
長期(7-)	276	96.36	96.73	10.91	1.86	2.32	2.27	9.66	9.55	9.63	117
長期(7-11)	150	96.13	96.51	8.55	1.34	1.89	1.85	8.05	7.97	8.04	96
超長期(11-)	126	96.65	97.00	13.74	2.49	2.83	2.77	11.58	11.42	11.52	142
AAA格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA格	281	99.21	99.46	3.19	0.75	0.98	0.98	3.12	3.11	3.12	58
短期(1-3)	163	99.67	99.94	2.01	0.72	0.88	0.88	1.99	1.98	1.99	59
中期(3-7)	104	98.77	98.99	4.35	0.78	1.09	1.08	4.28	4.25	4.28	57
長期(7-)	14	97.03	97.33	8.38	0.94	1.38	1.36	8.05	8.00	8.05	47
長期(7-11)	14	97.03	97.33	8.38	0.94	1.38	1.36	8.05	8.00	8.05	47
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
A格	1,760	99.63	99.81	3.64	1.00	1.11	1.11	3.50	3.48	3.49	66
短期(1-3)	914	99.84	99.98	2.17	0.89	0.97	0.97	2.15	2.14	2.15	66
中期(3-7)	708	99.28	99.49	4.07	0.96	1.14	1.13	3.99	3.97	3.99	64
長期(7-)	139	100.02	100.32	11.06	1.84	1.93	1.94	9.84	9.74	9.81	82
長期(7-11)	77	96.74	97.01	8.59	1.12	1.59	1.57	8.17	8.11	8.16	66
超長期(11-)	62	104.11	104.43	14.13	2.73	2.32	2.36	11.78	11.64	11.71	99
BBB格	1,049	97.83	98.15	4.09	1.17	1.62	1.59	3.82	3.78	3.82	111
短期(1-3)	478	99.37	99.66	2.24	1.10	1.32	1.32	2.21	2.20	2.21	100
中期(3-7)	447	97.74	98.05	4.14	1.03	1.60	1.59	4.04	4.01	4.04	109
長期(7-)	124	92.21	92.66	11.04	1.99	2.90	2.78	9.64	9.50	9.60	167
長期(7-11)	60	95.13	95.66	8.54	1.70	2.39	2.34	7.89	7.80	7.88	145
超長期(11-)	64	89.48	89.87	13.36	2.26	3.39	3.21	11.37	11.19	11.31	189
BB格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
B格以下	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
格付なし	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

出所:NFRC

- 格付は、格付会社4社の最低格付をもとに分類

円建外債 最低格付別・ポートフォリオ指標 (2024年6月末、7月ポートフォリオ)

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
AAA~AA 格	276	99.20	99.45	3.23	0.76	0.99	0.99	3.16	3.15	3.16	58
短期 (1-3)	158	99.67	99.94	2.04	0.73	0.89	0.89	2.02	2.01	2.02	59
中期 (3-7)	104	98.77	98.99	4.35	0.78	1.09	1.08	4.28	4.25	4.28	57
長期 (7-)	14	97.03	97.33	8.38	0.94	1.38	1.36	8.05	8.00	8.05	47
長期 (7-11)	14	97.03	97.33	8.38	0.94	1.38	1.36	8.05	8.00	8.05	47
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AAA~A 格	2,031	99.57	99.76	3.59	0.96	1.09	1.09	3.46	3.44	3.46	65
短期 (1-3)	1,128	99.80	99.97	2.21	0.87	0.96	0.96	2.18	2.17	2.18	64
中期 (3-7)	751	99.19	99.39	4.20	0.95	1.14	1.13	4.11	4.09	4.11	63
長期 (7-)	152	99.75	100.05	10.81	1.76	1.88	1.89	9.68	9.59	9.65	79
長期 (7-11)	91	96.79	97.06	8.55	1.09	1.56	1.53	8.15	8.09	8.15	64
超長期 (11-)	62	104.11	104.43	14.13	2.73	2.32	2.36	11.78	11.64	11.71	99
AAA~BBB 格	3,078	98.98	99.21	3.76	1.04	1.27	1.26	3.58	3.56	3.58	81
短期 (1-3)	1,605	99.67	99.88	2.22	0.94	1.07	1.06	2.19	2.18	2.19	75
中期 (3-7)	1,197	98.65	98.89	4.18	0.98	1.31	1.30	4.09	4.06	4.09	80
長期 (7-)	276	96.36	96.73	10.91	1.86	2.32	2.27	9.66	9.55	9.63	117
長期 (7-11)	150	96.13	96.51	8.55	1.34	1.89	1.85	8.05	7.97	8.04	96
超長期 (11-)	126	96.65	97.00	13.74	2.49	2.83	2.77	11.58	11.42	11.52	142
AAA~BB 格	3,078	98.98	99.21	3.76	1.04	1.27	1.26	3.58	3.56	3.58	81
短期 (1-3)	1,605	99.67	99.88	2.22	0.94	1.07	1.06	2.19	2.18	2.19	75
中期 (3-7)	1,197	98.65	98.89	4.18	0.98	1.31	1.30	4.09	4.06	4.09	80
長期 (7-)	276	96.36	96.73	10.91	1.86	2.32	2.27	9.66	9.55	9.63	117
長期 (7-11)	150	96.13	96.51	8.55	1.34	1.89	1.85	8.05	7.97	8.04	96
超長期 (11-)	126	96.65	97.00	13.74	2.49	2.83	2.77	11.58	11.42	11.52	142
AAA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA 格	276	99.20	99.45	3.23	0.76	0.99	0.99	3.16	3.15	3.16	58
短期 (1-3)	158	99.67	99.94	2.04	0.73	0.89	0.89	2.02	2.01	2.02	59
中期 (3-7)	104	98.77	98.99	4.35	0.78	1.09	1.08	4.28	4.25	4.28	57
長期 (7-)	14	97.03	97.33	8.38	0.94	1.38	1.36	8.05	8.00	8.05	47
長期 (7-11)	14	97.03	97.33	8.38	0.94	1.38	1.36	8.05	8.00	8.05	47
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
A 格	1,755	99.63	99.81	3.64	1.00	1.11	1.11	3.51	3.48	3.50	66
短期 (1-3)	970	99.82	99.98	2.23	0.89	0.97	0.97	2.21	2.20	2.21	65
中期 (3-7)	647	99.26	99.46	4.18	0.97	1.15	1.14	4.09	4.07	4.09	64
長期 (7-)	139	100.02	100.32	11.06	1.84	1.93	1.94	9.84	9.74	9.81	82
長期 (7-11)	77	96.74	97.01	8.59	1.12	1.59	1.57	8.17	8.11	8.16	66
超長期 (11-)	62	104.11	104.43	14.13	2.73	2.32	2.36	11.78	11.64	11.71	99
BBB 格	1,048	97.83	98.14	4.09	1.17	1.62	1.59	3.82	3.79	3.82	111
短期 (1-3)	477	99.37	99.66	2.25	1.10	1.32	1.32	2.22	2.20	2.22	100
中期 (3-7)	447	97.74	98.05	4.14	1.03	1.60	1.59	4.04	4.01	4.04	109
長期 (7-)	124	92.21	92.66	11.04	1.99	2.90	2.78	9.64	9.50	9.60	167
長期 (7-11)	60	95.13	95.66	8.54	1.70	2.39	2.34	7.89	7.80	7.88	145
超長期 (11-)	64	89.48	89.87	13.36	2.26	3.39	3.21	11.37	11.19	11.31	189
BB 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
B 格以下	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
格付なし	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

出所:NFRC

- 格付は、格付会社 4 社の最低格付をもとに分類

円建外債 R&I 格付別・ポートフォリオ指標 (2024年6月末)

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
AAA~AA 格	30	100.35	100.99	2.02	1.37	1.20	1.21	1.98	1.97	1.98	91
短期 (1-3)	30	100.35	100.99	2.02	1.37	1.20	1.21	1.98	1.97	1.98	91
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AAA~A 格	754	98.96	99.18	3.31	0.98	1.25	1.25	3.23	3.21	3.23	83
短期 (1-3)	347	99.51	99.66	2.16	0.97	1.15	1.15	2.13	2.12	2.13	84
中期 (3-7)	378	98.77	99.06	3.97	1.00	1.32	1.31	3.89	3.86	3.89	83
長期 (7-)	29	94.86	95.16	8.35	0.96	1.68	1.64	8.01	7.94	8.00	76
長期 (7-11)	29	94.86	95.16	8.35	0.96	1.68	1.64	8.01	7.94	8.00	76
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AAA~BBB 格	754	98.96	99.18	3.31	0.98	1.25	1.25	3.23	3.21	3.23	83
短期 (1-3)	347	99.51	99.66	2.16	0.97	1.15	1.15	2.13	2.12	2.13	84
中期 (3-7)	378	98.77	99.06	3.97	1.00	1.32	1.31	3.89	3.86	3.89	83
長期 (7-)	29	94.86	95.16	8.35	0.96	1.68	1.64	8.01	7.94	8.00	76
長期 (7-11)	29	94.86	95.16	8.35	0.96	1.68	1.64	8.01	7.94	8.00	76
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AAA~BB 格	754	98.96	99.18	3.31	0.98	1.25	1.25	3.23	3.21	3.23	83
短期 (1-3)	347	99.51	99.66	2.16	0.97	1.15	1.15	2.13	2.12	2.13	84
中期 (3-7)	378	98.77	99.06	3.97	1.00	1.32	1.31	3.89	3.86	3.89	83
長期 (7-)	29	94.86	95.16	8.35	0.96	1.68	1.64	8.01	7.94	8.00	76
長期 (7-11)	29	94.86	95.16	8.35	0.96	1.68	1.64	8.01	7.94	8.00	76
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AAA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA 格	30	100.35	100.99	2.02	1.37	1.20	1.21	1.98	1.97	1.98	91
短期 (1-3)	30	100.35	100.99	2.02	1.37	1.20	1.21	1.98	1.97	1.98	91
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
A 格	724	98.90	99.11	3.36	0.97	1.25	1.25	3.28	3.26	3.28	83
短期 (1-3)	317	99.43	99.54	2.17	0.93	1.14	1.14	2.15	2.13	2.15	83
中期 (3-7)	378	98.77	99.06	3.97	1.00	1.32	1.31	3.89	3.86	3.89	83
長期 (7-)	29	94.86	95.16	8.35	0.96	1.68	1.64	8.01	7.94	8.00	76
長期 (7-11)	29	94.86	95.16	8.35	0.96	1.68	1.64	8.01	7.94	8.00	76
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
BBB 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
BB 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
B 格以下	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
格付なし	2,336	98.99	99.22	3.89	1.05	1.28	1.27	3.68	3.65	3.68	80
短期 (1-3)	1,208	99.73	99.94	2.18	0.93	1.04	1.04	2.16	2.15	2.16	73
中期 (3-7)	881	98.66	98.89	4.18	0.96	1.29	1.28	4.09	4.07	4.09	78
長期 (7-)	247	96.54	96.92	11.22	1.97	2.39	2.34	9.86	9.74	9.82	121
長期 (7-11)	121	96.43	96.83	8.59	1.43	1.94	1.90	8.06	7.98	8.05	100
超長期 (11-)	126	96.65	97.00	13.74	2.49	2.83	2.77	11.58	11.42	11.52	142

出所:NFRC

- 格付は、R&Iの格付をもとに NFRC で分類

円建外債 R&I 格付別・ポートフォリオ指標 (2024年6月末、7月ポートフォリオ)

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
AAA~AA 格	30	100.35	100.99	2.02	1.37	1.20	1.21	1.98	1.97	1.98	91
短期 (1-3)	30	100.35	100.99	2.02	1.37	1.20	1.21	1.98	1.97	1.98	91
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AAA~A 格	754	98.96	99.18	3.31	0.98	1.25	1.25	3.23	3.21	3.23	83
短期 (1-3)	408	99.50	99.69	2.29	0.95	1.13	1.13	2.26	2.25	2.26	81
中期 (3-7)	317	98.63	98.89	4.16	1.02	1.37	1.36	4.07	4.04	4.07	86
長期 (7-)	29	94.86	95.16	8.35	0.96	1.68	1.64	8.01	7.94	8.00	76
長期 (7-11)	29	94.86	95.16	8.35	0.96	1.68	1.64	8.01	7.94	8.00	76
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AAA~BBB 格	754	98.96	99.18	3.31	0.98	1.25	1.25	3.23	3.21	3.23	83
短期 (1-3)	408	99.50	99.69	2.29	0.95	1.13	1.13	2.26	2.25	2.26	81
中期 (3-7)	317	98.63	98.89	4.16	1.02	1.37	1.36	4.07	4.04	4.07	86
長期 (7-)	29	94.86	95.16	8.35	0.96	1.68	1.64	8.01	7.94	8.00	76
長期 (7-11)	29	94.86	95.16	8.35	0.96	1.68	1.64	8.01	7.94	8.00	76
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AAA~BB 格	754	98.96	99.18	3.31	0.98	1.25	1.25	3.23	3.21	3.23	83
短期 (1-3)	408	99.50	99.69	2.29	0.95	1.13	1.13	2.26	2.25	2.26	81
中期 (3-7)	317	98.63	98.89	4.16	1.02	1.37	1.36	4.07	4.04	4.07	86
長期 (7-)	29	94.86	95.16	8.35	0.96	1.68	1.64	8.01	7.94	8.00	76
長期 (7-11)	29	94.86	95.16	8.35	0.96	1.68	1.64	8.01	7.94	8.00	76
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AAA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA 格	30	100.35	100.99	2.02	1.37	1.20	1.21	1.98	1.97	1.98	91
短期 (1-3)	30	100.35	100.99	2.02	1.37	1.20	1.21	1.98	1.97	1.98	91
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
A 格	724	98.90	99.11	3.36	0.97	1.25	1.25	3.28	3.26	3.28	83
短期 (1-3)	378	99.44	99.59	2.31	0.92	1.13	1.12	2.28	2.27	2.28	80
中期 (3-7)	317	98.63	98.89	4.16	1.02	1.37	1.36	4.07	4.04	4.07	86
長期 (7-)	29	94.86	95.16	8.35	0.96	1.68	1.64	8.01	7.94	8.00	76
長期 (7-11)	29	94.86	95.16	8.35	0.96	1.68	1.64	8.01	7.94	8.00	76
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
BBB 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
BB 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
B 格以下	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
格付なし	2,324	98.98	99.22	3.91	1.05	1.28	1.27	3.70	3.67	3.69	80
短期 (1-3)	1,196	99.73	99.94	2.19	0.93	1.04	1.04	2.17	2.16	2.17	73
中期 (3-7)	881	98.66	98.89	4.18	0.96	1.29	1.28	4.09	4.07	4.09	78
長期 (7-)	247	96.54	96.92	11.22	1.97	2.39	2.34	9.86	9.74	9.82	121
長期 (7-11)	121	96.43	96.83	8.59	1.43	1.94	1.90	8.06	7.98	8.05	100
超長期 (11-)	126	96.65	97.00	13.74	2.49	2.83	2.77	11.58	11.42	11.52	142

出所:NFRC

- 格付は、R&Iの格付をもとに NFRC で分類

円建外債 JCR 格付別・ポートフォリオ指標 (2024年6月末)

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
AAA~AA 格	260	99.22	99.54	3.44	1.03	1.21	1.20	3.31	3.29	3.31	78
短期 (1-3)	165	99.82	100.19	2.31	0.94	1.05	1.04	2.28	2.27	2.28	72
中期 (3-7)	73	98.99	99.17	4.26	1.12	1.37	1.36	4.16	4.13	4.16	86
長期 (7-)	22	95.57	95.95	9.14	1.36	1.95	1.91	8.42	8.34	8.41	98
長期 (7-11)	18	95.80	96.13	7.94	1.21	1.82	1.79	7.55	7.49	7.55	96
超長期 (11-)	4	94.59	95.17	14.26	1.99	2.51	2.44	12.20	12.05	12.13	104
AAA~A 格	1,000	98.55	98.85	4.60	1.32	1.60	1.58	4.21	4.17	4.20	106
短期 (1-3)	527	99.85	100.13	2.26	1.16	1.24	1.23	2.23	2.22	2.23	92
中期 (3-7)	288	97.84	98.13	4.18	1.10	1.63	1.61	4.08	4.05	4.08	112
長期 (7-)	186	95.95	96.33	11.87	2.14	2.63	2.56	10.28	10.15	10.24	138
長期 (7-11)	73	95.52	96.00	8.51	1.62	2.26	2.21	7.90	7.81	7.89	133
超長期 (11-)	113	96.23	96.55	14.03	2.48	2.86	2.79	11.80	11.64	11.73	141
AAA~BBB 格	1,000	98.55	98.85	4.60	1.32	1.60	1.58	4.21	4.17	4.20	106
短期 (1-3)	527	99.85	100.13	2.26	1.16	1.24	1.23	2.23	2.22	2.23	92
中期 (3-7)	288	97.84	98.13	4.18	1.10	1.63	1.61	4.08	4.05	4.08	112
長期 (7-)	186	95.95	96.33	11.87	2.14	2.63	2.56	10.28	10.15	10.24	138
長期 (7-11)	73	95.52	96.00	8.51	1.62	2.26	2.21	7.90	7.81	7.89	133
超長期 (11-)	113	96.23	96.55	14.03	2.48	2.86	2.79	11.80	11.64	11.73	141
AAA~BB 格	1,000	98.55	98.85	4.60	1.32	1.60	1.58	4.21	4.17	4.20	106
短期 (1-3)	527	99.85	100.13	2.26	1.16	1.24	1.23	2.23	2.22	2.23	92
中期 (3-7)	288	97.84	98.13	4.18	1.10	1.63	1.61	4.08	4.05	4.08	112
長期 (7-)	186	95.95	96.33	11.87	2.14	2.63	2.56	10.28	10.15	10.24	138
長期 (7-11)	73	95.52	96.00	8.51	1.62	2.26	2.21	7.90	7.81	7.89	133
超長期 (11-)	113	96.23	96.55	14.03	2.48	2.86	2.79	11.80	11.64	11.73	141
AAA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA 格	260	99.22	99.54	3.44	1.03	1.21	1.20	3.31	3.29	3.31	78
短期 (1-3)	165	99.82	100.19	2.31	0.94	1.05	1.04	2.28	2.27	2.28	72
中期 (3-7)	73	98.99	99.17	4.26	1.12	1.37	1.36	4.16	4.13	4.16	86
長期 (7-)	22	95.57	95.95	9.14	1.36	1.95	1.91	8.42	8.34	8.41	98
長期 (7-11)	18	95.80	96.13	7.94	1.21	1.82	1.79	7.55	7.49	7.55	96
超長期 (11-)	4	94.59	95.17	14.26	1.99	2.51	2.44	12.20	12.05	12.13	104
A 格	740	98.32	98.61	5.00	1.43	1.74	1.72	4.53	4.49	4.52	115
短期 (1-3)	362	99.87	100.10	2.24	1.26	1.32	1.32	2.21	2.19	2.21	100
中期 (3-7)	215	97.45	97.77	4.16	1.10	1.72	1.70	4.05	4.02	4.05	121
長期 (7-)	163	96.01	96.39	12.24	2.25	2.72	2.65	10.53	10.39	10.48	144
長期 (7-11)	55	95.42	95.95	8.70	1.75	2.41	2.35	8.01	7.92	8.00	145
超長期 (11-)	109	96.30	96.60	14.02	2.50	2.87	2.80	11.79	11.62	11.72	143
BBB 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
BB 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
B 格以下	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
格付なし	2,090	99.18	99.39	3.35	0.90	1.11	1.11	3.27	3.25	3.27	69
短期 (1-3)	1,028	99.59	99.75	2.13	0.83	0.98	0.98	2.11	2.10	2.11	67
中期 (3-7)	971	98.94	99.18	4.10	0.93	1.20	1.19	4.02	4.00	4.02	70
長期 (7-)	91	97.20	97.54	8.96	1.29	1.69	1.67	8.42	8.35	8.41	73
長期 (7-11)	78	96.70	96.98	8.58	1.07	1.54	1.52	8.19	8.12	8.18	62
超長期 (11-)	13	100.23	100.90	11.24	2.60	2.57	2.57	9.76	9.64	9.73	142

出所:NFRC

- 格付は、JCR の格付をもとに NFRC で分類

円建外債 JCR 格付別・ポートフォリオ指標 (2024年6月末、7月ポートフォリオ)

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
AAA~AA 格	255	99.21	99.54	3.48	1.04	1.22	1.22	3.35	3.33	3.35	79
短期 (1-3)	160	99.82	100.20	2.35	0.96	1.06	1.06	2.32	2.30	2.32	73
中期 (3-7)	73	98.99	99.17	4.26	1.12	1.37	1.36	4.16	4.13	4.16	86
長期 (7-)	22	95.57	95.95	9.14	1.36	1.95	1.91	8.42	8.34	8.41	98
長期 (7-11)	18	95.80	96.13	7.94	1.21	1.82	1.79	7.55	7.49	7.55	96
超長期 (11-)	4	94.59	95.17	14.26	1.99	2.51	2.44	12.20	12.05	12.13	104
AAA~A 格	994	98.54	98.84	4.62	1.33	1.60	1.59	4.23	4.19	4.22	106
短期 (1-3)	521	99.85	100.13	2.27	1.16	1.24	1.24	2.24	2.23	2.24	92
中期 (3-7)	288	97.84	98.13	4.18	1.10	1.63	1.61	4.08	4.05	4.08	112
長期 (7-)	186	95.95	96.33	11.87	2.14	2.63	2.56	10.28	10.15	10.24	138
長期 (7-11)	73	95.52	96.00	8.51	1.62	2.26	2.21	7.90	7.81	7.89	133
超長期 (11-)	113	96.23	96.55	14.03	2.48	2.86	2.79	11.80	11.64	11.73	141
AAA~BBB 格	994	98.54	98.84	4.62	1.33	1.60	1.59	4.23	4.19	4.22	106
短期 (1-3)	521	99.85	100.13	2.27	1.16	1.24	1.24	2.24	2.23	2.24	92
中期 (3-7)	288	97.84	98.13	4.18	1.10	1.63	1.61	4.08	4.05	4.08	112
長期 (7-)	186	95.95	96.33	11.87	2.14	2.63	2.56	10.28	10.15	10.24	138
長期 (7-11)	73	95.52	96.00	8.51	1.62	2.26	2.21	7.90	7.81	7.89	133
超長期 (11-)	113	96.23	96.55	14.03	2.48	2.86	2.79	11.80	11.64	11.73	141
AAA~BB 格	994	98.54	98.84	4.62	1.33	1.60	1.59	4.23	4.19	4.22	106
短期 (1-3)	521	99.85	100.13	2.27	1.16	1.24	1.24	2.24	2.23	2.24	92
中期 (3-7)	288	97.84	98.13	4.18	1.10	1.63	1.61	4.08	4.05	4.08	112
長期 (7-)	186	95.95	96.33	11.87	2.14	2.63	2.56	10.28	10.15	10.24	138
長期 (7-11)	73	95.52	96.00	8.51	1.62	2.26	2.21	7.90	7.81	7.89	133
超長期 (11-)	113	96.23	96.55	14.03	2.48	2.86	2.79	11.80	11.64	11.73	141
AAA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA 格	255	99.21	99.54	3.48	1.04	1.22	1.22	3.35	3.33	3.35	79
短期 (1-3)	160	99.82	100.20	2.35	0.96	1.06	1.06	2.32	2.30	2.32	73
中期 (3-7)	73	98.99	99.17	4.26	1.12	1.37	1.36	4.16	4.13	4.16	86
長期 (7-)	22	95.57	95.95	9.14	1.36	1.95	1.91	8.42	8.34	8.41	98
長期 (7-11)	18	95.80	96.13	7.94	1.21	1.82	1.79	7.55	7.49	7.55	96
超長期 (11-)	4	94.59	95.17	14.26	1.99	2.51	2.44	12.20	12.05	12.13	104
A 格	739	98.31	98.60	5.01	1.43	1.74	1.72	4.54	4.49	4.53	115
短期 (1-3)	361	99.87	100.10	2.24	1.25	1.32	1.32	2.21	2.20	2.21	100
中期 (3-7)	215	97.45	97.77	4.16	1.10	1.72	1.70	4.05	4.02	4.05	121
長期 (7-)	163	96.01	96.39	12.24	2.25	2.72	2.65	10.53	10.39	10.48	144
長期 (7-11)	55	95.42	95.95	8.70	1.75	2.41	2.35	8.01	7.92	8.00	145
超長期 (11-)	109	96.30	96.60	14.02	2.50	2.87	2.80	11.79	11.62	11.72	143
BBB 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
BB 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
B 格以下	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
格付なし	2,084	99.18	99.39	3.35	0.89	1.11	1.11	3.27	3.25	3.27	69
短期 (1-3)	1,084	99.58	99.76	2.19	0.83	0.98	0.98	2.17	2.16	2.17	67
中期 (3-7)	910	98.91	99.13	4.17	0.94	1.21	1.20	4.09	4.07	4.09	71
長期 (7-)	91	97.20	97.54	8.96	1.29	1.69	1.67	8.42	8.35	8.41	73
長期 (7-11)	78	96.70	96.98	8.58	1.07	1.54	1.52	8.19	8.12	8.18	62
超長期 (11-)	13	100.23	100.90	11.24	2.60	2.57	2.57	9.76	9.64	9.73	142

出所:NFRC

- 格付は、JCR の格付をもとに NFRC で分類

円建外債 Moody's 格付別・ポートフォリオ指標 (2024年6月末)

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
AAA~AA 格	1,191	99.34	99.53	3.32	0.78	0.97	0.97	3.25	3.23	3.25	55
短期 (1-3)	581	99.65	99.82	1.99	0.64	0.81	0.81	1.98	1.97	1.98	52
中期 (3-7)	554	99.23	99.44	4.19	0.90	1.09	1.09	4.10	4.08	4.10	59
長期 (7-)	56	97.23	97.50	8.58	1.07	1.48	1.46	8.18	8.12	8.18	55
長期 (7-11)	56	97.23	97.50	8.58	1.07	1.48	1.46	8.18	8.12	8.18	55
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AAA~A 格	2,112	99.55	99.75	3.62	0.97	1.10	1.09	3.48	3.46	3.48	65
短期 (1-3)	1,092	99.85	100.02	2.14	0.87	0.93	0.93	2.12	2.11	2.12	62
中期 (3-7)	851	99.15	99.36	4.10	0.94	1.15	1.14	4.02	3.99	4.02	65
長期 (7-)	168	99.63	99.94	10.77	1.79	1.92	1.92	9.65	9.55	9.61	83
長期 (7-11)	96	96.72	96.99	8.58	1.10	1.57	1.55	8.17	8.11	8.16	64
超長期 (11-)	72	103.54	103.92	13.73	2.72	2.37	2.40	11.50	11.36	11.43	106
AAA~BBB 格	2,840	99.04	99.28	3.84	1.02	1.23	1.22	3.65	3.62	3.65	76
短期 (1-3)	1,368	99.78	99.98	2.18	0.90	0.99	0.99	2.16	2.15	2.16	68
中期 (3-7)	1,204	98.78	99.03	4.12	0.96	1.27	1.26	4.03	4.01	4.03	77
長期 (7-)	269	96.47	96.84	11.01	1.88	2.32	2.27	9.73	9.62	9.70	116
長期 (7-11)	143	96.32	96.70	8.60	1.35	1.87	1.83	8.09	8.01	8.08	93
超長期 (11-)	126	96.65	97.00	13.74	2.49	2.83	2.77	11.58	11.42	11.52	142
AAA~BB 格	2,840	99.04	99.28	3.84	1.02	1.23	1.22	3.65	3.62	3.65	76
短期 (1-3)	1,368	99.78	99.98	2.18	0.90	0.99	0.99	2.16	2.15	2.16	68
中期 (3-7)	1,204	98.78	99.03	4.12	0.96	1.27	1.26	4.03	4.01	4.03	77
長期 (7-)	269	96.47	96.84	11.01	1.88	2.32	2.27	9.73	9.62	9.70	116
長期 (7-11)	143	96.32	96.70	8.60	1.35	1.87	1.83	8.09	8.01	8.08	93
超長期 (11-)	126	96.65	97.00	13.74	2.49	2.83	2.77	11.58	11.42	11.52	142
AAA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA 格	1,191	99.34	99.53	3.32	0.78	0.97	0.97	3.25	3.23	3.25	55
短期 (1-3)	581	99.65	99.82	1.99	0.64	0.81	0.81	1.98	1.97	1.98	52
中期 (3-7)	554	99.23	99.44	4.19	0.90	1.09	1.09	4.10	4.08	4.10	59
長期 (7-)	56	97.23	97.50	8.58	1.07	1.48	1.46	8.18	8.12	8.18	55
長期 (7-11)	56	97.23	97.50	8.58	1.07	1.48	1.46	8.18	8.12	8.18	55
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
A 格	921	99.82	100.03	4.00	1.21	1.25	1.25	3.78	3.75	3.77	77
短期 (1-3)	512	100.09	100.26	2.31	1.13	1.06	1.06	2.29	2.27	2.29	73
中期 (3-7)	297	99.00	99.22	3.93	1.00	1.25	1.24	3.85	3.83	3.85	77
長期 (7-)	112	100.83	101.16	11.87	2.15	2.14	2.15	10.35	10.24	10.30	96
長期 (7-11)	40	96.01	96.27	8.57	1.13	1.70	1.67	8.15	8.08	8.15	77
超長期 (11-)	72	103.54	103.92	13.73	2.72	2.37	2.40	11.50	11.36	11.43	106
BBB 格	729	97.56	97.92	4.47	1.16	1.63	1.60	4.14	4.10	4.14	109
短期 (1-3)	275	99.46	99.81	2.34	1.00	1.24	1.24	2.31	2.30	2.31	91
中期 (3-7)	353	97.88	98.22	4.16	1.03	1.57	1.55	4.07	4.03	4.07	105
長期 (7-)	101	91.20	91.65	11.40	2.04	3.04	2.90	9.88	9.74	9.85	177
長期 (7-11)	46	95.49	96.10	8.64	1.86	2.49	2.44	7.91	7.81	7.90	154
超長期 (11-)	54	87.55	87.86	13.76	2.19	3.55	3.33	11.72	11.53	11.66	197
BB 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
B 格以下	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
格付なし	250	98.29	98.48	2.76	1.21	1.71	1.70	2.68	2.66	2.68	134
短期 (1-3)	187	98.97	99.13	2.14	1.25	1.63	1.63	2.11	2.09	2.11	132
中期 (3-7)	55	96.78	97.04	4.18	1.09	1.91	1.88	4.07	4.03	4.07	139
長期 (7-)	8	92.58	92.97	7.66	1.15	2.29	2.21	7.31	7.23	7.31	141
長期 (7-11)	8	92.58	92.97	7.66	1.15	2.29	2.21	7.31	7.23	7.31	141
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

出所:NFRC

- 格付は、Moody's の格付をもとに NFRC で分類

円建外債 Moody's 格付別・ポートフォリオ指標 (2024年6月末、7月ポートフォリオ)

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
AAA~AA 格	1,185	99.34	99.53	3.33	0.78	0.97	0.97	3.26	3.24	3.26	55
短期 (1-3)	575	99.65	99.82	2.00	0.64	0.81	0.81	1.99	1.98	1.99	51
中期 (3-7)	554	99.23	99.44	4.19	0.90	1.09	1.09	4.10	4.08	4.10	59
長期 (7-)	56	97.23	97.50	8.58	1.07	1.48	1.46	8.18	8.12	8.18	55
長期 (7-11)	56	97.23	97.50	8.58	1.07	1.48	1.46	8.18	8.12	8.18	55
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AAA~A 格	2,106	99.55	99.75	3.62	0.97	1.09	1.09	3.49	3.47	3.49	65
短期 (1-3)	1,148	99.84	100.02	2.19	0.87	0.93	0.93	2.17	2.16	2.17	62
中期 (3-7)	790	99.12	99.32	4.18	0.94	1.16	1.15	4.10	4.07	4.10	65
長期 (7-)	168	99.63	99.94	10.77	1.79	1.92	1.92	9.65	9.55	9.61	83
長期 (7-11)	96	96.72	96.99	8.58	1.10	1.57	1.55	8.17	8.11	8.16	64
超長期 (11-)	72	103.54	103.92	13.73	2.72	2.37	2.40	11.50	11.36	11.43	106
AAA~BBB 格	2,833	99.04	99.28	3.84	1.02	1.23	1.22	3.66	3.63	3.65	76
短期 (1-3)	1,422	99.76	99.98	2.22	0.89	0.99	0.99	2.20	2.19	2.20	67
中期 (3-7)	1,142	98.74	98.98	4.18	0.97	1.28	1.27	4.09	4.06	4.09	78
長期 (7-)	269	96.47	96.84	11.01	1.88	2.32	2.27	9.73	9.62	9.70	116
長期 (7-11)	143	96.32	96.70	8.60	1.35	1.87	1.83	8.09	8.01	8.08	93
超長期 (11-)	126	96.65	97.00	13.74	2.49	2.83	2.77	11.58	11.42	11.52	142
AAA~BB 格	2,833	99.04	99.28	3.84	1.02	1.23	1.22	3.66	3.63	3.65	76
短期 (1-3)	1,422	99.76	99.98	2.22	0.89	0.99	0.99	2.20	2.19	2.20	67
中期 (3-7)	1,142	98.74	98.98	4.18	0.97	1.28	1.27	4.09	4.06	4.09	78
長期 (7-)	269	96.47	96.84	11.01	1.88	2.32	2.27	9.73	9.62	9.70	116
長期 (7-11)	143	96.32	96.70	8.60	1.35	1.87	1.83	8.09	8.01	8.08	93
超長期 (11-)	126	96.65	97.00	13.74	2.49	2.83	2.77	11.58	11.42	11.52	142
AAA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA 格	1,185	99.34	99.53	3.33	0.78	0.97	0.97	3.26	3.24	3.26	55
短期 (1-3)	575	99.65	99.82	2.00	0.64	0.81	0.81	1.99	1.98	1.99	51
中期 (3-7)	554	99.23	99.44	4.19	0.90	1.09	1.09	4.10	4.08	4.10	59
長期 (7-)	56	97.23	97.50	8.58	1.07	1.48	1.46	8.18	8.12	8.18	55
長期 (7-11)	56	97.23	97.50	8.58	1.07	1.48	1.46	8.18	8.12	8.18	55
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
A 格	921	99.82	100.03	4.00	1.21	1.25	1.25	3.78	3.75	3.77	77
短期 (1-3)	573	100.02	100.22	2.39	1.10	1.06	1.06	2.36	2.35	2.36	72
中期 (3-7)	236	98.87	99.04	4.17	1.04	1.31	1.30	4.08	4.06	4.08	80
長期 (7-)	112	100.83	101.16	11.87	2.15	2.14	2.15	10.35	10.24	10.30	96
長期 (7-11)	40	96.01	96.27	8.57	1.13	1.70	1.67	8.15	8.08	8.15	77
超長期 (11-)	72	103.54	103.92	13.73	2.72	2.37	2.40	11.50	11.36	11.43	106
BBB 格	727	97.55	97.91	4.48	1.16	1.63	1.60	4.15	4.11	4.14	109
短期 (1-3)	274	99.46	99.81	2.35	0.99	1.24	1.23	2.32	2.30	2.32	91
中期 (3-7)	353	97.88	98.22	4.16	1.03	1.57	1.55	4.07	4.03	4.07	105
長期 (7-)	101	91.20	91.65	11.40	2.04	3.04	2.90	9.88	9.74	9.85	177
長期 (7-11)	46	95.49	96.10	8.64	1.86	2.49	2.44	7.91	7.81	7.90	154
超長期 (11-)	54	87.55	87.86	13.76	2.19	3.55	3.33	11.72	11.53	11.66	197
BB 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
B 格以下	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
格付なし	245	98.26	98.45	2.79	1.22	1.73	1.72	2.72	2.69	2.72	136
短期 (1-3)	182	98.95	99.11	2.17	1.27	1.66	1.65	2.14	2.12	2.14	134
中期 (3-7)	55	96.78	97.04	4.18	1.09	1.91	1.88	4.07	4.03	4.07	139
長期 (7-)	8	92.58	92.97	7.66	1.15	2.29	2.21	7.31	7.23	7.31	141
長期 (7-11)	8	92.58	92.97	7.66	1.15	2.29	2.21	7.31	7.23	7.31	141
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

出所:NFRC

- 格付は、Moody's の格付をもとに NFRC で分類

円建外債 S&P 格付別・ポートフォリオ指標 (2024年6月末)

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
AAA~AA 格	233	99.14	99.39	3.46	0.73	0.95	0.95	3.39	3.37	3.39	52
短期 (1-3)	122	99.69	99.96	2.14	0.69	0.83	0.83	2.12	2.11	2.12	52
中期 (3-7)	98	98.75	98.97	4.42	0.74	1.05	1.05	4.35	4.32	4.35	53
長期 (7-)	14	97.03	97.33	8.38	0.94	1.38	1.36	8.05	8.00	8.05	47
長期 (7-11)	14	97.03	97.33	8.38	0.94	1.38	1.36	8.05	8.00	8.05	47
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AAA~A 格	2,021	99.55	99.74	3.61	0.95	1.09	1.08	3.48	3.46	3.48	64
短期 (1-3)	1,034	99.82	99.98	2.18	0.84	0.92	0.92	2.16	2.15	2.16	61
中期 (3-7)	837	99.16	99.38	4.09	0.93	1.14	1.14	4.01	3.98	4.01	65
長期 (7-)	150	99.86	100.16	10.86	1.78	1.88	1.89	9.71	9.62	9.68	79
長期 (7-11)	88	96.89	97.17	8.58	1.11	1.56	1.53	8.17	8.11	8.16	63
超長期 (11-)	62	104.11	104.43	14.13	2.73	2.32	2.36	11.78	11.64	11.71	99
AAA~BBB 格	3,009	98.97	99.21	3.79	1.03	1.26	1.25	3.61	3.58	3.60	79
短期 (1-3)	1,488	99.68	99.88	2.19	0.92	1.04	1.04	2.17	2.16	2.17	73
中期 (3-7)	1,246	98.70	98.95	4.12	0.97	1.29	1.29	4.03	4.01	4.03	79
長期 (7-)	274	96.40	96.76	10.94	1.88	2.32	2.27	9.68	9.57	9.65	117
長期 (7-11)	148	96.18	96.56	8.56	1.35	1.89	1.86	8.06	7.98	8.05	96
超長期 (11-)	126	96.65	97.00	13.74	2.49	2.83	2.77	11.58	11.42	11.52	142
AAA~BB 格	3,009	98.97	99.21	3.79	1.03	1.26	1.25	3.61	3.58	3.60	79
短期 (1-3)	1,488	99.68	99.88	2.19	0.92	1.04	1.04	2.17	2.16	2.17	73
中期 (3-7)	1,246	98.70	98.95	4.12	0.97	1.29	1.29	4.03	4.01	4.03	79
長期 (7-)	274	96.40	96.76	10.94	1.88	2.32	2.27	9.68	9.57	9.65	117
長期 (7-11)	148	96.18	96.56	8.56	1.35	1.89	1.86	8.06	7.98	8.05	96
超長期 (11-)	126	96.65	97.00	13.74	2.49	2.83	2.77	11.58	11.42	11.52	142
AAA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA 格	233	99.14	99.39	3.46	0.73	0.95	0.95	3.39	3.37	3.39	52
短期 (1-3)	122	99.69	99.96	2.14	0.69	0.83	0.83	2.12	2.11	2.12	52
中期 (3-7)	98	98.75	98.97	4.42	0.74	1.05	1.05	4.35	4.32	4.35	53
長期 (7-)	14	97.03	97.33	8.38	0.94	1.38	1.36	8.05	8.00	8.05	47
長期 (7-11)	14	97.03	97.33	8.38	0.94	1.38	1.36	8.05	8.00	8.05	47
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
A 格	1,788	99.60	99.79	3.63	0.98	1.10	1.10	3.50	3.47	3.49	66
短期 (1-3)	912	99.84	99.98	2.18	0.86	0.94	0.94	2.16	2.15	2.16	63
中期 (3-7)	739	99.21	99.43	4.04	0.96	1.15	1.15	3.96	3.94	3.96	66
長期 (7-)	136	100.14	100.44	11.11	1.86	1.93	1.94	9.88	9.78	9.84	82
長期 (7-11)	75	96.87	97.14	8.61	1.14	1.59	1.57	8.19	8.13	8.18	66
超長期 (11-)	62	104.11	104.43	14.13	2.73	2.32	2.36	11.78	11.64	11.71	99
BBB 格	988	97.80	98.11	4.15	1.18	1.62	1.60	3.87	3.83	3.86	111
短期 (1-3)	454	99.36	99.64	2.23	1.08	1.31	1.30	2.20	2.19	2.20	99
中期 (3-7)	410	97.76	98.08	4.19	1.05	1.61	1.59	4.09	4.05	4.09	110
長期 (7-)	124	92.21	92.66	11.04	1.99	2.90	2.78	9.64	9.50	9.60	167
長期 (7-11)	60	95.13	95.66	8.54	1.70	2.39	2.34	7.89	7.80	7.88	145
超長期 (11-)	64	89.48	89.87	13.36	2.26	3.39	3.21	11.37	11.19	11.31	189
BB 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
B 格以下	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
格付なし	81	99.16	99.43	2.29	1.35	1.63	1.63	2.24	2.22	2.24	131
短期 (1-3)	67	99.65	99.94	1.79	1.45	1.66	1.65	1.76	1.74	1.76	138
中期 (3-7)	13	97.75	97.91	4.07	0.97	1.52	1.50	3.99	3.96	3.99	101
長期 (7-)	2	92.43	92.64	7.61	0.51	1.63	1.57	7.45	7.39	7.44	78
長期 (7-11)	2	92.43	92.64	7.61	0.51	1.63	1.57	7.45	7.39	7.44	78
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

出所:NFRC

- 格付は、S&P の格付をもとに NFRC で分類

円建外債 S&P 格付別・ポートフォリオ指標 (2024年6月末、7月ポートフォリオ)

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
AAA~AA 格	233	99.14	99.39	3.46	0.73	0.95	0.95	3.39	3.37	3.39	52
短期 (1-3)	122	99.69	99.96	2.14	0.69	0.83	0.83	2.12	2.11	2.12	52
中期 (3-7)	98	98.75	98.97	4.42	0.74	1.05	1.05	4.35	4.32	4.35	53
長期 (7-)	14	97.03	97.33	8.38	0.94	1.38	1.36	8.05	8.00	8.05	47
長期 (7-11)	14	97.03	97.33	8.38	0.94	1.38	1.36	8.05	8.00	8.05	47
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AAA~A 格	2,015	99.55	99.74	3.62	0.95	1.08	1.08	3.49	3.47	3.49	64
短期 (1-3)	1,090	99.80	99.98	2.23	0.84	0.93	0.93	2.21	2.20	2.21	61
中期 (3-7)	775	99.13	99.34	4.17	0.94	1.15	1.15	4.09	4.07	4.09	65
長期 (7-)	150	99.86	100.16	10.86	1.78	1.88	1.89	9.71	9.62	9.68	79
長期 (7-11)	88	96.89	97.17	8.58	1.11	1.56	1.53	8.17	8.11	8.16	63
超長期 (11-)	62	104.11	104.43	14.13	2.73	2.32	2.36	11.78	11.64	11.71	99
AAA~BBB 格	3,003	98.97	99.21	3.79	1.03	1.26	1.25	3.61	3.59	3.61	79
短期 (1-3)	1,544	99.67	99.88	2.23	0.91	1.04	1.04	2.21	2.20	2.21	72
中期 (3-7)	1,185	98.66	98.90	4.18	0.98	1.31	1.30	4.09	4.06	4.09	80
長期 (7-)	274	96.40	96.76	10.94	1.88	2.32	2.27	9.68	9.57	9.65	117
長期 (7-11)	148	96.18	96.56	8.56	1.35	1.89	1.86	8.06	7.98	8.05	96
超長期 (11-)	126	96.65	97.00	13.74	2.49	2.83	2.77	11.58	11.42	11.52	142
AAA~BB 格	3,003	98.97	99.21	3.79	1.03	1.26	1.25	3.61	3.59	3.61	79
短期 (1-3)	1,544	99.67	99.88	2.23	0.91	1.04	1.04	2.21	2.20	2.21	72
中期 (3-7)	1,185	98.66	98.90	4.18	0.98	1.31	1.30	4.09	4.06	4.09	80
長期 (7-)	274	96.40	96.76	10.94	1.88	2.32	2.27	9.68	9.57	9.65	117
長期 (7-11)	148	96.18	96.56	8.56	1.35	1.89	1.86	8.06	7.98	8.05	96
超長期 (11-)	126	96.65	97.00	13.74	2.49	2.83	2.77	11.58	11.42	11.52	142
AAA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA 格	233	99.14	99.39	3.46	0.73	0.95	0.95	3.39	3.37	3.39	52
短期 (1-3)	122	99.69	99.96	2.14	0.69	0.83	0.83	2.12	2.11	2.12	52
中期 (3-7)	98	98.75	98.97	4.42	0.74	1.05	1.05	4.35	4.32	4.35	53
長期 (7-)	14	97.03	97.33	8.38	0.94	1.38	1.36	8.05	8.00	8.05	47
長期 (7-11)	14	97.03	97.33	8.38	0.94	1.38	1.36	8.05	8.00	8.05	47
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
A 格	1,782	99.60	99.79	3.64	0.98	1.10	1.10	3.50	3.48	3.50	65
短期 (1-3)	968	99.81	99.98	2.24	0.86	0.94	0.94	2.22	2.21	2.22	62
中期 (3-7)	678	99.19	99.39	4.14	0.97	1.16	1.16	4.05	4.03	4.05	67
長期 (7-)	136	100.14	100.44	11.11	1.86	1.93	1.94	9.88	9.78	9.84	82
長期 (7-11)	75	96.87	97.14	8.61	1.14	1.59	1.57	8.19	8.13	8.18	66
超長期 (11-)	62	104.11	104.43	14.13	2.73	2.32	2.36	11.78	11.64	11.71	99
BBB 格	988	97.80	98.11	4.15	1.18	1.62	1.60	3.87	3.83	3.86	111
短期 (1-3)	454	99.36	99.64	2.23	1.08	1.31	1.30	2.20	2.19	2.20	99
中期 (3-7)	410	97.76	98.08	4.19	1.05	1.61	1.59	4.09	4.05	4.09	110
長期 (7-)	124	92.21	92.66	11.04	1.99	2.90	2.78	9.64	9.50	9.60	167
長期 (7-11)	60	95.13	95.66	8.54	1.70	2.39	2.34	7.89	7.80	7.88	145
超長期 (11-)	64	89.48	89.87	13.36	2.26	3.39	3.21	11.37	11.19	11.31	189
BB 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
B 格以下	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
格付なし	75	99.11	99.37	2.39	1.41	1.70	1.69	2.34	2.32	2.34	136
短期 (1-3)	61	99.63	99.92	1.86	1.53	1.73	1.73	1.83	1.81	1.83	145
中期 (3-7)	13	97.75	97.91	4.07	0.97	1.52	1.50	3.99	3.96	3.99	101
長期 (7-)	2	92.43	92.64	7.61	0.51	1.63	1.57	7.45	7.39	7.44	78
長期 (7-11)	2	92.43	92.64	7.61	0.51	1.63	1.57	7.45	7.39	7.44	78
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

出所:NFRC

- 格付は、S&P の格付をもとに NFRC で分類

NOMURA-BPI 総合・ポートフォリオ指標の推移

	2020年3月末	2021年3月末	2022年3月末	2023年3月末	2024年3月末	2024年6月末
銘柄数	13,875	14,702	15,303	15,524	16,009	16,054
額面(10億円)	970,751	1,016,799	1,055,162	1,084,026	1,123,852	1,130,158
時価単価(円)	108.41	106.49	104.20	101.51	98.40	95.70
利含単価(円)	108.53	106.60	104.31	101.62	98.50	95.84
残存年数(年)	9.85	9.89	10.02	10.17	10.21	10.25
利率(%)	0.89	0.83	0.79	0.77	0.78	0.79
単利(%)	0.08	0.14	0.27	0.43	0.73	1.00
複利(%)	0.08	0.14	0.27	0.43	0.72	0.97
Dur(年)	9.47	9.36	9.32	9.19	8.93	8.73
M-Dur	9.46	9.35	9.30	9.16	8.88	8.67
E-Dur	9.46	9.34	9.29	9.16	8.90	8.68
Tspd(bp)	5	4	3	5	4	4

出所:NFRFC

NOMURA-BPI の定義

NOMURA-BPI の銘柄組入基準

インデックス・ポートフォリオに組み入れられる銘柄は、各月のポートフォリオ確定日（毎月 25 日翌営業日か月末第 4 営業日の早い方）において以下の条件を満たしていなければならない。

- 国内発行の公募固定利付円貨債券（但し転換社債、ワラント付社債、資産担保証券、社債担保証券、ローン担保証券、ステップ・アップ債等を除く。なお、資産担保証券のうち、財政融資資金貸付金 ABS、生命保険会社の基金・劣後ローン債、投資法人債は組み入れ対象とする）
- 残存額面 10 億円以上、残存期間 1 年以上
- 事業債、円建外債、MBS、ABS は A 格相当以上の格付（格付投資情報センター、日本格付研究所、S&P、Moody's のいずれかから取得）

新規発行銘柄の組み入れは、国債は発行月の翌月、金融債は発行月の翌々月、その他一般債は発行月の翌々月に行う。なお、銘柄の入替は毎月月末に行い、翌月 1 か月間は組入銘柄は固定される。

累積投資収益指数の計算方法

ある時点における投資収益指数は以下の計算式から算出される。

$$BPI_{today} = BPI_{e.l.m.} \times \frac{MVLt_{today} + CF_{e.l.m.,today}}{MVLt_{e.l.m.}}$$

BPI_{today}	: 当日累積投資収益指数
$BPI_{e.l.m.}$: 前月末累積投資収益指数
$MVLt_{today}$: 当日経過利子込み時価総額
$MVLt_{e.l.m.}$: 前月末経過利子込み時価総額
$CF_{e.l.m.,today}$: 前月末から当日までのインカム収入と償還金の合計

各ポートフォリオの累積投資収益指数は以下の基準日を 100 としている。

基準日	ポートフォリオ
1983 年 12 月 28 日:	下記以外
1993 年 12 月 30 日:	「除く国債」
1995 年 12 月 29 日:	長期（7 年以上 11 年未満）、超長期（11 年以上）、 （11 年以上 15 年未満）、（15 年以上）
2003 年 03 月 31 日:	MBS
2008 年 03 月 31 日:	ABS
2017 年 12 月 29 日:	SDGs

ただし、

- 日付はすべて営業日ベース。
- 評価時価には JS Price(なければ野村証券評価・算定時価)を使用。
- 貸付債権担保住宅金融公庫債券 (RMBS) について、毎月 25 日に公表される翌月 10 日の償還額は NOMURA-BPI の計算上、翌月 10 日に償還金として計上する (RMBS の額面は、元利払日の 10 日に償還金の分、減ることになる)。
- 「除く MBS」の 2003 年 3 月以前の指数は、NOMURA-BPI の指数と同じ。
- 「除く ABS」の 2008 年 3 月以前の指数は、NOMURA-BPI の指数と同じ。
- 「除く MBS・ABS」の 2008 年 3 月以前の指数は、「除く MBS」の指数と同じ。

投資収益率の計算方法

ある時点 t における、ある過去時点 s からの投資収益率 $RETURNS_{s,t}$ は以下の計算式から算出される。

$$RETURNS_{s,t}(\%) = \left(\frac{BPI_t}{BPI_s} - 1 \right) \times \frac{365}{s \text{ から } t \text{ までの経過日数 (片端入れ)}} \times 100$$

ただし、 BPI_t 、 BPI_s は、時点 t 、 s における累積投資収益指数。

レポートの表記等について

投資収益率 投資収益指数

- 「前月末からの投資収益率」は、「2024年5月の月末営業日から2024年6月の月末営業日までの投資収益率(年率換算,%)」を指す。
- 「前年度末からの投資収益率」は、「2024年3月の月末営業日から2024年6月の月末営業日までの投資収益率(年率換算,%)」を指す。
- 「前年末からの投資収益率」は、「2023年12月の月末営業日から2024年6月の月末営業日までの投資収益率(年率換算,%)」を指す。

月間投資収益率

- 2024年5月の月末営業日から2024年6月の月末営業日までの投資収益率(年率換算,%)
- 2024年5月の月末営業日において、6月ポートフォリオに組み入れられるべき銘柄がない場合には「-」と表記。

ポートフォリオ指標

- 時価単価・利含単価・残存年数・利率は額面加重平均。単利・複利・Tspdは時価総額加重平均。Dur・M-Dur・E-Durは経過利子込時価総額加重平均。
- 「残存年数」は、「途中償還を考慮した平均残存年数」を指す。
- 「Dur」は、「デュレーション」を指す。
- 「M-Dur」は、「修正デュレーション」を指す。
- 「E-Dur」は、「実効デュレーション」を指す。
- 「Tspd」は、「Tスプレッド」を指す。
- 左ページには6月ポートフォリオの、右ページには7月ポートフォリオの、2024年6月の月末営業日における指標を掲載。

現存額

- NOMURA-BPIの国債の現存額は市中発行分のみとし、資金運用部引受分、日銀乗り換え分、郵便貯金特別会計金融自由化対策資金引受分、郵便局窓口販売分、郵便貯金資金による引受分、簡易生命保険特別会計の積立金による引受分、年金資金運用基金による引受分、簡易生命保険資金による引受分、および新型窓口販売分は除いている。
- NOMURA-BPIの商工債券(金融債)の現存額は、資金運用部引受分は除いているが、財政融資資金引受分(2001年4月以降発行分)は含む。

格付会社別ポートフォリオ指標

- 格付は格付投資情報センター(R&I)・日本格付研究所(JCR)・ムーディーズ(Moody's)・スタンダード・アンド・プアーズ(S&P)の個別銘柄格付をもとにNFRCで分類
- 対象はNOMURA-BPIの事業債・円建外債の構成銘柄

その他

- 短期・中期・長期などの残存別ポートフォリオは、2024年6月末(暦上)における残存年数(至最終償還日)で区分。ただし7月ポートフォリオでは、2024年7月末(暦上)における残存年数(至最終償還日)で区分。
- NOMURA-BPIは、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社の商標または登録商標です。

NOMURA-BPI のデータ提供について

NOMURA-BPI のデータは以下の情報端末でもご覧いただけます。

Quick-IS

NRIJ100, NRIJ101, NRIJ102, NRIJ103
NRIJ104, NRIJ105, NRIJ106, NRIJ107

REUTERS

NMSBPI メニュー

Bloomberg

NBPI(GO) メニュー

時事通信社

BPIG/12400

NFRC Web ページ

<http://qr.nomuraholdings.com/jp/bpi/index.html>

ディスクレイマー

NOMURA-BPI の知的財産権およびその他一切の権利は野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社（以下、NFRC）に帰属します。

なお、NFRC は、当インデックスの正確性、完全性、信頼性、有用性、市場性、商品性および適合性を保証するものではなく、インデックスの利用者およびその関連会社が当インデックスを用いて行う事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。

インデックスの算出において、電子計算機の障害もしくは天災地変その他やむを得ない事由が発生した場合は、インデックスの公表を延期または中止することがあります。

インデックス・データを取得した経路（当社ウェブサイト、情報ベンダー各社のサービスを通じた取得、等）に関わらず、これらのインデックスをご利用の際は、「インデックス・ライセンスについて」をご確認ください。

「インデックス・ライセンスについて」

<http://qr.nomuraholdings.com/jp/indexlicense.html>

本資料は、お客様への情報提供を目的として、NFRC が作成したものです。

本資料に掲載された全ての意見や予想は NFRC の本資料作成時点での判断に基づいており、通知なく変更されることがあります。また、本資料における将来の予測に関する意見が実際に生ずるということを担保あるいは保証するものではありません。本資料の内容の一部は、NFRC が信頼性があると判断した様々な入手可能な情報に基づいています。しかし、NFRC はその正確さを保証するものではなく、これらの情報は要約された不完全なものである可能性があります。過去の投資実績は将来の結果を示唆するものではありません。

本資料は特定の証券取引に関する投資勧誘や投資アドバイスを目的としたものでもありません。

NFRC が開発・提供する市場インデックス（自社関連インデックス）が使用されている運用商品等をお客様が投資対象とする場合、当該インデックス利用料の一部が直接的・間接的問わず NFRC に帰属する可能性があります。自社関連インデックスの詳細は以下のウェブサイトをご参照ください。

証券市場インデックス <http://qr.nomuraholdings.com/jp/>

本資料は、配布されたお客様限りでご使用ください。本資料は NFRC の著作物であり、NFRC の書面による事前の承諾なく、本資料の全部もしくは一部を複写、転送または再配布することをご遠慮ください。

野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社
金融商品取引業者 関東財務局長（金商）第 451 号
加入協会 一般社団法人日本投資顧問業協会会員番号（第 011-00961 号）

野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング
bpi@nfrco.jp