

月間投資収益率 (2024年10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 360.511	-5.95	-6.79	0.84	-2.76

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(%)

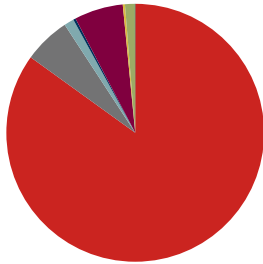
ポートフォリオ指標 (2024年10月末)

	翌月ポート (2024年11月)	当月ポート (2024年10月)	差
額面[兆円]	1155.27	1145.39	9.88
デュレーション[年]	8.71	8.68	0.03
修正デュレーション	8.65	8.62	0.03
時価単価[円]	96.28	96.27	0.02
利含単価[円]	96.46	96.45	0.02
残存年数[年]	10.23	10.19	0.04
利率[%]	0.82	0.81	0.00
単利[%]	0.98	0.98	0.00
複利[%]	0.95	0.95	0.00
Tスプレッド[bp]	4	4	0

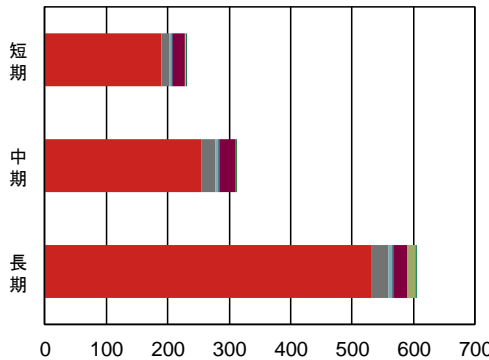
出所: NFRC

(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10月末)



残存別額面構成 (2024年10月末)



出所: NFRC

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	84.9%	5.8%	1.2%	0.3%	6.1%	0.3%	1.2%	0.1%
全体	972.94	66.92	14.20	3.43	70.17	3.13	13.95	0.65
短期	189.46	12.77	3.37	1.99	20.87	1.69	-	0.17
中期	253.41	24.75	4.17	1.27	26.12	1.16	-	0.30
長期	530.08	29.41	6.66	0.17	23.19	0.28	13.95	0.18

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10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	360.511	-5.95	-6.79	0.84	-2.76	-2.54
国債	370.841	-6.31	-7.18	0.86	-2.99	-2.77
地方債	388.443	-3.88	-4.51	0.63	-1.36	-1.29
政保債	362.695	-5.19	-5.95	0.76	-2.33	-1.97
金融債	273.039	-1.25	-1.57	0.31	-0.24	-0.46
事業債	386.656	-3.82	-4.59	0.77	-1.51	-1.12
円建外債	357.312	-1.55	-2.61	1.07	0.97	1.09
MBS	123.849	-4.69	-5.35	0.67	-2.01	-1.89
ABS	113.571	-2.46	-3.22	0.75	-0.36	-0.57

出所:NFRC

投資収益率は年率換算(%)

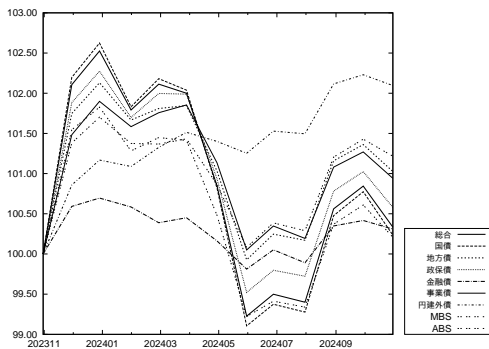
銘柄別・累積投資収益指数の推移

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
2023/10/31	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
2024/06/28	357.511	367.658	385.446	359.874	272.337	384.383	355.328	122.865	112.641
2024/07/31	357.155	367.297	385.149	359.607	271.899	383.791	355.212	122.774	112.532
2024/08/30	361.325	371.736	388.953	363.424	273.145	387.188	357.382	124.049	113.559
2024/09/30	362.344	372.840	389.729	364.301	273.331	387.914	357.782	124.344	113.809
2024/10/01	362.379	372.877	389.778	364.330	273.346	387.955	357.960	124.320	113.825
2024/10/02	363.103	373.646	390.482	365.025	273.535	388.523	358.265	124.537	113.989
2024/10/03	362.883	373.402	390.344	364.851	273.538	388.398	358.253	124.496	113.965
2024/10/04	362.571	373.079	389.945	364.552	273.447	388.130	358.047	124.375	113.869
2024/10/07	361.368	371.794	388.879	363.440	273.099	387.179	357.357	124.017	113.618
2024/10/08	361.357	371.782	388.866	363.411	273.110	387.171	357.642	124.011	113.617
2024/10/09	360.931	371.317	388.569	363.023	273.078	386.881	357.559	123.901	113.556
2024/10/10	360.182	370.503	388.007	362.354	272.969	386.359	357.306	123.717	113.439
2024/10/11	360.533	370.886	388.254	362.671	272.989	386.589	357.392	123.803	113.487
2024/10/15	360.157	370.487	387.870	362.310	272.913	386.307	357.246	123.667	113.404
2024/10/16	360.599	370.962	388.263	362.702	272.988	386.629	357.436	123.803	113.497
2024/10/17	360.552	370.933	388.045	362.614	272.894	386.520	357.171	123.738	113.432
2024/10/18	360.287	370.644	387.843	362.396	272.853	386.359	357.012	123.663	113.394
2024/10/21	360.425	370.775	388.119	362.544	272.942	386.522	357.314	123.740	113.471
2024/10/22	359.657	369.941	387.528	361.872	272.779	385.959	357.165	123.557	113.340
2024/10/23	359.642	369.924	387.531	361.841	272.795	385.937	357.189	123.562	113.345
2024/10/24	360.027	370.333	387.921	362.192	272.860	386.232	357.350	123.689	113.437
2024/10/25	360.448	370.797	388.182	362.568	272.897	386.514	357.477	123.763	113.489
2024/10/28	359.731	370.011	387.693	361.937	272.820	386.049	357.324	123.582	113.395
2024/10/29	359.754	370.038	387.687	361.963	272.852	386.071	357.243	123.568	113.396
2024/10/30	360.006	370.295	388.036	362.210	272.952	386.296	357.388	123.695	113.482
2024/10/31	360.511	370.841	388.443	362.695	273.039	386.656	357.312	123.849	113.571

出所:NFRC

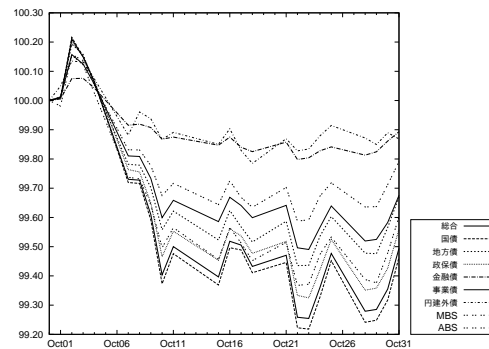
1983年12月末=100。MBSセクターは2003年3月末=100。ABSセクターは2008年3月末=100。

指数の推移(月次) 2023年10月末=100に補正。



出所:NFRC

指数の推移(日次) 2024年9月末=100に補正。



出所:NFRC

総合 残存別・投資収益率(2024年10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	360.511	-5.95	-6.79	0.84	-2.76	-2.54
短期 (1-3)	233.530	-0.67	-1.08	0.40	-0.29	-0.43
中期 (3-7)	335.904	-2.82	-3.46	0.65	-0.74	-1.03
長期 (7-)	527.468	-9.84	-10.96	1.12	-4.85	-4.21
長期 (7-11)	193.444	-4.03	-5.03	1.00	-0.89	-1.05
超長期 (11-)	231.933	-13.37	-14.56	1.20	-7.19	-6.06
(11-15)	223.423	-6.03	-7.03	1.00	-2.91	-2.41
(15-)	236.950	-15.99	-17.25	1.27	-8.71	-7.35

出所:NFRC

投資収益率は年率換算(%)

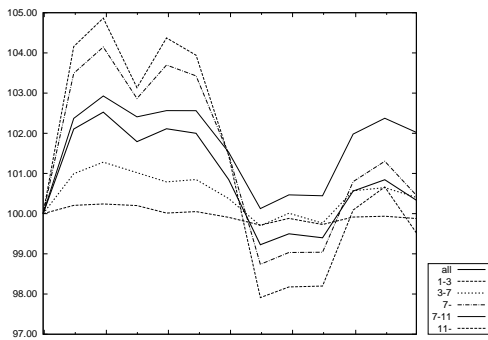
総合 残存別・投資収益指数の推移

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-)*
2023/10/31	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
2024/06/28	357.511	233.539	334.586	519.995	190.497	228.799	218.958	234.303
2024/07/31	357.155	233.183	333.757	520.024	190.452	228.852	219.331	234.235
2024/08/30	361.325	233.616	336.453	529.251	193.364	233.256	223.302	238.836
2024/09/30	362.344	233.664	336.709	531.914	194.109	234.596	224.573	240.212
2024/10/01	362.379	233.673	336.748	531.973	194.146	234.610	224.595	240.224
2024/10/02	363.103	233.768	337.099	533.660	194.672	235.420	225.463	241.018
2024/10/03	362.883	233.786	337.060	533.046	194.564	235.064	225.277	240.595
2024/10/04	362.571	233.765	336.795	532.399	194.200	234.872	224.884	240.478
2024/10/07	361.368	233.593	336.084	529.716	193.565	233.438	223.832	238.887
2024/10/08	361.357	233.606	336.078	529.679	193.569	233.408	223.736	238.882
2024/10/09	360.931	233.608	335.959	528.555	193.402	232.734	223.373	238.084
2024/10/10	360.182	233.566	335.707	526.659	193.027	231.665	222.787	236.822
2024/10/11	360.533	233.553	335.778	527.619	193.190	232.226	223.057	237.498
2024/10/15	360.157	233.525	335.572	526.741	192.875	231.835	222.646	237.112
2024/10/16	360.599	233.528	335.802	527.810	193.179	232.370	223.134	237.668
2024/10/17	360.552	233.485	335.577	527.913	193.017	232.561	222.904	238.023
2024/10/18	360.287	233.468	335.495	527.237	192.879	232.184	222.663	237.591
2024/10/21	360.425	233.498	335.714	527.415	193.106	232.144	222.912	237.439
2024/10/22	359.657	233.413	335.391	525.565	192.716	231.118	222.349	236.229
2024/10/23	359.642	233.433	335.417	525.480	192.756	231.029	222.379	236.094
2024/10/24	360.027	233.441	335.617	526.409	193.087	231.444	222.818	236.503
2024/10/25	360.448	233.447	335.696	527.545	193.247	232.132	223.063	237.366
2024/10/28	359.731	233.417	335.514	525.668	192.930	231.035	222.491	236.058
2024/10/29	359.754	233.449	335.518	525.702	192.895	231.084	222.404	236.160
2024/10/30	360.006	233.490	335.734	526.200	193.198	231.215	222.834	236.178
2024/10/31	360.511	233.530	335.904	527.468	193.444	231.933	223.423	236.950

出所:NFRC

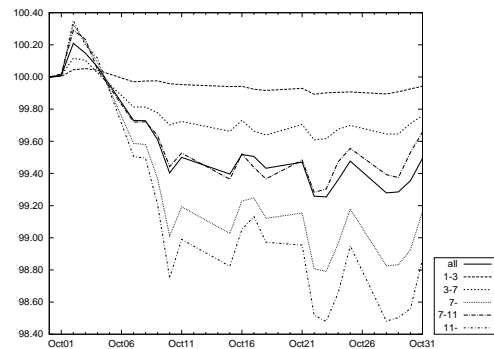
*は1995年12月末=100。それ以外は、1983年12月末=100。

指数の推移(月次) 2023年10月末=100に補正。



出所:NFRC

指数の推移(日次) 2024年9月末=100に補正。



出所:NFRC

国債 残存別・投資収益率 (2024 年 10 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	370.841	-6.31	-7.18	0.86	-2.99	-2.77
短期 (1-3)	220.814	-0.70	-1.10	0.40	-0.34	-0.48
中期 (3-7)	334.742	-2.86	-3.52	0.66	-0.80	-1.11
長期 (7-)	537.559	-10.24	-11.38	1.15	-5.10	-4.47
長期 (7-11)	191.969	-4.05	-5.06	1.01	-0.93	-1.14
超長期 (11-)	230.711	-13.96	-15.19	1.23	-7.54	-6.40
(11-15)	221.962	-6.02	-7.04	1.02	-2.97	-2.51
(15-)	235.892	-16.79	-18.10	1.31	-9.17	-7.79

出所:NFRC

投資収益率は年率換算 (%)

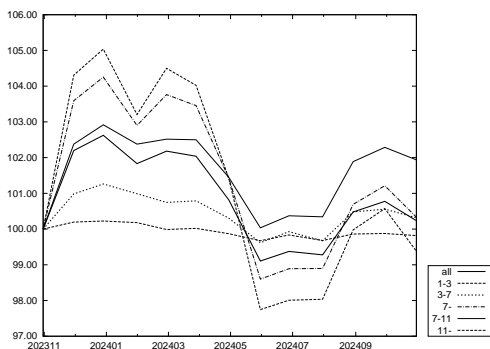
国債 残存別・投資収益指数の推移

国債 年/月/日	全体	短期 (1-3)	中期 (3-7)	長期 (7-)	長期*			
					(7-11)	超長期*	(11-15)*	(15-)*
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
2024/06/28	367.658	220.855	333.447	529.824	189.023	227.526	217.488	233.177
2024/07/31	367.297	220.511	332.596	529.860	188.969	227.590	217.871	233.119
2024/08/30	371.736	220.909	335.296	539.477	191.879	232.100	221.835	237.873
2024/09/30	372.840	220.946	335.557	542.274	192.631	233.479	223.103	239.305
2024/10/01	372.877	220.954	335.595	542.335	192.667	233.495	223.123	239.320
2024/10/02	373.646	221.044	335.946	544.081	193.191	234.317	223.993	240.130
2024/10/03	373.402	221.060	335.905	543.426	193.083	233.944	223.807	239.683
2024/10/04	373.079	221.040	335.639	542.777	192.720	233.762	223.415	239.579
2024/10/07	371.794	220.879	334.927	539.975	192.088	232.290	222.364	237.934
2024/10/08	371.782	220.890	334.920	539.939	192.092	232.262	222.267	237.933
2024/10/09	371.317	220.893	334.802	538.750	191.925	231.564	221.906	237.099
2024/10/10	370.503	220.853	334.550	536.749	191.554	230.455	221.322	235.781
2024/10/11	370.886	220.840	334.619	537.763	191.715	231.037	221.590	236.487
2024/10/15	370.487	220.813	334.411	536.861	191.401	230.644	221.180	236.098
2024/10/16	370.962	220.815	334.642	537.977	191.705	231.191	221.668	236.673
2024/10/17	370.933	220.775	334.417	538.123	191.543	231.410	221.440	237.064
2024/10/18	370.644	220.758	334.334	537.408	191.405	231.018	221.197	236.612
2024/10/21	370.775	220.786	334.552	537.561	191.630	230.959	221.445	236.435
2024/10/22	369.941	220.705	334.228	535.607	191.242	229.895	220.883	235.170
2024/10/23	369.924	220.724	334.257	535.519	191.284	229.803	220.919	235.029
2024/10/24	370.333	220.731	334.457	536.475	191.613	230.222	221.357	235.444
2024/10/25	370.797	220.736	334.533	537.685	191.772	230.942	221.600	236.352
2024/10/28	370.011	220.707	334.351	535.696	191.456	229.800	221.028	234.983
2024/10/29	370.038	220.737	334.354	535.740	191.421	229.856	220.940	235.095
2024/10/30	370.295	220.777	334.571	536.231	191.724	229.974	221.372	235.093
2024/10/31	370.841	220.814	334.742	537.559	191.969	230.711	221.962	235.892

出所:NFRC

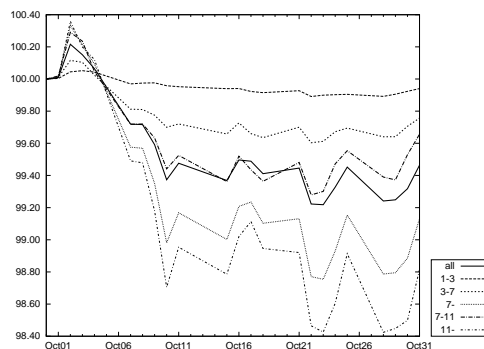
* は 1995 年 12 月末=100。それ以外は、1983 年 12 月末=100。

指数の推移 (月次) 2023 年 10 月末=100 に補正。



出所:NFRC

指数の推移 (日次) 2024 年 9 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10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	360.391	-5.97	-6.81	0.84	-2.77	-2.55
短期(1-3)	233.530	-0.67	-1.08	0.40	-0.29	-0.43
中期(3-7)	335.904	-2.82	-3.46	0.65	-0.74	-1.03
長期(7-)	529.304	-9.97	-11.10	1.13	-4.92	-4.27
長期(7-11)	193.440	-4.03	-5.04	1.00	-0.89	-1.05
超長期(11-)	233.593	-13.70	-14.92	1.22	-7.39	-6.22
(11-15)	223.412	-6.03	-7.03	1.00	-2.91	-2.41
(15-)	238.813	-16.59	-17.89	1.30	-9.07	-7.64

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(%)

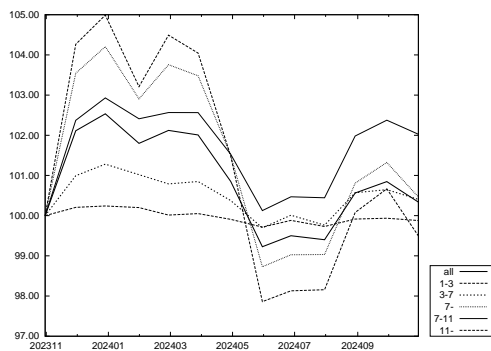
「除くMBS」残存別・投資収益指数の推移

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-)*
2023/10/31	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
2024/06/28	357.390	233.539	334.586	521.725	190.490	230.386	218.947	236.104
2024/07/31	357.033	233.183	333.757	521.764	190.445	230.448	219.320	236.041
2024/08/30	361.208	233.616	336.453	531.116	193.359	234.962	223.291	240.795
2024/09/30	362.228	233.664	336.709	533.823	194.105	236.343	224.562	242.227
2024/10/01	362.264	233.673	336.748	533.886	194.142	236.360	224.584	242.242
2024/10/02	362.989	233.768	337.099	535.598	194.669	237.191	225.452	243.062
2024/10/03	362.768	233.786	337.060	534.971	194.560	236.822	225.266	242.617
2024/10/04	362.456	233.765	336.795	534.318	194.196	236.630	224.873	242.506
2024/10/07	361.251	233.593	336.084	531.598	193.560	235.156	223.821	240.852
2024/10/08	361.241	233.606	336.078	531.561	193.565	235.125	223.725	240.848
2024/10/09	360.814	233.608	335.959	530.417	193.397	234.428	223.362	240.012
2024/10/10	360.063	233.566	335.707	528.487	193.022	233.323	222.776	238.691
2024/10/11	360.414	233.553	335.778	529.464	193.185	233.903	223.046	239.400
2024/10/15	360.038	233.525	335.572	528.576	192.870	233.504	222.635	239.003
2024/10/16	360.481	233.528	335.802	529.661	193.175	234.053	223.124	239.580
2024/10/17	360.436	233.485	335.577	529.773	193.012	234.259	222.893	239.964
2024/10/18	360.171	233.468	335.495	529.086	192.874	233.870	222.652	239.513
2024/10/21	360.308	233.498	335.714	529.261	193.101	233.822	222.901	239.343
2024/10/22	359.537	233.413	335.391	527.379	192.711	232.762	222.338	238.077
2024/10/23	359.521	233.433	335.417	527.291	192.751	232.669	222.368	237.933
2024/10/24	359.907	233.441	335.617	528.232	193.082	233.093	222.807	238.354
2024/10/25	360.330	233.447	335.696	529.392	193.242	233.808	223.052	239.263
2024/10/28	359.611	233.417	335.514	527.482	192.925	232.673	222.480	237.893
2024/10/29	359.635	233.449	335.518	527.518	192.890	232.725	222.393	238.003
2024/10/30	359.886	233.490	335.734	528.017	193.194	232.853	222.823	238.009
2024/10/31	360.391	233.530	335.904	529.304	193.440	233.593	223.412	238.813

出所:NFRC

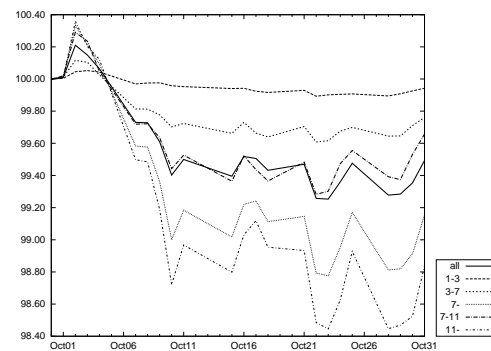
* は 1995 年 12 月末=100。それ以外は、1983 年 12 月末=100。

指数の推移(月次) 2023年10月末=100に補正。



出所:NFRC

指数の推移(日次) 2024年9月末=100に補正。



出所:NFRC

「除くABS」「SDGs」残存別・投資収益率(2024年10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	360.536	-5.96	-6.80	0.84	-2.76	-2.54
短期(1-3)	233.494	-0.68	-1.08	0.40	-0.29	-0.43
中期(3-7)	335.896	-2.82	-3.46	0.65	-0.74	-1.03
長期(7-)	527.465	-9.84	-10.97	1.12	-4.85	-4.21
長期(7-11)	193.438	-4.03	-5.03	1.00	-0.89	-1.05
超長期(11-)	231.930	-13.37	-14.56	1.20	-7.19	-6.06
(11-15)	223.414	-6.03	-7.03	1.00	-2.91	-2.41
(15-)	236.952	-15.99	-17.26	1.27	-8.71	-7.35
SDGs	98.768	-3.93	-4.54	0.61	-1.50	-1.29

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(%)

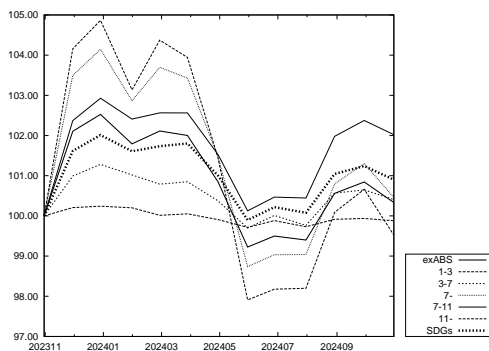
「除くABS」「SDGs」残存別投資収益指数の推移

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-)*	
2023/10/31	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
2024/06/28	357.535	233.504	334.578	519.993	190.491	228.797	218.950	234.305	98.099
2024/07/31	357.179	233.148	333.748	520.022	190.445	228.850	219.323	234.237	97.961
2024/08/30	361.350	233.581	336.445	529.249	193.358	233.253	223.294	238.838	98.908
2024/09/30	362.369	233.628	336.701	531.912	194.103	234.593	224.564	240.214	99.099
2024/10/01	362.404	233.637	336.739	531.971	194.140	234.608	224.586	240.226	99.108
2024/10/02	363.128	233.733	337.091	533.658	194.666	235.417	225.454	241.020	99.272
2024/10/03	362.908	233.750	337.051	533.044	194.558	235.062	225.268	240.597	99.245
2024/10/04	362.596	233.729	336.786	532.396	194.194	234.870	224.875	240.480	99.155
2024/10/07	361.392	233.557	336.075	529.714	193.558	233.435	223.823	238.888	98.892
2024/10/08	361.382	233.570	336.070	529.677	193.563	233.406	223.727	238.884	98.893
2024/10/09	360.956	233.573	335.950	528.553	193.395	232.732	223.365	238.086	98.822
2024/10/10	360.207	233.531	335.698	526.657	193.021	231.663	222.778	238.824	98.687
2024/10/11	360.558	233.517	335.770	527.616	193.184	232.224	223.049	237.500	98.745
2024/10/15	360.181	233.490	335.563	526.739	192.869	231.832	222.638	237.113	98.662
2024/10/16	360.623	233.493	335.793	527.808	193.173	232.367	223.126	237.670	98.751
2024/10/17	360.577	233.450	335.569	527.910	193.010	232.559	222.895	238.025	98.705
2024/10/18	360.312	233.433	335.487	527.235	192.872	232.181	222.654	237.592	98.657
2024/10/21	360.450	233.463	335.706	527.413	193.099	232.141	222.904	237.441	98.716
2024/10/22	359.681	233.378	335.383	525.562	192.710	231.116	222.340	236.231	98.569
2024/10/23	359.666	233.398	335.409	525.478	192.749	231.027	222.370	236.096	98.562
2024/10/24	360.052	233.405	335.608	526.406	193.080	231.442	222.810	236.505	98.648
2024/10/25	360.472	233.411	335.687	527.542	193.240	232.130	223.054	237.367	98.717
2024/10/28	359.756	233.382	335.506	525.665	192.924	231.032	222.483	236.060	98.599
2024/10/29	359.779	233.414	335.509	525.699	192.889	231.081	222.395	236.162	98.599
2024/10/30	360.031	233.455	335.725	526.197	193.192	231.212	222.825	236.180	98.675
2024/10/31	360.536	233.494	335.896	527.465	193.438	231.930	223.414	236.952	98.768

出所:NFRC

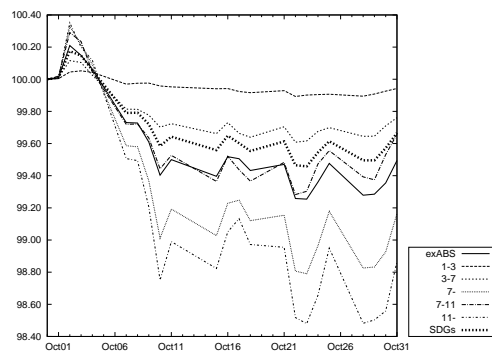
*は1995年12月末=100。**は2017年12月末=100。それ以外は、1983年12月末=100。

指数の推移(月次) 2023年10月末=100に補正。



出所:NFRC

指数の推移(日次) 2024年9月末=100に補正。



出所:NFRC

「除く国債」残存別・投資収益率(2024年10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	169.810	-3.93	-4.63	0.70	-1.49	-1.26
短期(1-3)	133.313	-0.54	-0.96	0.42	-0.06	-0.17
中期(3-7)	166.426	-2.61	-3.22	0.60	-0.50	-0.65
長期(7-)	230.816	-7.00	-7.95	0.95	-3.10	-2.38
長期(7-11)	199.038	-3.93	-4.88	0.95	-0.61	-0.44
超長期(11-)	233.173	-8.99	-9.93	0.94	-4.64	-3.57

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(%)

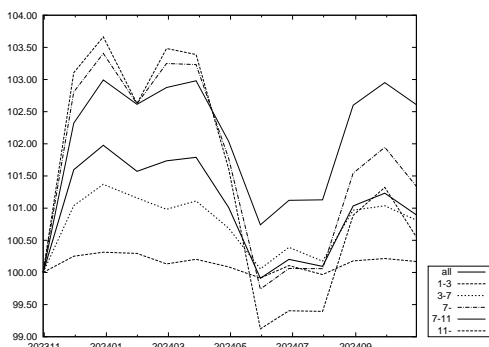
「除く国債」残存別・投資収益指数の推移

除く国債 年/月/日	全体	短期 (1-3)	中期 (3-7)	長期 (7-)	長期*	
					(7-11)	超長期* (11-)
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
2024/06/28	168.645	133.228	165.731	227.905	196.153	230.517
2024/07/31	168.463	133.042	165.375	227.898	196.168	230.494
2024/08/30	170.044	133.325	166.683	231.281	199.021	233.959
2024/09/30	170.378	133.374	166.796	232.197	199.705	234.967
2024/10/01	170.394	133.381	166.817	232.218	199.747	234.971
2024/10/02	170.672	133.436	166.989	232.878	200.279	235.664
2024/10/03	170.615	133.447	166.972	232.698	200.170	235.447
2024/10/04	170.471	133.435	166.846	232.381	199.812	235.191
2024/10/07	170.026	133.333	166.502	231.418	199.163	234.081
2024/10/08	170.023	133.344	166.502	231.397	199.172	234.040
2024/10/09	169.892	133.343	166.441	231.038	199.001	233.572
2024/10/10	169.654	133.319	166.318	230.418	198.613	232.834
2024/10/11	169.760	133.314	166.357	230.728	198.785	233.218
2024/10/15	169.612	133.302	166.262	230.366	198.471	232.854
2024/10/16	169.770	133.305	166.371	230.754	198.772	233.273
2024/10/17	169.699	133.279	166.262	230.672	198.605	233.262
2024/10/18	169.617	133.270	166.225	230.456	198.474	233.002
2024/10/21	169.712	133.291	166.333	230.621	198.706	233.101
2024/10/22	169.461	133.243	166.178	230.022	198.315	232.401
2024/10/23	169.457	133.254	166.184	229.992	198.339	232.332
2024/10/24	169.606	133.259	166.280	230.367	198.673	232.703
2024/10/25	169.725	133.264	166.324	230.702	198.840	233.135
2024/10/28	169.512	133.249	166.237	230.117	198.524	232.401
2024/10/29	169.514	133.268	166.242	230.100	198.490	232.397
2024/10/30	169.640	133.290	166.344	230.373	198.791	232.624
2024/10/31	169.810	133.313	166.426	230.816	199.038	233.173

出所:NFRC

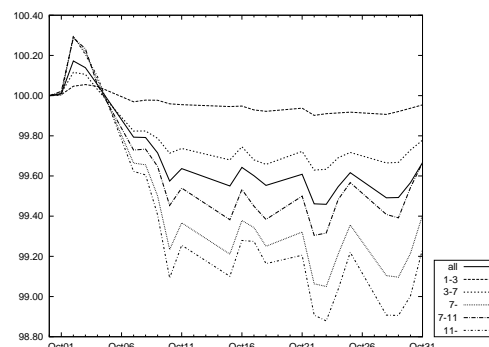
* は 1995年12月末=100。それ以外は、1993年12月末=100。

指数の推移(月次) 2023年10月末=100に補正。



出所:NFRC

指数の推移(日次) 2024年9月末=100に補正。



出所:NFRC

銘柄 残存別・月間投資収益率(2024年10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	-5.95	-0.67	-2.82	-9.84	-4.03	-13.37
国債	-6.31	-0.70	-2.86	-10.24	-4.05	-13.96
30年国債	-13.24	-	-3.50	-13.40	-3.78	-14.42
20年国債	-5.28	-0.76	-3.13	-6.66	-3.99	-8.37
10年国債	-2.88	-0.77	-3.07	-4.14	-4.14	-
5年国債	-1.37	-0.78	-2.03	-	-	-
中期国債	-0.35	-0.35	-	-	-	-
地方債	-3.88	-0.70	-2.89	-6.20	-4.06	-8.60
東京都債	-3.81	-0.64	-2.88	-6.76	-4.04	-10.88
五大都市債	-4.29	-0.73	-2.73	-7.07	-3.94	-8.68
その他地方債	-3.66	-0.69	-2.90	-5.71	-4.05	-7.72
政保債	-5.19	-0.75	-2.53	-9.41	-4.08	-11.97
公営企業債券	-1.36	-0.80	-2.03	-	-	-
その他政保債	-5.65	-0.73	-2.63	-9.41	-4.08	-11.97
金融債	-1.25	-0.54	-2.06	-3.64	-3.64	-
特定金融債	-	-	-	-	-	-
事業債	-3.82	-0.44	-2.42	-8.88	-3.72	-13.31
円建外債	-1.55	-0.31	-1.89	-7.61	-5.87	-9.82
MBS	-4.69	-	-	-4.69	-1.00	-4.74
ABS	-2.46	-0.20	-2.43	-4.91	-3.77	-6.57

出所:NFRC

「除く(銘柄)」残存別・月間投資収益率(2024年10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	-3.93	-0.54	-2.61	-7.00	-3.93	-8.99
除く30年国債	-4.62	-0.67	-2.81	-8.32	-4.05	-12.55
除く20年国債	-6.20	-0.66	-2.72	-11.55	-4.06	-15.98
除く10年国債	-7.03	-0.63	-2.64	-10.97	-3.95	-13.37
除く5年国債	-6.50	-0.63	-2.99	-9.84	-4.03	-13.37
除く中期国債	-6.12	-0.73	-2.82	-9.84	-4.03	-13.37
除く地方債	-6.08	-0.67	-2.81	-10.03	-4.03	-13.55
除く東京都債	-5.96	-0.68	-2.81	-9.85	-4.03	-13.37
除く五大都市債	-5.96	-0.67	-2.82	-9.86	-4.03	-13.39
除くその他地方債	-6.05	-0.67	-2.81	-9.99	-4.03	-13.51
除く政保債	-5.96	-0.67	-2.82	-9.85	-4.03	-13.38
除く公営企業債券	-5.96	-0.67	-2.82	-9.84	-4.03	-13.37
除くその他政保債	-5.96	-0.67	-2.82	-9.85	-4.03	-13.38
除く金融債	-5.97	-0.68	-2.82	-9.84	-4.03	-13.37
除く特定金融債	-5.95	-0.67	-2.82	-9.84	-4.03	-13.37
除く事業債	-6.09	-0.70	-2.85	-9.88	-4.05	-13.37
除く円建外債	-5.97	-0.68	-2.82	-9.84	-4.03	-13.37
除くMBS	-5.97	-0.67	-2.82	-9.97	-4.03	-13.70
除くABS	-5.96	-0.68	-2.82	-9.84	-4.03	-13.37
除くMBS・ABS	-5.97	-0.68	-2.82	-9.97	-4.04	-13.70

出所:NFRC

- ・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10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	-3.82	-0.44	-2.42	-8.88	-3.72	-13.31
水産・農林業	-	-	-	-	-	-
鉱業	-2.49	-0.14	-3.70	-	-	-
建設業	-1.97	-0.68	-2.29	-4.86	-3.61	-6.62
食料品	-2.04	-0.44	-2.25	-4.66	-3.57	-6.63
繊維製品	-1.96	-0.79	-1.93	-4.78	-3.49	-5.96
バルブ・紙	-2.60	-0.67	-3.22	-5.63	-3.67	-6.87
化学	-2.40	-0.52	-2.35	-5.19	-3.59	-7.21
医薬品	-2.76	-0.30	-2.74	-6.96	-3.36	-7.55
石油・石炭製品	-3.32	-0.52	-2.97	-4.80	-4.09	-7.75
ゴム製品	-1.47	-0.52	-2.15	-3.51	-3.51	-
ガラス・土石製品	-2.29	-0.44	-1.94	-4.75	-3.82	-7.06
鉄鋼	-1.65	-0.42	-1.98	-3.99	-3.68	-5.53
非鉄金属	-1.72	-0.50	-2.29	-3.59	-3.59	-
金属製品	-1.60	-0.54	-2.18	-3.88	-3.88	-
機械	-1.94	-0.55	-2.45	-3.63	-3.63	-
電気機器	-1.77	-0.43	-2.28	-3.55	-3.55	-
輸送用機器	-1.76	-0.33	-2.28	-4.61	-3.70	-5.93
精密機器	-1.96	-0.58	-2.42	-3.54	-3.54	-
その他製品	-3.53	-0.53	-2.85	-6.73	-	-6.73
電気・ガス業	-3.80	-0.51	-2.50	-6.70	-3.49	-9.99
陸運業	-7.86	-0.48	-2.80	-12.28	-3.96	-16.64
海運業	-3.01	-0.24	-2.95	-5.17	-5.17	-
空運業	-2.79	-0.05	-2.05	-4.39	-3.26	-5.53
倉庫・運輸関連業	-2.95	-0.41	-2.55	-5.10	-3.36	-6.76
情報・通信業	-1.83	0.27	-1.69	-7.65	-5.73	-12.77
卸売業	-2.84	-0.43	-2.23	-4.78	-3.73	-7.22
小売業	-1.43	-0.26	-1.89	-3.68	-2.97	-6.03
銀行業	-1.17	-0.10	-2.18	-3.50	-3.50	-
証券・商品先物取引業	-0.24	0.07	-1.25	-2.98	-2.98	-
保険業	-1.19	-0.59	-1.39	-3.48	-3.48	-
その他金融業	-1.70	-0.49	-2.42	-3.82	-3.54	-6.10
不動産業	-3.59	-0.54	-2.37	-6.81	-3.54	-11.23
サービス業	1.22	0.97	-2.23	6.56	7.22	2.97
財投機関債	-5.61	-0.60	-2.60	-11.77	-4.65	-15.11

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10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	-3.72	-0.43	-2.40	-8.86	-3.76	-13.27
AAA～AA 格	-4.35	-0.50	-2.50	-10.12	-4.06	-14.63
AAA 格	-2.88	-0.54	-2.57	-10.06	-4.09	-20.50
AA 格	-4.77	-0.49	-2.47	-10.13	-4.06	-14.21
A 格	-2.14	-0.26	-2.18	-4.71	-3.03	-7.09
事業債 全体	-3.82	-0.44	-2.42	-8.88	-3.72	-13.31
AAA～AA 格	-4.43	-0.50	-2.50	-10.13	-4.04	-14.63
AAA 格	-2.88	-0.54	-2.57	-10.06	-4.09	-20.50
AA 格	-4.88	-0.48	-2.48	-10.14	-4.03	-14.21
A 格	-2.19	-0.27	-2.23	-4.57	-2.95	-6.92
円建外債 全体	-1.55	-0.31	-1.89	-7.61	-5.87	-9.82
AAA～AA 格	-1.57	-0.54	-2.30	-7.16	-6.92	-10.41
AAA 格	-	-	-	-	-	-
AA 格	-1.57	-0.54	-2.30	-7.16	-6.92	-10.41
A 格	-1.53	-0.14	-1.51	-7.73	-5.28	-9.80

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10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	-4.43	-0.50	-2.50	-10.13	-4.04	-14.63
AAA~A格	-3.82	-0.44	-2.42	-8.88	-3.72	-13.31
AAA~BBB格	-3.82	-0.44	-2.42	-8.88	-3.72	-13.31
AAA~BB格	-3.82	-0.44	-2.42	-8.88	-3.72	-13.31
AAA格	-2.88	-0.54	-2.57	-10.06	-4.09	-20.50
AA格	-4.88	-0.48	-2.48	-10.14	-4.03	-14.21
A格	-2.19	-0.27	-2.23	-4.57	-2.95	-6.92
BBB格	-	-	-	-	-	-
BB格	-	-	-	-	-	-
B格以下	-	-	-	-	-	-
格付なし	-	-	-	-	-	-
円建外債						
AAA~AA格	-1.57	-0.54	-2.30	-7.16	-6.92	-10.41
AAA~A格	-1.55	-0.31	-1.89	-7.61	-5.87	-9.82
AAA~BBB格	-1.55	-0.31	-1.89	-7.61	-5.87	-9.82
AAA~BB格	-1.55	-0.31	-1.89	-7.61	-5.87	-9.82
AAA格	-	-	-	-	-	-
AA格	-1.57	-0.54	-2.30	-7.16	-6.92	-10.41
A格	-1.53	-0.14	-1.51	-7.73	-5.28	-9.80
BBB格	-	-	-	-	-	-
BB格	-	-	-	-	-	-
B格以下	-	-	-	-	-	-
格付なし	-	-	-	-	-	-

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、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10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	-3.66	-0.46	-2.30	-9.98	-3.89	-16.01
AAA~A格	-3.84	-0.44	-2.44	-8.93	-3.73	-13.39
AAA~BBB格	-3.83	-0.44	-2.43	-8.88	-3.72	-13.33
AAA~BB格	-3.82	-0.44	-2.42	-8.88	-3.72	-13.31
AAA格	-	-	-	-	-	-
AA格	-3.66	-0.46	-2.30	-9.98	-3.89	-16.01
A格	-3.88	-0.43	-2.47	-8.76	-3.70	-12.99
BBB格	-3.29	-0.32	-2.29	-6.99	-3.61	-10.90
BB格	-1.63	-	-1.17	-5.94	-	-5.94
B格以下	-	-	-	-	-	-
格付なし	-	-	-	-	-	-
円建外債						
AAA~AA格	-1.21	-0.56	-2.04	-4.99	-4.99	-
AAA~A格	-1.58	-0.43	-2.16	-7.87	-6.37	-9.65
AAA~BBB格	-1.55	-0.31	-1.89	-7.61	-5.87	-9.82
AAA~BB格	-1.55	-0.31	-1.89	-7.61	-5.87	-9.82
AAA格	-	-	-	-	-	-
AA格	-1.21	-0.56	-2.04	-4.99	-4.99	-
A格	-1.64	-0.41	-2.18	-8.17	-6.66	-9.65
BBB格	-1.49	-0.03	-1.46	-7.33	-5.36	-10.02
BB格	-	-	-	-	-	-
B格以下	-	-	-	-	-	-
格付なし	-	-	-	-	-	-

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、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10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	-4.84	-0.54	-2.51	-10.73	-4.11	-15.36
AAA~A 格	-4.04	-0.49	-2.45	-9.24	-3.96	-13.60
AAA~BBB 格	-4.03	-0.49	-2.44	-9.23	-3.95	-13.60
AAA~BB 格	-4.03	-0.49	-2.44	-9.23	-3.95	-13.60
AAA 格	-1.57	-0.39	-2.41	-4.51	-3.87	-6.14
AA 格	-4.92	-0.55	-2.51	-10.77	-4.11	-15.39
A 格	-2.59	-0.42	-2.36	-5.63	-3.69	-8.02
BBB 格	-0.42	0.74	-1.27	-0.21	-0.21	-
BB 格	-	-	-	-	-	-
B 格以下	-	-	-	-	-	-
格付なし	-1.60	0.09	-2.23	-2.90	-0.94	-6.22
円建外債						
AAA~AA 格	0.04	0.04	-	-	-	-
AAA~A 格	-0.89	0.02	-1.51	-6.76	-6.76	-
AAA~BBB 格	-0.89	0.02	-1.51	-6.76	-6.76	-
AAA~BB 格	-0.89	0.02	-1.51	-6.76	-6.76	-
AAA 格	-	-	-	-	-	-
AA 格	0.04	0.04	-	-	-	-
A 格	-0.93	0.02	-1.51	-6.76	-6.76	-
BBB 格	-	-	-	-	-	-
BB 格	-	-	-	-	-	-
B 格以下	-	-	-	-	-	-
格付なし	-1.75	-0.41	-2.04	-7.71	-5.67	-9.82

出所:NFRC

- 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NFRCで分類

事業債 円建外債 JCR 格付別・月間投資収益率(2024年10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	-2.88	-0.47	-2.47	-7.35	-3.84	-12.05
AAA~A 格	-2.66	-0.37	-2.38	-6.34	-3.44	-10.25
AAA~BBB 格	-2.66	-0.37	-2.38	-6.34	-3.44	-10.25
AAA~BB 格	-2.66	-0.37	-2.38	-6.34	-3.44	-10.25
AAA 格	-2.96	-0.55	-2.58	-10.06	-4.09	-20.50
AA 格	-2.83	-0.42	-2.40	-6.42	-3.74	-9.70
A 格	-2.10	-0.09	-2.13	-4.26	-2.63	-6.49
BBB 格	-	-	-	-	-	-
BB 格	-	-	-	-	-	-
B 格以下	-	-	-	-	-	-
格付なし	-5.58	-0.56	-2.51	-11.12	-4.12	-15.12
円建外債						
AAA~AA 格	-1.19	-0.38	-1.71	-5.43	-4.26	-10.41
AAA~A 格	-1.97	-0.24	-1.59	-7.73	-4.44	-9.91
AAA~BBB 格	-1.97	-0.24	-1.59	-7.73	-4.44	-9.91
AAA~BB 格	-1.97	-0.24	-1.59	-7.73	-4.44	-9.91
AAA 格	-	-	-	-	-	-
AA 格	-1.19	-0.38	-1.71	-5.43	-4.26	-10.41
A 格	-2.19	-0.20	-1.56	-8.01	-4.49	-9.89
BBB 格	-	-	-	-	-	-
BB 格	-	-	-	-	-	-
B 格以下	-	-	-	-	-	-
格付なし	-1.32	-0.34	-1.99	-7.33	-7.36	-6.48

出所:NFRC

- 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NFRCで分類

事業債 円建外債 Moody's 格付別・月間投資収益率(2024年10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	-4.87	-0.56	-2.56	-10.34	-4.10	-14.32
AAA~BBB格	-4.75	-0.55	-2.51	-10.13	-4.07	-14.12
AAA~BB格	-4.75	-0.55	-2.51	-10.13	-4.07	-14.12
AAA格	-	-	-	-	-	-
AA格	-	-	-	-	-	-
A格	-4.87	-0.56	-2.56	-10.34	-4.10	-14.32
BBB格	-3.32	-0.51	-2.15	-7.05	-3.70	-10.50
BB格	-	-	-	-	-	-
B格以下	-	-	-	-	-	-
格付なし	-3.26	-0.37	-2.38	-7.88	-3.51	-12.52
円建外債						
AAA~AA格	-1.62	-0.56	-2.36	-7.57	-7.57	-
AAA~A格	-1.65	-0.47	-2.12	-8.01	-6.86	-9.65
AAA~BBB格	-1.68	-0.44	-1.91	-7.72	-5.98	-9.82
AAA~BB格	-1.68	-0.44	-1.91	-7.72	-5.98	-9.82
AAA格	-	-	-	-	-	-
AA格	-1.62	-0.56	-2.36	-7.57	-7.57	-
A格	-1.69	-0.37	-1.61	-8.18	-6.22	-9.65
BBB格	-1.76	-0.35	-1.49	-7.29	-4.43	-10.02
BB格	-	-	-	-	-	-
B格以下	-	-	-	-	-	-
格付なし	0.34	0.91	-1.28	-3.67	-3.67	-

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10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	-10.99	-0.66	-3.15	-13.22	-3.75	-18.83
AAA~A格	-4.94	-0.52	-2.68	-10.06	-4.09	-15.14
AAA~BBB格	-4.90	-0.52	-2.66	-10.03	-4.09	-15.11
AAA~BB格	-4.85	-0.52	-2.60	-10.01	-4.09	-15.05
AAA格	-	-	-	-	-	-
AA格	-10.99	-0.66	-3.15	-13.22	-3.75	-18.83
A格	-4.65	-0.52	-2.67	-9.72	-4.12	-14.67
BBB格	-1.79	-0.39	-1.77	-4.29	-3.74	-5.53
BB格	-1.63	-	-1.17	-5.94	-	-5.94
B格以下	-	-	-	-	-	-
格付なし	-3.50	-0.42	-2.37	-8.42	-3.58	-12.61
円建外債						
AAA~AA格	-1.34	-0.64	-2.04	-4.99	-4.99	-
AAA~A格	-1.60	-0.47	-2.10	-7.92	-6.43	-9.65
AAA~BBB格	-1.58	-0.34	-1.89	-7.64	-5.89	-9.82
AAA~BB格	-1.58	-0.34	-1.89	-7.64	-5.89	-9.82
AAA格	-	-	-	-	-	-
AA格	-1.34	-0.64	-2.04	-4.99	-4.99	-
A格	-1.64	-0.45	-2.10	-8.23	-6.73	-9.65
BBB格	-1.55	-0.04	-1.52	-7.33	-5.36	-10.02
BB格	-	-	-	-	-	-
B格以下	-	-	-	-	-	-
格付なし	0.19	0.60	-2.18	-4.28	-4.28	-

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10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	1,145,388	96.27	96.45	10.19	0.81	0.98	0.95	8.68	8.62	8.63	4
短期 (1-3)	230,318	99.93	100.02	1.93	0.40	0.44	0.44	1.92	1.91	1.92	5
中期 (3-7)	311,167	100.37	100.53	4.78	0.65	0.58	0.58	4.70	4.69	4.70	5
長期 (7-)	603,902	92.75	92.98	16.13	1.05	1.43	1.37	13.67	13.56	13.58	4
長期 (7-11)	208,915	101.74	101.99	8.69	1.03	0.83	0.83	8.31	8.27	8.31	3
超長期 (11-)	394,988	88.00	88.21	20.07	1.07	1.79	1.69	16.95	16.80	16.80	4
(11-15)	95,768	96.28	96.47	12.92	0.97	1.29	1.27	12.10	12.02	12.08	4
(15-)	299,220	85.35	85.57	22.35	1.10	1.97	1.85	18.70	18.52	18.51	4
国債	972,942	96.21	96.39	10.69	0.84	0.98	0.94	9.06	9.00	9.00	1
短期 (1-3)	189,459	100.01	100.10	1.91	0.40	0.39	0.39	1.90	1.90	1.90	1
中期 (3-7)	253,407	100.67	100.83	4.79	0.66	0.53	0.54	4.71	4.69	4.71	0
長期 (7-)	530,076	92.71	92.94	16.66	1.08	1.44	1.37	14.07	13.96	13.97	1
長期 (7-11)	181,701	102.09	102.35	8.70	1.04	0.79	0.80	8.32	8.29	8.31	0
超長期 (11-)	348,374	87.82	88.04	20.80	1.10	1.83	1.71	17.56	17.40	17.39	1
(11-15)	83,771	96.81	97.00	12.99	0.99	1.27	1.25	12.16	12.08	12.14	1
(15-)	264,603	84.98	85.20	23.28	1.13	2.03	1.87	19.51	19.32	19.29	1
地方債	66,923	97.37	97.50	7.32	0.61	0.84	0.86	6.75	6.72	6.73	11
短期 (1-3)	12,769	99.75	99.83	2.00	0.37	0.50	0.50	1.99	1.98	1.99	11
中期 (3-7)	24,747	99.16	99.27	4.92	0.50	0.65	0.65	4.85	4.83	4.85	11
長期 (7-)	29,407	94.83	95.00	11.65	0.82	1.17	1.20	10.60	10.53	10.55	12
政保債	14,198	96.21	96.44	9.29	0.74	0.96	0.93	7.99	7.93	7.95	7
短期 (1-3)	3,371	99.48	99.54	2.01	0.20	0.46	0.46	2.00	2.00	2.00	7
中期 (3-7)	4,172	100.47	100.64	4.47	0.64	0.58	0.58	4.41	4.39	4.41	6
長期 (7-)	6,655	91.88	92.23	15.99	1.07	1.50	1.42	13.71	13.60	13.64	8
金融債	3,426	98.80	98.87	3.12	0.31	0.72	0.72	3.08	3.07	3.08	27
短期 (1-3)	1,990	99.08	99.12	1.99	0.17	0.64	0.64	1.98	1.98	1.98	25
中期 (3-7)	1,267	98.62	98.73	4.23	0.47	0.79	0.79	4.18	4.16	4.18	28
長期 (7-)	168	96.75	96.93	8.18	0.71	1.17	1.16	7.94	7.89	7.93	40
事業債	70,172	96.06	96.24	7.41	0.75	1.13	1.10	6.32	6.27	6.29	39
短期 (1-3)	20,867	99.49	99.60	1.97	0.47	0.74	0.74	1.96	1.95	1.96	35
中期 (3-7)	26,117	98.84	99.00	4.70	0.69	0.92	0.92	4.61	4.59	4.61	39
長期 (7-)	23,188	89.83	90.10	15.35	1.07	1.79	1.68	12.77	12.65	12.66	43
長期 (7-11)	9,838	98.38	98.65	8.67	1.06	1.29	1.27	8.27	8.22	8.27	47
超長期 (11-)	13,350	83.54	83.81	20.27	1.07	2.22	2.03	16.67	16.50	16.48	40
円建外債	3,125	99.19	99.48	3.61	1.07	1.31	1.31	3.45	3.43	3.45	82
短期 (1-3)	1,689	99.51	99.79	2.15	0.96	1.18	1.17	2.13	2.12	2.13	77
中期 (3-7)	1,159	98.78	99.03	4.01	1.01	1.32	1.31	3.92	3.90	3.92	81
長期 (7-)	278	98.90	99.48	10.85	1.95	2.11	2.10	9.58	9.48	9.55	111
長期 (7-11)	157	98.06	98.41	8.55	1.53	1.83	1.81	7.99	7.92	7.98	103
超長期 (11-)	121	100.00	100.88	13.85	2.50	2.48	2.47	11.60	11.46	11.54	121
MBS	13,951	94.98	95.02	7.33	0.63	0.84	1.27	6.83	6.79	7.11	22
ABS	651	95.90	96.08	5.89	0.73	1.33	1.29	5.47	5.43	5.46	68
短期 (1-3)	174	99.21	99.41	2.07	0.67	1.04	1.04	2.05	2.04	2.05	64
中期 (3-7)	297	97.19	97.34	5.04	0.66	1.22	1.20	4.94	4.91	4.94	66
長期 (7-)	180	90.57	90.80	10.99	0.90	1.84	1.74	10.03	9.93	10.01	75

出所:NFRIC

「除く」銘柄 残存別・ポートフォリオ指標 (2024年10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	1,131,436	96.28	96.46	10.23	0.82	0.98	0.95	8.70	8.64	8.65	4
短期 (1-3)	230,318	99.93	100.02	1.93	0.40	0.44	0.44	1.92	1.91	1.92	5
中期 (3-7)	311,167	100.37	100.53	4.78	0.65	0.58	0.58	4.70	4.69	4.70	5
長期 (7-)	589,951	92.70	92.93	16.34	1.06	1.44	1.37	13.84	13.73	13.73	3
長期 (7-11)	208,737	101.74	101.99	8.70	1.03	0.83	0.83	8.31	8.28	8.31	3
超長期 (11-)	381,214	87.75	87.97	20.53	1.08	1.83	1.71	17.34	17.19	17.18	3
(11-15)	95,768	96.28	96.47	12.92	0.97	1.29	1.27	12.10	12.02	12.08	4
(15-)	285,446	84.89	85.11	23.08	1.12	2.03	1.88	19.33	19.15	19.12	3
除く ABS	1,144,737	96.27	96.45	10.19	0.81	0.98	0.95	8.68	8.62	8.63	4
短期 (1-3)	230,145	99.93	100.02	1.93	0.40	0.44	0.44	1.92	1.91	1.92	5
中期 (3-7)	310,869	100.38	100.54	4.78	0.65	0.58	0.58	4.70	4.69	4.70	5
長期 (7-)	603,723	92.75	92.98	16.13	1.05	1.42	1.37	13.67	13.56	13.58	4
長期 (7-11)	208,813	101.74	101.99	8.69	1.03	0.83	0.83	8.31	8.27	8.31	3
超長期 (11-)	394,909	88.00	88.21	20.07	1.07	1.79	1.69	16.95	16.80	16.80	4
(11-15)	95,711	96.28	96.48	12.92	0.97	1.29	1.27	12.10	12.02	12.08	4
(15-)	299,199	85.35	85.57	22.35	1.10	1.97	1.85	18.70	18.52	18.51	4
除く MBS・ABS	1,130,785	96.28	96.46	10.23	0.82	0.98	0.95	8.70	8.64	8.65	4
短期 (1-3)	230,145	99.93	100.02	1.93	0.40	0.44	0.44	1.92	1.91	1.92	5
中期 (3-7)	310,869	100.38	100.54	4.78	0.65	0.58	0.58	4.70	4.69	4.70	5
長期 (7-)	589,771	92.70	92.93	16.34	1.06	1.44	1.37	13.84	13.73	13.73	3
長期 (7-11)	208,636	101.74	101.99	8.70	1.03	0.83	0.83	8.31	8.28	8.31	3
超長期 (11-)	381,136	87.75	87.97	20.53	1.08	1.83	1.71	17.34	17.19	17.18	3
(11-15)	95,711	96.28	96.48	12.92	0.97	1.29	1.27	12.10	12.02	12.08	4
(15-)	285,425	84.89	85.11	23.08	1.12	2.03	1.88	19.33	19.15	19.12	3
除く 国債	172,445	96.60	96.76	7.36	0.68	0.98	1.00	6.54	6.50	6.54	25
短期 (1-3)	40,859	99.55	99.65	1.99	0.42	0.66	0.65	1.98	1.97	1.98	26
中期 (3-7)	57,760	99.08	99.22	4.75	0.60	0.79	0.78	4.68	4.66	4.68	25
長期 (7-)	73,827	93.03	93.22	12.37	0.89	1.33	1.38	10.80	10.72	10.79	24
長期 (7-11)	27,213	99.38	99.60	8.60	0.95	1.05	1.04	8.25	8.20	8.24	25
超長期 (11-)	46,614	89.33	89.50	14.57	0.85	1.51	1.60	12.46	12.35	12.45	23

出所:NFRIC

- 「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10月末、11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	1,155,270	96.28	96.46	10.23	0.82	0.98	0.95	8.71	8.65	8.67	4
短期 (1-3)	230,156	99.92	100.02	1.95	0.41	0.44	0.44	1.94	1.94	1.94	5
中期 (3-7)	315,183	100.39	100.55	4.80	0.66	0.58	0.58	4.72	4.70	4.72	5
長期 (7-)	609,931	92.78	93.00	16.17	1.05	1.43	1.37	13.70	13.59	13.60	4
長期 (7-11)	211,515	101.67	101.92	8.72	1.02	0.83	0.84	8.34	8.30	8.34	3
超長期 (11-)	398,416	88.06	88.27	20.13	1.07	1.79	1.70	16.98	16.83	16.83	4
(11-15)	96,074	96.25	96.44	12.92	0.97	1.29	1.27	12.11	12.03	12.08	4
(15-)	302,342	85.46	85.67	22.42	1.11	1.97	1.85	18.72	18.55	18.53	4
国債	981,997	96.22	96.41	10.73	0.84	0.98	0.95	9.09	9.03	9.03	1
短期 (1-3)	189,298	100.01	100.11	1.93	0.40	0.40	0.40	1.92	1.91	1.92	1
中期 (3-7)	256,590	100.70	100.86	4.79	0.67	0.53	0.54	4.71	4.70	4.71	0
長期 (7-)	536,109	92.74	92.97	16.69	1.08	1.44	1.37	14.09	13.98	13.98	1
長期 (7-11)	184,416	102.00	102.25	8.73	1.03	0.80	0.81	8.34	8.31	8.34	0
超長期 (11-)	351,693	87.89	88.10	20.86	1.10	1.83	1.71	17.59	17.43	17.42	1
(11-15)	83,973	96.80	96.99	12.99	0.99	1.27	1.25	12.16	12.08	12.14	1
(15-)	267,720	85.10	85.32	23.33	1.14	2.03	1.87	19.52	19.34	19.30	1
地方債	66,966	97.37	97.50	7.38	0.62	0.85	0.86	6.81	6.78	6.79	11
短期 (1-3)	12,687	99.73	99.81	2.06	0.36	0.50	0.50	2.06	2.05	2.06	11
中期 (3-7)	24,975	99.12	99.23	4.99	0.50	0.65	0.65	4.92	4.90	4.92	11
長期 (7-)	29,304	94.85	95.02	11.72	0.83	1.18	1.21	10.66	10.59	10.61	12
政保債	14,230	96.22	96.44	9.39	0.75	0.97	0.94	8.09	8.04	8.06	7
短期 (1-3)	3,311	99.45	99.49	2.12	0.20	0.47	0.47	2.12	2.11	2.12	7
中期 (3-7)	4,172	100.55	100.72	4.52	0.66	0.59	0.59	4.45	4.43	4.45	6
長期 (7-)	6,747	91.95	92.30	15.98	1.07	1.50	1.42	13.71	13.60	13.64	8
金融債	3,391	98.79	98.86	3.18	0.32	0.73	0.72	3.14	3.13	3.14	27
短期 (1-3)	1,976	99.06	99.10	2.05	0.18	0.65	0.65	2.05	2.04	2.05	25
中期 (3-7)	1,247	98.63	98.75	4.29	0.48	0.80	0.79	4.24	4.22	4.24	28
長期 (7-)	168	96.75	96.93	8.18	0.71	1.17	1.16	7.94	7.89	7.93	40
事業債	70,661	96.08	96.26	7.44	0.75	1.14	1.10	6.35	6.30	6.32	39
短期 (1-3)	20,822	99.47	99.59	2.02	0.47	0.74	0.74	2.01	2.00	2.01	35
中期 (3-7)	26,676	98.83	98.99	4.75	0.69	0.93	0.92	4.66	4.64	4.66	39
長期 (7-)	23,163	89.86	90.13	15.40	1.08	1.79	1.68	12.81	12.69	12.70	43
長期 (7-11)	9,802	98.45	98.72	8.73	1.08	1.29	1.27	8.32	8.27	8.32	47
超長期 (11-)	13,361	83.56	83.83	20.29	1.08	2.23	2.03	16.69	16.51	16.49	40
円建外債	3,377	99.23	99.51	3.59	1.06	1.29	1.29	3.44	3.42	3.44	80
短期 (1-3)	1,893	99.56	99.83	2.23	0.97	1.16	1.16	2.20	2.19	2.20	75
中期 (3-7)	1,205	98.78	99.02	4.06	1.00	1.31	1.30	3.97	3.94	3.97	79
長期 (7-)	279	98.90	99.48	10.85	1.95	2.12	2.10	9.58	9.47	9.55	111
長期 (7-11)	162	98.14	98.51	8.61	1.56	1.84	1.83	8.03	7.96	8.02	104
超長期 (11-)	118	99.95	100.82	13.93	2.50	2.48	2.48	11.66	11.51	11.59	121
MBS	13,996	94.99	95.03	7.36	0.63	0.84	1.27	6.86	6.82	7.15	22
ABS	652	95.91	96.09	5.96	0.74	1.34	1.30	5.54	5.50	5.54	68
短期 (1-3)	170	99.16	99.35	2.15	0.66	1.05	1.04	2.13	2.12	2.13	64
中期 (3-7)	318	97.10	97.26	5.18	0.67	1.23	1.21	5.07	5.04	5.07	66
長期 (7-)	165	90.24	90.47	11.40	0.94	1.89	1.78	10.37	10.27	10.35	75

出所:NFRIC

「除く」銘柄 残存別・ポートフォリオ指標 (2024年10月末、11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	1,141,273	96.30	96.48	10.27	0.82	0.98	0.95	8.74	8.68	8.68	4
短期 (1-3)	230,156	99.92	100.02	1.95	0.41	0.44	0.44	1.94	1.94	1.94	5
中期 (3-7)	315,183	100.39	100.55	4.80	0.66	0.58	0.58	4.72	4.70	4.72	5
長期 (7-)	595,935	92.73	92.96	16.38	1.06	1.44	1.37	13.86	13.75	13.76	3
長期 (7-11)	211,337	101.68	101.92	8.73	1.02	0.83	0.84	8.34	8.31	8.34	3
超長期 (11-)	384,598	87.81	88.03	20.58	1.09	1.83	1.71	17.37	17.21	17.20	3
(11-15)	96,074	96.25	96.44	12.92	0.97	1.29	1.27	12.11	12.03	12.08	4
(15-)	288,524	85.00	85.23	23.13	1.13	2.03	1.88	19.35	19.17	19.13	3
除く ABS	1,154,618	96.28	96.46	10.24	0.82	0.98	0.95	8.72	8.66	8.67	4
短期 (1-3)	229,986	99.93	100.02	1.95	0.41	0.44	0.44	1.94	1.94	1.94	5
中期 (3-7)	314,865	100.40	100.56	4.80	0.66	0.58	0.58	4.72	4.70	4.72	5
長期 (7-)	609,766	92.78	93.01	16.17	1.05	1.43	1.37	13.70	13.59	13.60	4
長期 (7-11)	211,429	101.68	101.92	8.72	1.02	0.83	0.84	8.34	8.30	8.34	3
超長期 (11-)	398,338	88.06	88.27	20.13	1.07	1.79	1.70	16.98	16.83	16.83	4
(11-15)	96,016	96.26	96.45	12.92	0.97	1.29	1.27	12.11	12.03	12.08	4
(15-)	302,321	85.46	85.67	22.42	1.11	1.97	1.85	18.72	18.55	18.53	4
除く MBS・ABS	1,140,621	96.30	96.48	10.27	0.82	0.98	0.95	8.74	8.68	8.69	4
短期 (1-3)	229,986	99.93	100.02	1.95	0.41	0.44	0.44	1.94	1.94	1.94	5
中期 (3-7)	314,865	100.40	100.56	4.80	0.66	0.58	0.58	4.72	4.70	4.72	5
長期 (7-)	595,770	92.73	92.96	16.38	1.06	1.44	1.37	13.86	13.75	13.76	3
長期 (7-11)	211,251	101.68	101.93	8.73	1.02	0.83	0.84	8.34	8.31	8.34	3
超長期 (11-)	384,519	87.82	88.03	20.58	1.09	1.83	1.71	17.37	17.22	17.20	3
(11-15)	96,016	96.26	96.45	12.92	0.97	1.29	1.27	12.11	12.03	12.08	4
(15-)	288,503	85.01	85.23	23.13	1.13	2.03	1.88	19.35	19.17	19.13	3
除く 国債	173,273	96.61	96.77	7.40	0.69	0.98	1.00	6.59	6.55	6.59	25
短期 (1-3)	40,858	99.53	99.63	2.05	0.42	0.66	0.66	2.04	2.04	2.04	27
中期 (3-7)	58,593	99.06	99.20	4.81	0.61	0.79	0.79	4.73	4.71	4.73	25
長期 (7-)	73,822	93.06	93.25	12.42	0.90	1.33	1.39	10.84	10.76	10.84	23
長期 (7-11)	27,099	99.44	99.67	8.68	0.97	1.05	1.05	8.31	8.27	8.31	25
超長期 (11-)	46,723	89.35	89.53	14.60	0.85	1.52	1.60	12.48	12.37	12.47	23

出所:NFRC

- 「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10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	184,921	91.72	92.02	20.63	1.46	1.78	1.69	17.10	16.94	16.94	2
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	2,421	111.21	112.15	5.79	2.56	0.56	0.59	5.40	5.39	5.40	2
長期(7-)	182,500	91.46	91.75	20.83	1.44	1.80	1.71	17.29	17.13	17.13	2
長期(7-11)	14,507	111.71	112.29	9.31	2.17	0.82	0.87	8.48	8.45	8.47	1
超長期(11-)	167,992	89.71	89.98	21.82	1.38	1.91	1.80	18.23	18.07	18.06	2
20年国債	296,540	98.84	99.16	10.35	1.32	0.99	0.97	9.38	9.33	9.37	0
短期(1-3)	26,467	103.54	104.04	2.03	2.16	0.40	0.40	1.99	1.98	1.99	1
中期(3-7)	64,588	107.29	107.78	5.11	2.03	0.54	0.55	4.87	4.86	4.87	1
長期(7-)	205,485	95.58	95.82	13.07	0.99	1.24	1.20	12.01	11.94	11.99	0
長期(7-11)	72,333	105.66	106.03	9.00	1.52	0.81	0.83	8.42	8.38	8.41	0
超長期(11-)	133,152	90.10	90.27	15.28	0.70	1.51	1.44	14.31	14.20	14.27	0
10年国債	292,957	98.18	98.24	5.40	0.23	0.59	0.58	5.32	5.30	5.32	0
短期(1-3)	68,154	99.41	99.45	2.00	0.12	0.40	0.40	2.00	2.00	2.00	1
中期(3-7)	129,942	97.75	97.77	5.00	0.10	0.55	0.54	4.98	4.96	4.98	0
長期(7-)	94,861	97.90	98.02	8.39	0.49	0.77	0.77	8.21	8.18	8.21	-1
5年国債	119,586	99.30	99.34	2.89	0.17	0.44	0.44	2.88	2.87	2.88	0
短期(1-3)	63,130	99.25	99.25	2.02	0.03	0.40	0.40	2.01	2.01	2.01	1
中期(3-7)	56,456	99.37	99.45	3.87	0.32	0.49	0.49	3.85	3.84	3.85	-1
中期国債	31,708	99.84	99.91	1.41	0.23	0.36	0.36	1.41	1.41	1.41	1
短期(1-3)	31,708	99.84	99.91	1.41	0.23	0.36	0.36	1.41	1.41	1.41	1
中期(3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
地方公共団体	57,035	97.47	97.60	7.12	0.58	0.82	0.84	6.61	6.58	6.59	10
短期(1-3)	11,157	99.69	99.76	2.00	0.33	0.49	0.49	1.99	1.99	1.99	10
中期(3-7)	21,225	99.02	99.13	4.89	0.46	0.64	0.64	4.83	4.82	4.83	10
長期(7-)	24,652	95.12	95.30	11.36	0.80	1.14	1.18	10.40	10.33	10.34	11
東京都債	4,624	98.69	98.82	7.14	0.70	0.83	0.81	6.53	6.50	6.52	10
短期(1-3)	960	99.76	99.83	1.93	0.36	0.49	0.49	1.92	1.91	1.92	10
中期(3-7)	1,980	99.15	99.24	4.93	0.50	0.64	0.64	4.86	4.84	4.86	10
長期(7-)	1,684	97.52	97.73	12.71	1.13	1.24	1.22	11.22	11.15	11.18	11
五大都市債	6,158	97.72	97.92	8.10	0.84	0.89	0.92	7.25	7.20	7.20	11
短期(1-3)	1,181	100.16	100.30	2.06	0.57	0.50	0.50	2.05	2.04	2.05	10
中期(3-7)	2,120	100.69	100.89	4.72	0.80	0.62	0.63	4.63	4.61	4.63	10
長期(7-)	2,856	94.51	94.73	13.10	0.98	1.27	1.34	11.59	11.51	11.50	12
その他地方公共団体	46,253	97.31	97.43	6.99	0.53	0.81	0.83	6.54	6.50	6.51	10
短期(1-3)	9,016	99.62	99.69	2.00	0.30	0.49	0.49	1.99	1.99	1.99	10
中期(3-7)	17,125	98.80	98.89	4.91	0.41	0.64	0.64	4.85	4.84	4.85	10
長期(7-)	20,112	95.01	95.18	11.01	0.75	1.11	1.16	10.16	10.10	10.11	11
その他地方債	9,888	96.82	96.93	8.43	0.80	0.99	0.96	7.57	7.52	7.55	16
短期(1-3)	1,612	100.19	100.32	1.97	0.62	0.54	0.55	1.96	1.95	1.96	16
中期(3-7)	3,522	100.02	100.13	5.06	0.74	0.71	0.71	4.96	4.94	4.96	16
長期(7-)	4,755	93.30	93.41	13.11	0.91	1.37	1.31	11.69	11.60	11.64	17
特定金融債	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
政保地方公営企業債	1,475	98.96	98.97	2.87	0.16	0.50	0.50	2.86	2.85	2.86	6
短期(1-3)	795	99.29	99.30	2.09	0.14	0.46	0.46	2.09	2.08	2.09	7
中期(3-7)	680	98.57	98.59	3.78	0.18	0.55	0.55	3.77	3.76	3.77	5
長期(7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
その他政保債	12,723	95.89	96.14	10.03	0.80	1.02	0.98	8.60	8.54	8.56	7
短期(1-3)	2,576	99.54	99.61	1.98	0.21	0.46	0.46	1.98	1.97	1.98	7
中期(3-7)	3,492	100.84	101.03	4.61	0.73	0.59	0.59	4.53	4.51	4.53	6
長期(7-)	6,655	91.88	92.23	15.99	1.07	1.50	1.42	13.71	13.60	13.64	8
SDGs	18,772	96.99	97.15	7.22	0.59	0.97	0.94	6.52	6.48	6.50	23

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10月末、11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	185,912	91.75	92.06	20.68	1.46	1.79	1.69	17.12	16.97	16.96	2
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	3,178	111.41	112.38	6.09	2.52	0.57	0.60	5.67	5.65	5.66	1
長期(7-)	182,734	91.41	91.70	20.93	1.44	1.81	1.71	17.37	17.21	17.21	2
長期(7-11)	13,761	111.69	112.24	9.43	2.16	0.84	0.88	8.59	8.55	8.58	1
超長期(11-)	168,973	89.76	90.03	21.87	1.38	1.91	1.80	18.26	18.09	18.08	2
20年国債	298,013	98.83	99.15	10.39	1.32	1.00	0.98	9.42	9.36	9.40	0
短期(1-3)	26,467	103.54	104.04	2.03	2.16	0.40	0.40	1.99	1.98	1.99	1
中期(3-7)	64,618	107.29	107.78	5.11	2.03	0.54	0.55	4.87	4.86	4.87	1
長期(7-)	206,928	95.58	95.82	13.10	1.00	1.24	1.20	12.04	11.96	12.01	0
長期(7-11)	72,333	105.66	106.03	9.00	1.52	0.81	0.83	8.42	8.38	8.41	0
超長期(11-)	134,594	90.17	90.34	15.31	0.71	1.51	1.44	14.33	14.22	14.29	0
10年国債	296,514	98.20	98.26	5.45	0.24	0.59	0.59	5.37	5.35	5.37	0
短期(1-3)	68,154	99.41	99.45	2.00	0.12	0.40	0.40	2.00	2.00	2.00	1
中期(3-7)	130,038	97.75	97.77	5.00	0.10	0.55	0.54	4.98	4.96	4.98	0
長期(7-)	98,321	97.96	98.08	8.43	0.50	0.78	0.77	8.25	8.21	8.24	-1
5年国債	121,885	99.32	99.36	2.93	0.17	0.45	0.45	2.92	2.91	2.92	0
短期(1-3)	63,130	99.25	99.25	2.02	0.03	0.40	0.40	2.01	2.01	2.01	1
中期(3-7)	58,755	99.40	99.48	3.91	0.33	0.50	0.49	3.88	3.87	3.88	-1
中期国債	31,547	99.86	99.92	1.50	0.26	0.38	0.38	1.49	1.49	1.49	2
短期(1-3)	31,547	99.86	99.92	1.50	0.26	0.38	0.38	1.49	1.49	1.49	2
中期(3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
地方公共団体	57,055	97.46	97.59	7.19	0.58	0.83	0.84	6.67	6.64	6.65	10
短期(1-3)	11,087	99.66	99.74	2.07	0.33	0.50	0.50	2.06	2.06	2.06	10
中期(3-7)	21,436	98.98	99.09	4.97	0.46	0.64	0.64	4.91	4.89	4.91	10
長期(7-)	24,532	95.14	95.32	11.44	0.81	1.15	1.19	10.46	10.39	10.40	11
東京都債	4,634	98.69	98.82	7.14	0.70	0.83	0.81	6.54	6.50	6.52	10
短期(1-3)	960	99.76	99.83	1.93	0.36	0.49	0.49	1.92	1.91	1.92	10
中期(3-7)	1,980	99.15	99.24	4.93	0.50	0.64	0.64	4.86	4.84	4.86	10
長期(7-)	1,694	97.54	97.75	12.69	1.13	1.24	1.22	11.21	11.13	11.16	11
五大都市債	6,159	97.72	97.92	8.15	0.84	0.89	0.93	7.30	7.25	7.25	11
短期(1-3)	1,253	100.12	100.26	2.17	0.56	0.50	0.50	2.16	2.15	2.16	10
中期(3-7)	2,078	100.68	100.88	4.88	0.81	0.63	0.64	4.78	4.76	4.78	10
長期(7-)	2,828	94.48	94.70	13.19	0.99	1.28	1.35	11.67	11.59	11.58	12
その他地方公共団体	46,263	97.31	97.43	7.07	0.54	0.82	0.83	6.61	6.57	6.58	10
短期(1-3)	8,874	99.59	99.65	2.07	0.29	0.50	0.50	2.06	2.06	2.06	10
中期(3-7)	17,379	98.76	98.86	4.99	0.41	0.65	0.64	4.93	4.91	4.93	10
長期(7-)	20,010	95.03	95.20	11.09	0.76	1.12	1.16	10.23	10.16	10.17	11
その他地方債	9,911	96.82	96.93	8.48	0.81	0.99	0.96	7.62	7.57	7.60	16
短期(1-3)	1,599	100.19	100.31	2.02	0.63	0.55	0.55	2.01	2.00	2.01	16
中期(3-7)	3,539	99.98	100.08	5.10	0.74	0.71	0.71	5.00	4.98	5.00	16
長期(7-)	4,772	93.34	93.45	13.15	0.92	1.37	1.31	11.72	11.63	11.67	17
特定金融債	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
政保地方公営企業債	1,505	98.96	98.97	2.97	0.16	0.51	0.51	2.95	2.95	2.95	6
短期(1-3)	805	99.23	99.24	2.20	0.13	0.47	0.47	2.20	2.19	2.20	7
中期(3-7)	700	98.64	98.67	3.85	0.20	0.55	0.55	3.83	3.82	3.83	6
長期(7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
その他政保債	12,725	95.89	96.14	10.15	0.82	1.03	0.99	8.72	8.66	8.68	7
短期(1-3)	2,506	99.52	99.58	2.10	0.23	0.47	0.47	2.09	2.09	2.09	7
中期(3-7)	3,472	100.93	101.13	4.65	0.75	0.59	0.59	4.57	4.55	4.57	6
長期(7-)	6,747	91.95	92.30	15.98	1.07	1.50	1.42	13.71	13.60	13.64	8
SDGs	19,402	97.10	97.26	7.31	0.61	0.97	0.95	6.62	6.58	6.60	23

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。

事業債 業種別・ポートフォリオ指標 (1/4) (2024年10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	70,172	96.06	96.24	7.41	0.75	1.13	1.10	6.32	6.27	6.29	39
短期 (1-3)	20,867	99.49	99.60	1.97	0.47	0.74	0.74	1.96	1.95	1.96	35
中期 (3-7)	26,117	98.84	99.00	4.70	0.69	0.92	0.92	4.61	4.59	4.61	39
長期 (7-)	23,188	89.83	90.10	15.35	1.07	1.79	1.68	12.77	12.65	12.66	43
長期 (7-11)	9,838	98.38	98.65	8.67	1.06	1.29	1.27	8.27	8.22	8.27	47
超長期 (11-)	13,350	83.54	83.81	20.27	1.07	2.22	2.03	16.67	16.50	16.48	40
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	96.76	96.78	4.90	0.21	0.87	0.85	4.81	4.79	4.81	33
短期 (1-3)	10	99.25	99.26	1.37	0.08	0.63	0.63	1.37	1.37	1.37	28
中期 (3-7)	20	95.52	95.54	6.66	0.28	0.99	0.97	6.60	6.57	6.60	35
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
建設業	1,137	97.83	97.97	4.41	0.47	0.91	0.90	4.25	4.23	4.25	36
短期 (1-3)	451	99.14	99.24	2.29	0.33	0.74	0.73	2.28	2.27	2.28	32
中期 (3-7)	536	98.16	98.30	4.45	0.50	0.91	0.90	4.39	4.37	4.39	38
長期 (7-)	150	92.74	93.01	10.66	0.75	1.46	1.41	10.03	9.96	10.02	42
長期 (7-11)	84	96.93	97.21	8.20	0.78	1.20	1.18	7.93	7.88	7.92	43
超長期 (11-)	66	87.41	87.67	13.80	0.71	1.83	1.72	13.00	12.89	12.98	41
食料品	1,398	97.90	98.00	4.81	0.48	0.90	0.89	4.58	4.56	4.58	33
短期 (1-3)	568	99.20	99.27	1.92	0.25	0.67	0.67	1.92	1.91	1.92	28
中期 (3-7)	510	98.24	98.32	4.41	0.46	0.88	0.87	4.36	4.34	4.36	35
長期 (7-)	320	95.05	95.22	10.57	0.91	1.39	1.35	9.88	9.81	9.87	38
長期 (7-11)	200	98.20	98.39	8.52	0.90	1.15	1.14	8.19	8.15	8.19	36
超長期 (11-)	120	89.81	89.92	13.99	0.92	1.84	1.75	12.97	12.85	12.93	43
繊維製品	225	97.88	98.06	4.77	0.53	0.94	0.93	4.55	4.52	4.55	37
短期 (1-3)	80	99.06	99.16	2.51	0.33	0.72	0.72	2.50	2.49	2.50	29
中期 (3-7)	109	98.56	98.72	4.15	0.52	0.89	0.89	4.10	4.08	4.10	38
長期 (7-)	36	93.21	93.59	11.64	1.03	1.65	1.58	10.81	10.73	10.80	50
長期 (7-11)	16	99.81	100.37	9.07	1.29	1.32	1.31	8.54	8.48	8.53	48
超長期 (11-)	20	87.93	88.17	13.71	0.83	1.95	1.83	12.89	12.77	12.87	52
パルプ・紙	325	96.57	96.71	4.98	0.44	1.09	1.07	4.69	4.66	4.69	49
短期 (1-3)	125	98.88	98.96	1.88	0.28	0.89	0.88	1.87	1.86	1.87	50
中期 (3-7)	145	96.91	97.04	4.84	0.43	1.04	1.02	4.76	4.73	4.76	48
長期 (7-)	55	90.42	90.72	12.38	0.86	1.76	1.67	11.47	11.37	11.45	52
長期 (7-11)	20	96.52	96.84	8.12	0.83	1.35	1.33	7.83	7.77	7.82	58
超長期 (11-)	35	86.94	87.23	14.82	0.88	2.02	1.89	13.78	13.65	13.75	48
化学	2,401	96.42	96.56	5.45	0.53	1.07	1.04	5.08	5.04	5.07	44
短期 (1-3)	740	99.21	99.29	2.07	0.34	0.74	0.73	2.06	2.05	2.06	34
中期 (3-7)	1,093	97.99	98.11	4.63	0.51	0.94	0.94	4.57	4.54	4.57	41
長期 (7-)	568	89.78	90.01	11.44	0.82	1.79	1.69	10.48	10.39	10.46	65
長期 (7-11)	295	96.58	96.82	8.08	0.81	1.31	1.29	7.81	7.76	7.81	55
超長期 (11-)	273	82.44	82.65	15.05	0.83	2.41	2.19	13.86	13.70	13.82	79
医薬品	725	96.24	96.33	5.95	0.50	1.05	1.02	5.58	5.55	5.57	40
短期 (1-3)	175	99.42	99.48	1.69	0.30	0.65	0.64	1.68	1.68	1.68	27
中期 (3-7)	435	96.68	96.74	5.69	0.47	1.03	1.01	5.59	5.56	5.59	43
長期 (7-)	115	89.75	89.98	13.40	0.91	1.81	1.71	12.11	12.00	12.07	50
長期 (7-11)	15	97.15	97.28	7.85	0.93	1.33	1.31	7.58	7.53	7.58	60
超長期 (11-)	100	88.64	88.89	14.23	0.91	1.89	1.77	12.85	12.74	12.80	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10月末、11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	70,661	96.08	96.26	7.44	0.75	1.14	1.10	6.35	6.30	6.32	39
短期 (1-3)	20,822	99.47	99.59	2.02	0.47	0.74	0.74	2.01	2.00	2.01	35
中期 (3-7)	26,676	98.83	98.99	4.75	0.69	0.93	0.92	4.66	4.64	4.66	39
長期 (7-)	23,163	89.86	90.13	15.40	1.08	1.79	1.68	12.81	12.69	12.70	43
長期 (7-11)	9,802	98.45	98.72	8.73	1.08	1.29	1.27	8.32	8.27	8.32	47
超長期 (11-)	13,361	83.56	83.83	20.29	1.08	2.23	2.03	16.69	16.51	16.49	40
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	96.76	96.78	4.90	0.21	0.87	0.85	4.81	4.79	4.81	33
短期 (1-3)	10	99.25	99.26	1.37	0.08	0.63	0.63	1.37	1.37	1.37	28
中期 (3-7)	20	95.52	95.54	6.66	0.28	0.99	0.97	6.60	6.57	6.60	35
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
建設業	1,255	98.01	98.15	4.44	0.52	0.92	0.91	4.28	4.26	4.28	38
短期 (1-3)	485	99.16	99.26	2.33	0.36	0.75	0.74	2.32	2.31	2.32	33
中期 (3-7)	620	98.39	98.53	4.59	0.59	0.94	0.93	4.52	4.50	4.52	41
長期 (7-)	150	92.74	93.01	10.66	0.75	1.46	1.41	10.03	9.96	10.02	42
長期 (7-11)	84	96.93	97.21	8.20	0.78	1.20	1.18	7.93	7.88	7.92	43
超長期 (11-)	66	87.41	87.67	13.80	0.71	1.83	1.72	13.00	12.89	12.98	41
食料品	1,463	97.96	98.06	5.11	0.52	0.93	0.91	4.84	4.81	4.84	33
短期 (1-3)	563	99.20	99.27	1.96	0.26	0.67	0.67	1.96	1.95	1.96	28
中期 (3-7)	545	98.28	98.37	4.46	0.47	0.87	0.86	4.41	4.39	4.41	34
長期 (7-)	355	95.49	95.66	11.11	1.00	1.44	1.40	10.27	10.19	10.24	38
長期 (7-11)	215	98.41	98.59	8.68	0.95	1.16	1.15	8.33	8.28	8.32	35
超長期 (11-)	140	91.02	91.16	14.84	1.09	1.89	1.81	13.49	13.36	13.43	43
繊維製品	225	97.88	98.06	4.77	0.53	0.94	0.93	4.55	4.52	4.55	37
短期 (1-3)	80	99.06	99.16	2.51	0.33	0.72	0.72	2.50	2.49	2.50	29
中期 (3-7)	109	98.56	98.72	4.15	0.52	0.89	0.89	4.10	4.08	4.10	38
長期 (7-)	36	93.21	93.59	11.64	1.03	1.65	1.58	10.81	10.73	10.80	50
長期 (7-11)	16	99.81	100.37	9.07	1.29	1.32	1.31	8.54	8.48	8.53	48
超長期 (11-)	20	87.93	88.17	13.71	0.83	1.95	1.83	12.89	12.77	12.87	52
パルプ・紙	325	96.57	96.71	4.98	0.44	1.09	1.07	4.69	4.66	4.69	49
短期 (1-3)	125	98.88	98.96	1.88	0.28	0.89	0.88	1.87	1.86	1.87	50
中期 (3-7)	145	96.91	97.04	4.84	0.43	1.04	1.02	4.76	4.73	4.76	48
長期 (7-)	55	90.42	90.72	12.38	0.86	1.76	1.67	11.47	11.37	11.45	52
長期 (7-11)	20	96.52	96.84	8.12	0.83	1.35	1.33	7.83	7.77	7.82	58
超長期 (11-)	35	86.94	87.23	14.82	0.88	2.02	1.89	13.78	13.65	13.75	48
化学	2,391	96.41	96.55	5.47	0.53	1.07	1.04	5.09	5.06	5.09	44
短期 (1-3)	745	99.19	99.27	2.10	0.34	0.74	0.74	2.09	2.09	2.09	34
中期 (3-7)	1,078	97.98	98.11	4.65	0.51	0.94	0.93	4.59	4.57	4.59	40
長期 (7-)	568	89.78	90.01	11.44	0.82	1.79	1.69	10.48	10.39	10.46	65
長期 (7-11)	295	96.58	96.82	8.08	0.81	1.31	1.29	7.81	7.76	7.81	55
超長期 (11-)	273	82.44	82.65	15.05	0.83	2.41	2.19	13.86	13.70	13.82	79
医薬品	845	96.75	96.84	5.92	0.56	1.04	1.01	5.59	5.55	5.58	40
短期 (1-3)	175	99.42	99.48	1.69	0.30	0.65	0.64	1.68	1.68	1.68	27
中期 (3-7)	545	97.32	97.39	5.63	0.56	1.01	0.99	5.52	5.49	5.52	42
長期 (7-)	125	90.53	90.75	13.12	0.94	1.76	1.67	11.87	11.76	11.83	49
長期 (7-11)	25	98.07	98.21	8.67	1.05	1.31	1.30	8.29	8.24	8.28	50
超長期 (11-)	100	88.64	88.89	14.23	0.91	1.89	1.77	12.85	12.74	12.80	48

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 (2/4) (2024年10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	265	96.40	96.60	6.53	0.60	1.16	1.14	6.19	6.15	6.18	49
短期 (1-3)	50	99.05	99.13	2.16	0.30	0.76	0.76	2.15	2.14	2.15	36
中期 (3-7)	95	96.62	96.72	5.43	0.39	1.02	1.00	5.36	5.33	5.36	44
長期 (7-)	120	95.12	95.45	9.22	0.90	1.45	1.41	8.60	8.54	8.59	58
長期 (7-11)	95	96.97	97.28	7.63	0.84	1.27	1.26	7.38	7.33	7.38	56
超長期 (11-)	25	88.10	88.49	15.27	1.13	2.18	2.05	13.71	13.57	13.66	64
ゴム製品	330	98.30	98.35	3.69	0.39	0.85	0.84	3.63	3.62	3.63	36
短期 (1-3)	158	99.12	99.14	2.11	0.30	0.73	0.73	2.11	2.10	2.11	33
中期 (3-7)	147	97.72	97.77	4.67	0.41	0.92	0.91	4.62	4.60	4.62	37
長期 (7-)	25	96.49	96.69	7.91	0.76	1.26	1.24	7.67	7.62	7.67	52
長期 (7-11)	25	96.49	96.69	7.91	0.76	1.26	1.24	7.67	7.62	7.67	52
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
ガラス・土石製品	257	96.58	96.72	5.42	0.51	1.05	1.03	5.08	5.05	5.08	43
短期 (1-3)	78	99.20	99.29	1.86	0.26	0.71	0.71	1.86	1.85	1.86	33
中期 (3-7)	102	97.91	98.03	4.28	0.46	0.95	0.94	4.22	4.20	4.22	43
長期 (7-)	77	92.18	92.41	10.52	0.81	1.56	1.49	9.78	9.70	9.77	53
長期 (7-11)	52	96.87	97.14	8.38	0.82	1.24	1.22	8.09	8.04	8.08	45
超長期 (11-)	25	82.38	82.54	15.00	0.80	2.36	2.15	13.94	13.79	13.91	73
鉄鋼	445	98.38	98.51	4.09	0.52	0.93	0.92	3.98	3.95	3.97	41
短期 (1-3)	160	99.09	99.18	1.98	0.28	0.75	0.75	1.97	1.97	1.97	35
中期 (3-7)	232	98.35	98.50	4.31	0.56	0.93	0.93	4.25	4.23	4.25	41
長期 (7-)	53	96.40	96.60	9.54	1.09	1.46	1.43	8.96	8.89	8.95	55
長期 (7-11)	43	98.56	98.73	8.59	1.12	1.31	1.30	8.19	8.14	8.19	51
超長期 (11-)	10	87.08	87.44	13.62	0.95	2.18	2.04	12.68	12.55	12.65	74
非鉄金属	375	98.28	98.41	4.19	0.46	0.92	0.91	4.10	4.08	4.10	39
短期 (1-3)	155	98.92	98.99	2.16	0.28	0.80	0.79	2.15	2.15	2.15	39
中期 (3-7)	170	97.95	98.10	4.71	0.53	0.96	0.95	4.64	4.62	4.64	42
長期 (7-)	50	97.42	97.66	8.70	0.81	1.14	1.12	8.39	8.35	8.39	32
長期 (7-11)	50	97.42	97.66	8.70	0.81	1.14	1.12	8.39	8.35	8.39	32
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
金属製品	186	98.70	98.83	3.79	0.54	0.91	0.91	3.73	3.71	3.73	42
短期 (1-3)	75	98.99	99.07	2.31	0.36	0.82	0.81	2.29	2.28	2.29	41
中期 (3-7)	102	98.71	98.88	4.52	0.66	0.95	0.94	4.45	4.43	4.45	42
長期 (7-)	9	96.08	96.19	7.82	0.70	1.26	1.23	7.61	7.56	7.61	52
長期 (7-11)	9	96.08	96.19	7.82	0.70	1.26	1.23	7.61	7.56	7.61	52
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
機械	1,292	98.23	98.34	4.41	0.47	0.90	0.90	4.32	4.29	4.31	37
短期 (1-3)	485	99.07	99.15	2.14	0.29	0.74	0.74	2.13	2.12	2.13	34
中期 (3-7)	580	97.82	97.93	4.79	0.48	0.93	0.92	4.72	4.70	4.72	39
長期 (7-)	227	97.46	97.63	8.29	0.82	1.18	1.17	8.01	7.96	8.01	40
長期 (7-11)	227	97.46	97.63	8.29	0.82	1.18	1.17	8.01	7.96	8.01	40
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
電気機器	2,065	98.62	98.74	4.09	0.52	0.89	0.88	4.00	3.98	4.00	38
短期 (1-3)	750	99.27	99.35	1.93	0.33	0.71	0.71	1.92	1.92	1.92	33
中期 (3-7)	1,040	98.25	98.37	4.47	0.52	0.92	0.91	4.41	4.39	4.41	39
長期 (7-)	275	98.23	98.47	8.58	1.02	1.27	1.26	8.20	8.15	8.20	47
長期 (7-11)	275	98.23	98.47	8.58	1.02	1.27	1.26	8.20	8.15	8.20	47
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
輸送用機器	1,107	97.60	97.71	4.38	0.42	0.93	0.92	4.19	4.17	4.19	39
短期 (1-3)	525	99.05	99.12	1.90	0.26	0.76	0.76	1.90	1.89	1.90	38
中期 (3-7)	373	97.98	98.09	4.57	0.47	0.90	0.89	4.51	4.49	4.51	37
長期 (7-)	209	93.27	93.50	10.28	0.76	1.45	1.40	9.73	9.66	9.72	44
長期 (7-11)	119	97.42	97.69	8.40	0.82	1.18	1.17	8.10	8.05	8.09	40
超長期 (11-)	90	87.78	87.96	12.76	0.67	1.84	1.73	12.13	12.02	12.11	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10月末、11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	265	96.40	96.60	6.53	0.60	1.16	1.14	6.19	6.15	6.18	49
短期 (1-3)	50	99.05	99.13	2.16	0.30	0.76	0.76	2.15	2.14	2.15	36
中期 (3-7)	95	96.62	96.72	5.43	0.39	1.02	1.00	5.36	5.33	5.36	44
長期 (7-)	120	95.12	95.45	9.22	0.90	1.45	1.41	8.60	8.54	8.59	58
長期 (7-11)	95	96.97	97.28	7.63	0.84	1.27	1.26	7.38	7.33	7.38	56
超長期 (11-)	25	88.10	88.49	15.27	1.13	2.18	2.05	13.71	13.57	13.66	64
ゴム製品	330	98.30	98.35	3.69	0.39	0.85	0.84	3.63	3.62	3.63	36
短期 (1-3)	158	99.12	99.14	2.11	0.30	0.73	0.73	2.11	2.10	2.11	33
中期 (3-7)	147	97.72	97.77	4.67	0.41	0.92	0.91	4.62	4.60	4.62	37
長期 (7-)	25	96.49	96.69	7.91	0.76	1.26	1.24	7.67	7.62	7.67	52
長期 (7-11)	25	96.49	96.69	7.91	0.76	1.26	1.24	7.67	7.62	7.67	52
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
ガラス・土石製品	277	96.81	96.96	5.56	0.54	1.05	1.03	5.23	5.20	5.23	42
短期 (1-3)	83	99.15	99.24	1.94	0.27	0.72	0.72	1.93	1.92	1.93	33
中期 (3-7)	107	98.05	98.18	4.39	0.49	0.94	0.93	4.33	4.31	4.33	41
長期 (7-)	87	93.08	93.30	10.44	0.87	1.53	1.46	9.71	9.64	9.70	51
長期 (7-11)	62	97.37	97.62	8.61	0.89	1.25	1.23	8.28	8.23	8.28	44
超長期 (11-)	25	82.38	82.54	15.00	0.80	2.36	2.15	13.94	13.79	13.91	73
鉄鋼	445	98.38	98.51	4.09	0.52	0.93	0.92	3.98	3.95	3.97	41
短期 (1-3)	160	99.09	99.18	1.98	0.28	0.75	0.75	1.97	1.97	1.97	35
中期 (3-7)	232	98.35	98.50	4.31	0.56	0.93	0.93	4.25	4.23	4.25	41
長期 (7-)	53	96.40	96.60	9.54	1.09	1.46	1.43	8.96	8.89	8.95	55
長期 (7-11)	43	98.56	98.73	8.59	1.12	1.31	1.30	8.19	8.14	8.19	51
超長期 (11-)	10	87.08	87.44	13.62	0.95	2.18	2.04	12.68	12.55	12.65	74
非鉄金属	375	98.28	98.41	4.19	0.46	0.92	0.91	4.10	4.08	4.10	39
短期 (1-3)	165	98.93	99.00	2.22	0.30	0.80	0.80	2.21	2.20	2.21	39
中期 (3-7)	160	97.88	98.03	4.81	0.53	0.97	0.96	4.74	4.72	4.74	42
長期 (7-)	50	97.42	97.66	8.70	0.81	1.14	1.12	8.39	8.35	8.39	32
長期 (7-11)	50	97.42	97.66	8.70	0.81	1.14	1.12	8.39	8.35	8.39	32
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
金属製品	196	98.75	98.88	3.84	0.56	0.91	0.91	3.78	3.76	3.78	42
短期 (1-3)	75	98.99	99.07	2.31	0.36	0.82	0.81	2.29	2.28	2.29	41
中期 (3-7)	112	98.80	98.97	4.55	0.68	0.95	0.94	4.48	4.46	4.48	42
長期 (7-)	9	96.08	96.19	7.82	0.70	1.26	1.23	7.61	7.56	7.61	52
長期 (7-11)	9	96.08	96.19	7.82	0.70	1.26	1.23	7.61	7.56	7.61	52
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
機械	1,312	98.26	98.37	4.69	0.51	0.93	0.92	4.57	4.55	4.57	38
短期 (1-3)	445	99.03	99.10	2.23	0.30	0.75	0.75	2.22	2.21	2.22	34
中期 (3-7)	600	97.89	97.99	4.79	0.49	0.93	0.92	4.73	4.70	4.73	38
長期 (7-)	267	97.83	98.00	8.53	0.91	1.22	1.20	8.20	8.15	8.19	42
長期 (7-11)	267	97.83	98.00	8.53	0.91	1.22	1.20	8.20	8.15	8.19	42
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
電気機器	2,090	98.63	98.75	4.14	0.53	0.89	0.89	4.05	4.03	4.05	38
短期 (1-3)	805	99.23	99.31	2.06	0.34	0.72	0.72	2.05	2.04	2.05	33
中期 (3-7)	1,010	98.26	98.38	4.59	0.55	0.93	0.92	4.52	4.50	4.52	39
長期 (7-)	275	98.23	98.47	8.58	1.02	1.27	1.26	8.20	8.15	8.20	47
長期 (7-11)	275	98.23	98.47	8.58	1.02	1.27	1.26	8.20	8.15	8.20	47
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
輸送用機器	1,127	97.64	97.75	4.43	0.43	0.94	0.93	4.24	4.22	4.24	39
短期 (1-3)	525	99.05	99.12	1.90	0.26	0.76	0.76	1.90	1.89	1.90	38
中期 (3-7)	383	98.02	98.13	4.58	0.47	0.90	0.89	4.51	4.49	4.51	37
長期 (7-)	219	93.57	93.81	10.26	0.79	1.46	1.40	9.70	9.63	9.69	45
長期 (7-11)	129	97.61	97.88	8.51	0.88	1.21	1.20	8.18	8.13	8.18	42
超長期 (11-)	90	87.78	87.96	12.76	0.67	1.84	1.73	12.13	12.02	12.11	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 (3/4) (2024年10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	240	98.32	98.38	4.36	0.58	0.96	0.96	4.26	4.23	4.26	44
短期 (1-3)	80	99.47	99.50	2.07	0.39	0.69	0.68	2.06	2.05	2.06	29
中期 (3-7)	125	97.95	98.04	4.79	0.60	1.02	1.01	4.72	4.69	4.72	48
長期 (7-)	35	97.01	97.04	8.04	0.97	1.40	1.38	7.74	7.69	7.74	64
長期 (7-11)	35	97.01	97.04	8.04	0.97	1.40	1.38	7.74	7.69	7.74	64
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
その他製品	180	95.11	95.25	7.13	0.52	1.11	1.08	6.69	6.65	6.68	36
短期 (1-3)	15	98.61	98.68	2.27	0.20	0.84	0.83	2.26	2.25	2.26	42
中期 (3-7)	120	98.12	98.29	5.10	0.52	0.90	0.89	5.03	5.00	5.03	34
長期 (7-)	45	85.92	86.01	14.18	0.63	1.86	1.73	13.45	13.33	13.43	38
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	45	85.92	86.01	14.18	0.63	1.86	1.73	13.45	13.33	13.43	38
電気・ガス業	12,262	95.07	95.25	8.08	0.81	1.30	1.25	7.08	7.03	7.06	49
短期 (1-3)	2,679	99.48	99.58	2.09	0.47	0.73	0.73	2.08	2.07	2.08	34
中期 (3-7)	4,221	98.32	98.48	4.95	0.73	1.05	1.04	4.85	4.83	4.85	50
長期 (7-)	5,362	90.32	90.55	13.53	1.05	1.83	1.73	11.74	11.63	11.68	57
長期 (7-11)	2,525	97.32	97.54	8.74	1.06	1.41	1.40	8.32	8.26	8.32	59
超長期 (11-)	2,838	84.10	84.33	17.79	1.04	2.26	2.07	15.25	15.09	15.15	55
陸運業	5,914	90.46	90.64	13.43	1.03	1.49	1.37	10.19	10.10	10.06	35
短期 (1-3)	679	100.53	100.68	1.95	0.87	0.67	0.67	1.94	1.93	1.94	28
中期 (3-7)	1,645	100.74	100.92	5.00	1.07	0.86	0.87	4.86	4.84	4.86	32
長期 (7-)	3,590	83.84	84.03	19.46	1.03	2.02	1.81	15.00	14.84	14.77	38
長期 (7-11)	1,044	99.95	100.18	8.84	1.16	1.17	1.17	8.39	8.34	8.39	36
超長期 (11-)	2,546	77.24	77.41	23.82	0.98	2.46	2.15	18.50	18.29	18.16	39
海運業	169	99.20	99.43	5.00	0.92	1.05	1.05	4.83	4.81	4.83	48
短期 (1-3)	20	101.06	101.56	1.69	1.46	0.79	0.79	1.67	1.66	1.67	41
中期 (3-7)	119	99.23	99.40	4.48	0.77	1.01	1.01	4.40	4.37	4.40	48
長期 (7-)	30	97.85	98.14	9.25	1.14	1.41	1.39	8.77	8.71	8.77	53
長期 (7-11)	30	97.85	98.14	9.25	1.14	1.41	1.39	8.77	8.71	8.77	53
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
空運業	315	94.47	94.83	7.97	0.98	1.65	1.59	7.19	7.12	7.18	79
短期 (1-3)	90	99.34	99.52	1.79	0.65	1.03	1.03	1.78	1.77	1.78	65
中期 (3-7)	40	96.16	96.23	4.52	0.36	1.24	1.22	4.48	4.45	4.48	69
長期 (7-)	185	91.73	92.25	11.72	1.28	2.06	1.96	10.64	10.53	10.62	88
長期 (7-11)	85	99.75	100.41	9.34	1.53	1.57	1.57	8.68	8.61	8.67	70
超長期 (11-)	100	84.91	85.31	13.74	1.07	2.55	2.36	12.61	12.46	12.58	106
倉庫・運輸関連業	129	95.96	96.09	6.50	0.63	1.19	1.16	6.14	6.09	6.13	49
短期 (1-3)	17	99.95	100.14	2.12	0.82	0.83	0.83	2.10	2.09	2.10	44
中期 (3-7)	75	97.20	97.29	4.84	0.44	1.05	1.03	4.78	4.76	4.78	50
長期 (7-)	37	91.56	91.72	11.95	0.93	1.68	1.60	11.14	11.05	11.12	49
長期 (7-11)	17	98.73	98.88	9.17	1.18	1.33	1.33	8.71	8.65	8.70	48
超長期 (11-)	20	85.65	85.81	14.25	0.72	2.01	1.87	13.45	13.33	13.43	51
情報・通信業	2,434	97.41	97.62	4.58	0.92	1.42	1.39	4.28	4.24	4.28	85
短期 (1-3)	926	99.35	99.49	1.99	0.71	1.08	1.08	1.97	1.96	1.97	69
中期 (3-7)	1,120	97.83	98.04	4.70	0.91	1.38	1.37	4.58	4.55	4.58	84
長期 (7-)	388	91.54	91.96	10.46	1.45	2.40	2.27	9.32	9.21	9.30	133
長期 (7-11)	270	95.82	96.18	8.79	1.33	1.92	1.87	8.28	8.20	8.27	106
超長期 (11-)	118	81.71	82.27	14.32	1.73	3.69	3.36	12.13	11.93	12.06	206
卸売業	1,272	98.05	98.27	6.32	0.90	1.10	1.08	5.96	5.92	5.96	43
短期 (1-3)	178	100.31	100.57	1.95	0.94	0.76	0.76	1.93	1.92	1.93	38
中期 (3-7)	647	99.49	99.69	4.73	0.84	0.97	0.96	4.63	4.60	4.63	43
長期 (7-)	447	95.06	95.29	10.36	0.97	1.43	1.39	9.68	9.61	9.67	44
長期 (7-11)	302	98.70	98.94	8.62	1.05	1.21	1.20	8.23	8.18	8.23	41
超長期 (11-)	145	87.50	87.70	13.98	0.82	1.95	1.83	13.06	12.94	13.03	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 (3/4) (2024年10月末、11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	98.32	98.38	4.36	0.58	0.96	0.96	4.26	4.23	4.26	44
短期 (1-3)	80	99.47	99.50	2.07	0.39	0.69	0.68	2.06	2.05	2.06	29
中期 (3-7)	125	97.95	98.04	4.79	0.60	1.02	1.01	4.72	4.69	4.72	48
長期 (7-)	35	97.01	97.04	8.04	0.97	1.40	1.38	7.74	7.69	7.74	64
長期 (7-11)	35	97.01	97.04	8.04	0.97	1.40	1.38	7.74	7.69	7.74	64
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
その他製品	180	95.11	95.25	7.13	0.52	1.11	1.08	6.69	6.65	6.68	36
短期 (1-3)	15	98.61	98.68	2.27	0.20	0.84	0.83	2.26	2.25	2.26	42
中期 (3-7)	120	98.12	98.29	5.10	0.52	0.90	0.89	5.03	5.00	5.03	34
長期 (7-)	45	85.92	86.01	14.18	0.63	1.86	1.73	13.45	13.33	13.43	38
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	45	85.92	86.01	14.18	0.63	1.86	1.73	13.45	13.33	13.43	38
電気・ガス業	12,198	95.05	95.23	8.14	0.82	1.31	1.26	7.14	7.08	7.11	49
短期 (1-3)	2,663	99.45	99.55	2.16	0.47	0.74	0.74	2.15	2.14	2.15	34
中期 (3-7)	4,199	98.26	98.42	5.02	0.73	1.05	1.05	4.91	4.89	4.91	50
長期 (7-)	5,336	90.33	90.56	13.57	1.06	1.83	1.73	11.77	11.66	11.72	57
長期 (7-11)	2,499	97.41	97.63	8.78	1.08	1.42	1.40	8.36	8.30	8.35	59
超長期 (11-)	2,838	84.10	84.33	17.79	1.04	2.26	2.07	15.25	15.09	15.15	55
陸運業	6,526	89.73	89.92	14.00	1.03	1.52	1.40	10.52	10.42	10.38	35
短期 (1-3)	734	100.62	100.78	2.04	0.91	0.67	0.67	2.02	2.01	2.02	28
中期 (3-7)	1,765	100.66	100.83	5.02	1.05	0.86	0.87	4.89	4.87	4.89	32
長期 (7-)	4,027	82.95	83.16	20.12	1.04	2.06	1.84	15.38	15.22	15.14	37
長期 (7-11)	1,099	100.17	100.42	8.82	1.19	1.17	1.17	8.36	8.31	8.36	35
超長期 (11-)	2,928	76.49	76.68	24.36	0.98	2.50	2.17	18.83	18.62	18.47	39
海運業	169	99.20	99.43	5.00	0.92	1.05	1.05	4.83	4.81	4.83	48
短期 (1-3)	20	101.06	101.56	1.69	1.46	0.79	0.79	1.67	1.66	1.67	41
中期 (3-7)	119	99.23	99.40	4.48	0.77	1.01	1.01	4.40	4.37	4.40	48
長期 (7-)	30	97.85	98.14	9.25	1.14	1.41	1.39	8.77	8.71	8.77	53
長期 (7-11)	30	97.85	98.14	9.25	1.14	1.41	1.39	8.77	8.71	8.77	53
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
空運業	315	94.47	94.83	7.97	0.98	1.65	1.59	7.19	7.12	7.18	79
短期 (1-3)	90	99.34	99.52	1.79	0.65	1.03	1.03	1.78	1.77	1.78	65
中期 (3-7)	40	96.16	96.23	4.52	0.36	1.24	1.22	4.48	4.45	4.48	69
長期 (7-)	185	91.73	92.25	11.72	1.28	2.06	1.96	10.64	10.53	10.62	88
長期 (7-11)	85	99.75	100.41	9.34	1.53	1.57	1.57	8.68	8.61	8.67	70
超長期 (11-)	100	84.91	85.31	13.74	1.07	2.55	2.36	12.61	12.46	12.58	106
倉庫・運輸関連業	129	95.96	96.09	6.50	0.63	1.19	1.16	6.14	6.09	6.13	49
短期 (1-3)	17	99.95	100.14	2.12	0.82	0.83	0.83	2.10	2.09	2.10	44
中期 (3-7)	75	97.20	97.29	4.84	0.44	1.05	1.03	4.78	4.76	4.78	50
長期 (7-)	37	91.56	91.72	11.95	0.93	1.68	1.60	11.14	11.05	11.12	49
長期 (7-11)	17	98.73	98.88	9.17	1.18	1.33	1.33	8.71	8.65	8.70	48
超長期 (11-)	20	85.65	85.81	14.25	0.72	2.01	1.87	13.45	13.33	13.43	51
情報・通信業	2,474	97.45	97.66	4.60	0.94	1.42	1.40	4.30	4.27	4.30	86
短期 (1-3)	936	99.36	99.50	2.05	0.74	1.09	1.09	2.04	2.03	2.04	70
中期 (3-7)	1,180	97.71	97.92	4.76	0.92	1.41	1.39	4.64	4.61	4.64	86
長期 (7-)	358	91.57	91.99	10.75	1.50	2.41	2.28	9.53	9.42	9.51	131
長期 (7-11)	240	96.39	96.75	9.01	1.40	1.88	1.83	8.45	8.38	8.45	100
超長期 (11-)	118	81.71	82.27	14.32	1.73	3.69	3.36	12.13	11.93	12.06	206
卸売業	1,297	98.08	98.30	6.37	0.91	1.10	1.08	6.02	5.98	6.01	43
短期 (1-3)	168	100.32	100.59	2.06	0.98	0.77	0.77	2.04	2.03	2.04	38
中期 (3-7)	672	99.50	99.70	4.75	0.84	0.96	0.96	4.65	4.62	4.64	43
長期 (7-)	457	95.16	95.39	10.35	0.99	1.44	1.39	9.66	9.59	9.65	44
長期 (7-11)	312	98.73	98.97	8.66	1.06	1.22	1.21	8.26	8.21	8.26	42
超長期 (11-)	145	87.50	87.70	13.98	0.82	1.95	1.83	13.06	12.94	13.03	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 (4/4) (2024年10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	1,274	98.75	98.96	3.90	0.61	0.93	0.92	3.76	3.73	3.75	42
短期 (1-3)	530	99.41	99.53	1.62	0.36	0.70	0.69	1.61	1.61	1.61	33
中期 (3-7)	583	98.69	98.90	4.28	0.66	0.98	0.97	4.21	4.19	4.21	46
長期 (7-)	161	96.78	97.28	10.00	1.23	1.55	1.52	9.31	9.24	9.30	60
長期 (7-11)	121	99.22	99.77	8.81	1.34	1.46	1.45	8.29	8.23	8.28	64
超長期 (11-)	40	89.42	89.74	13.59	0.88	1.86	1.76	12.74	12.63	12.72	46
銀行業	1,407	100.25	100.58	3.39	1.23	1.07	1.08	3.30	3.28	3.30	61
短期 (1-3)	702	100.72	101.08	1.87	1.41	1.00	1.00	1.84	1.83	1.84	62
中期 (3-7)	667	99.82	100.10	4.67	1.05	1.14	1.14	4.55	4.52	4.54	61
長期 (7-)	38	99.29	99.68	9.07	1.16	1.27	1.26	8.59	8.53	8.58	42
長期 (7-11)	38	99.29	99.68	9.07	1.16	1.27	1.26	8.59	8.53	8.58	42
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
証券、商品先物取引業	949	99.27	99.54	2.27	0.86	1.16	1.15	2.24	2.23	2.24	75
短期 (1-3)	735	99.39	99.66	1.81	0.84	1.13	1.13	1.79	1.78	1.79	75
中期 (3-7)	210	98.94	99.24	3.79	0.94	1.23	1.22	3.72	3.70	3.72	73
長期 (7-)	5	94.79	94.93	7.84	0.90	1.65	1.61	7.57	7.51	7.57	90
長期 (7-11)	5	94.79	94.93	7.84	0.90	1.65	1.61	7.57	7.51	7.57	90
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
保険業	330	98.37	98.43	3.40	0.38	0.88	0.88	3.34	3.32	3.34	40
短期 (1-3)	210	98.82	98.90	2.29	0.26	0.79	0.79	2.28	2.27	2.28	38
中期 (3-7)	70	98.68	98.68	3.49	0.48	0.87	0.87	3.46	3.45	3.46	39
長期 (7-)	50	96.06	96.10	7.95	0.75	1.30	1.27	7.73	7.68	7.73	55
長期 (7-11)	50	96.06	96.10	7.95	0.75	1.30	1.27	7.73	7.68	7.73	55
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
その他金融業	6,468	98.53	98.66	3.83	0.50	0.90	0.90	3.73	3.71	3.73	40
短期 (1-3)	2,832	99.22	99.30	1.85	0.34	0.78	0.78	1.84	1.84	1.84	40
中期 (3-7)	2,995	98.37	98.52	4.56	0.56	0.92	0.91	4.49	4.47	4.49	38
長期 (7-)	641	96.27	96.47	9.18	0.96	1.40	1.36	8.69	8.63	8.68	52
長期 (7-11)	563	97.70	97.92	8.51	0.96	1.29	1.27	8.17	8.12	8.17	49
超長期 (11-)	78	85.90	86.03	14.03	0.96	2.26	2.10	12.96	12.83	12.93	78
不動産業	2,640	95.51	95.69	7.53	0.75	1.22	1.18	6.54	6.49	6.51	46
短期 (1-3)	556	99.59	99.68	2.22	0.56	0.80	0.80	2.21	2.20	2.21	39
中期 (3-7)	1,074	98.05	98.19	4.72	0.59	1.00	0.99	4.64	4.62	4.64	46
長期 (7-)	1,011	90.56	90.84	13.43	1.01	1.72	1.62	11.32	11.22	11.25	51
長期 (7-11)	538	98.15	98.49	8.51	1.03	1.26	1.25	8.13	8.08	8.13	47
超長期 (11-)	473	81.93	82.13	19.02	1.00	2.34	2.12	15.67	15.50	15.50	57
サービス業	836	92.70	92.92	5.59	0.71	2.01	1.87	5.17	5.12	5.17	128
短期 (1-3)	230	97.61	97.72	2.11	0.37	1.55	1.53	2.10	2.09	2.10	113
中期 (3-7)	336	97.44	97.57	5.02	0.59	1.15	1.13	4.94	4.91	4.94	58
長期 (7-)	270	82.63	83.03	9.26	1.16	3.73	3.32	8.59	8.46	8.59	247
長期 (7-11)	220	85.78	86.14	8.48	1.10	3.35	3.04	8.08	7.97	8.08	226
超長期 (11-)	50	68.79	69.36	12.66	1.45	5.80	4.82	11.39	11.13	11.36	361
財投機関債	20,790	95.80	96.02	9.33	0.81	1.06	1.02	7.69	7.63	7.64	19
短期 (1-3)	5,804	99.73	99.83	1.96	0.41	0.56	0.56	1.95	1.94	1.95	17
中期 (3-7)	6,381	100.01	100.19	4.61	0.72	0.71	0.71	4.53	4.51	4.53	18
長期 (7-)	8,605	90.03	90.36	17.79	1.15	1.74	1.63	14.58	14.44	14.43	21
長期 (7-11)	2,471	100.90	101.22	8.82	1.11	1.00	1.01	8.38	8.34	8.38	19
超長期 (11-)	6,134	85.65	85.98	21.41	1.16	2.08	1.93	17.51	17.34	17.30	22

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 業種別・ポートフォリオ指標 (4/4) (2024年10月末、11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	1,280	98.75	98.96	3.90	0.61	0.93	0.93	3.76	3.74	3.76	42
短期 (1-3)	530	99.41	99.53	1.62	0.36	0.70	0.69	1.61	1.61	1.61	33
中期 (3-7)	589	98.70	98.91	4.28	0.67	0.98	0.98	4.21	4.19	4.21	46
長期 (7-)	161	96.78	97.28	10.00	1.23	1.55	1.52	9.31	9.24	9.30	60
長期 (7-11)	121	99.22	99.77	8.81	1.34	1.46	1.45	8.29	8.23	8.28	64
超長期 (11-)	40	89.42	89.74	13.59	0.88	1.86	1.76	12.74	12.63	12.72	46
銀行業	1,349	100.24	100.55	3.56	1.24	1.09	1.09	3.46	3.44	3.46	62
短期 (1-3)	654	100.70	101.03	1.99	1.40	1.01	1.01	1.96	1.95	1.96	62
中期 (3-7)	647	99.84	100.13	4.72	1.07	1.15	1.15	4.59	4.57	4.59	62
長期 (7-)	48	99.42	99.79	9.23	1.32	1.41	1.41	8.67	8.61	8.66	55
長期 (7-11)	48	99.42	99.79	9.23	1.32	1.41	1.41	8.67	8.61	8.66	55
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
証券、商品先物取引業	910	99.19	99.42	2.33	0.78	1.14	1.14	2.29	2.28	2.29	73
短期 (1-3)	695	99.29	99.51	1.85	0.74	1.11	1.11	1.83	1.82	1.83	72
中期 (3-7)	210	98.94	99.24	3.79	0.94	1.23	1.22	3.72	3.70	3.72	73
長期 (7-)	5	94.79	94.93	7.84	0.90	1.65	1.61	7.57	7.51	7.57	90
長期 (7-11)	5	94.79	94.93	7.84	0.90	1.65	1.61	7.57	7.51	7.57	90
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
保険業	330	98.37	98.43	3.40	0.38	0.88	0.88	3.34	3.32	3.34	40
短期 (1-3)	210	98.82	98.90	2.29	0.26	0.79	0.79	2.28	2.27	2.28	38
中期 (3-7)	70	98.68	98.68	3.49	0.48	0.87	0.87	3.46	3.45	3.46	39
長期 (7-)	50	96.06	96.10	7.95	0.75	1.30	1.27	7.73	7.68	7.73	55
長期 (7-11)	50	96.06	96.10	7.95	0.75	1.30	1.27	7.73	7.68	7.73	55
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
その他金融業	6,598	98.56	98.68	3.86	0.51	0.90	0.90	3.76	3.74	3.75	40
短期 (1-3)	2,877	99.23	99.32	1.90	0.36	0.78	0.78	1.89	1.88	1.89	40
中期 (3-7)	3,090	98.40	98.55	4.59	0.57	0.92	0.91	4.52	4.49	4.52	38
長期 (7-)	631	96.26	96.46	9.21	0.96	1.40	1.37	8.72	8.66	8.71	52
長期 (7-11)	553	97.72	97.94	8.54	0.96	1.29	1.28	8.19	8.14	8.19	49
超長期 (11-)	78	85.90	86.03	14.03	0.96	2.26	2.10	12.96	12.83	12.93	78
不動産業	2,640	95.51	95.69	7.53	0.75	1.22	1.18	6.54	6.49	6.51	46
短期 (1-3)	556	99.59	99.68	2.22	0.56	0.80	0.80	2.21	2.20	2.21	39
中期 (3-7)	1,089	97.99	98.13	4.75	0.59	1.01	1.00	4.67	4.65	4.67	46
長期 (7-)	996	90.52	90.80	13.52	1.02	1.72	1.62	11.39	11.29	11.31	51
長期 (7-11)	528	98.22	98.56	8.58	1.04	1.26	1.25	8.19	8.13	8.18	46
超長期 (11-)	468	81.83	82.04	19.10	1.00	2.35	2.12	15.73	15.56	15.56	57
サービス業	846	92.79	93.00	5.58	0.72	2.00	1.87	5.17	5.11	5.17	128
短期 (1-3)	230	97.61	97.72	2.11	0.37	1.55	1.53	2.10	2.09	2.10	113
中期 (3-7)	346	97.51	97.64	5.01	0.62	1.16	1.14	4.93	4.91	4.93	59
長期 (7-)	270	82.63	83.03	9.26	1.16	3.73	3.32	8.59	8.46	8.59	247
長期 (7-11)	220	85.78	86.14	8.48	1.10	3.35	3.04	8.08	7.97	8.08	226
超長期 (11-)	50	68.79	69.36	12.66	1.45	5.80	4.82	11.39	11.13	11.36	361
財投機関債	20,230	96.20	96.42	9.05	0.81	1.05	1.01	7.57	7.51	7.52	19
短期 (1-3)	5,699	99.70	99.80	1.99	0.40	0.56	0.56	1.98	1.97	1.98	17
中期 (3-7)	6,432	99.96	100.14	4.66	0.72	0.71	0.71	4.58	4.56	4.58	18
長期 (7-)	8,099	90.75	91.09	17.51	1.17	1.72	1.62	14.48	14.35	14.35	21
長期 (7-11)	2,351	100.90	101.22	8.94	1.13	1.01	1.01	8.49	8.44	8.48	19
超長期 (11-)	5,748	86.60	86.95	21.01	1.18	2.05	1.91	17.34	17.16	17.14	21

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10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	52,567	95.85	96.03	7.97	0.74	1.09	1.05	6.65	6.60	6.61	31
短期 (1-3)	15,528	99.59	99.70	1.97	0.45	0.67	0.67	1.96	1.95	1.96	28
中期 (3-7)	18,911	99.12	99.28	4.69	0.68	0.85	0.85	4.61	4.59	4.61	32
長期 (7-)	18,128	89.23	89.50	16.52	1.06	1.75	1.63	13.50	13.38	13.37	32
長期 (7-11)	6,994	99.12	99.38	8.71	1.03	1.15	1.14	8.31	8.27	8.31	34
超長期 (11-)	11,134	83.01	83.29	21.43	1.08	2.20	2.00	17.39	17.21	17.17	31
AAA~A 格	73,297	96.19	96.38	7.25	0.76	1.14	1.11	6.19	6.15	6.16	41
短期 (1-3)	22,556	99.49	99.62	1.99	0.51	0.77	0.77	1.97	1.97	1.97	38
中期 (3-7)	27,276	98.84	99.00	4.67	0.70	0.94	0.94	4.58	4.56	4.58	41
長期 (7-)	23,465	89.94	90.21	15.30	1.08	1.79	1.68	12.73	12.61	12.62	44
長期 (7-11)	9,995	98.37	98.64	8.67	1.07	1.29	1.28	8.27	8.21	8.26	48
超長期 (11-)	13,471	83.68	83.96	20.22	1.09	2.23	2.03	16.62	16.44	16.43	41
AAA~BBB 格	73,297	96.19	96.38	7.25	0.76	1.14	1.11	6.19	6.15	6.16	41
短期 (1-3)	22,556	99.49	99.62	1.99	0.51	0.77	0.77	1.97	1.97	1.97	38
中期 (3-7)	27,276	98.84	99.00	4.67	0.70	0.94	0.94	4.58	4.56	4.58	41
長期 (7-)	23,465	89.94	90.21	15.30	1.08	1.79	1.68	12.73	12.61	12.62	44
長期 (7-11)	9,995	98.37	98.64	8.67	1.07	1.29	1.28	8.27	8.21	8.26	48
超長期 (11-)	13,471	83.68	83.96	20.22	1.09	2.23	2.03	16.62	16.44	16.43	41
AAA~BB 格	73,297	96.19	96.38	7.25	0.76	1.14	1.11	6.19	6.15	6.16	41
短期 (1-3)	22,556	99.49	99.62	1.99	0.51	0.77	0.77	1.97	1.97	1.97	38
中期 (3-7)	27,276	98.84	99.00	4.67	0.70	0.94	0.94	4.58	4.56	4.58	41
長期 (7-)	23,465	89.94	90.21	15.30	1.08	1.79	1.68	12.73	12.61	12.62	44
長期 (7-11)	9,995	98.37	98.64	8.67	1.07	1.29	1.28	8.27	8.21	8.26	48
超長期 (11-)	13,471	83.68	83.96	20.22	1.09	2.23	2.03	16.62	16.44	16.43	41
AAA 格	11,570	97.30	97.40	5.43	0.44	0.81	0.78	4.68	4.65	4.66	22
短期 (1-3)	4,560	99.29	99.34	1.92	0.20	0.58	0.58	1.91	1.91	1.91	19
中期 (3-7)	5,112	98.70	98.81	4.58	0.47	0.75	0.74	4.52	4.50	4.52	22
長期 (7-)	1,898	88.72	88.94	16.16	0.93	1.58	1.46	12.59	12.48	12.44	27
長期 (7-11)	1,096	98.33	98.55	8.58	0.85	1.07	1.06	8.26	8.22	8.26	27
超長期 (11-)	802	75.59	75.82	26.53	1.04	2.50	2.16	20.28	20.05	19.87	27
AA 格	40,997	95.44	95.64	8.68	0.83	1.17	1.12	7.22	7.17	7.17	34
短期 (1-3)	10,969	99.71	99.85	1.99	0.56	0.71	0.71	1.98	1.97	1.98	32
中期 (3-7)	13,798	99.27	99.45	4.73	0.75	0.89	0.89	4.64	4.62	4.64	36
長期 (7-)	16,230	89.28	89.56	16.56	1.07	1.77	1.65	13.61	13.48	13.48	33
長期 (7-11)	5,898	99.26	99.53	8.73	1.06	1.16	1.16	8.32	8.28	8.32	35
超長期 (11-)	10,332	83.59	83.87	21.03	1.08	2.18	1.99	17.19	17.01	16.98	31
A 格	20,730	97.06	97.26	5.42	0.81	1.28	1.26	5.04	5.00	5.04	65
短期 (1-3)	7,028	99.27	99.43	2.02	0.62	0.99	0.98	2.00	1.99	2.00	59
中期 (3-7)	8,365	98.20	98.37	4.62	0.75	1.14	1.13	4.53	4.51	4.53	61
長期 (7-)	5,337	92.37	92.66	11.15	1.15	1.93	1.84	10.18	10.08	10.16	82
長期 (7-11)	3,001	96.64	96.92	8.59	1.17	1.64	1.61	8.15	8.08	8.15	81
超長期 (11-)	2,336	86.89	87.17	14.44	1.13	2.34	2.18	13.08	12.94	13.04	83
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10月末、11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	53,086	95.88	96.06	7.98	0.75	1.09	1.05	6.67	6.62	6.63	31
短期 (1-3)	15,650	99.58	99.69	2.03	0.46	0.68	0.68	2.02	2.01	2.02	29
中期 (3-7)	19,316	99.11	99.26	4.74	0.68	0.86	0.85	4.65	4.63	4.65	32
長期 (7-)	18,120	89.25	89.52	16.57	1.07	1.76	1.64	13.54	13.42	13.41	32
長期 (7-11)	6,970	99.17	99.44	8.77	1.04	1.15	1.15	8.37	8.32	8.36	34
超長期 (11-)	11,150	83.05	83.32	21.45	1.08	2.20	2.00	17.41	17.22	17.18	31
AAA~A 格	74,037	96.22	96.41	7.26	0.77	1.14	1.11	6.21	6.17	6.18	41
短期 (1-3)	22,715	99.48	99.61	2.04	0.51	0.78	0.78	2.02	2.02	2.02	38
中期 (3-7)	27,881	98.82	98.99	4.72	0.70	0.95	0.94	4.63	4.61	4.63	41
長期 (7-)	23,442	89.97	90.24	15.35	1.09	1.80	1.68	12.77	12.65	12.66	44
長期 (7-11)	9,963	98.45	98.72	8.73	1.09	1.30	1.28	8.32	8.26	8.31	48
超長期 (11-)	13,479	83.71	83.98	20.24	1.09	2.23	2.03	16.63	16.46	16.44	41
AAA~BBB 格	74,037	96.22	96.41	7.26	0.77	1.14	1.11	6.21	6.17	6.18	41
短期 (1-3)	22,715	99.48	99.61	2.04	0.51	0.78	0.78	2.02	2.02	2.02	38
中期 (3-7)	27,881	98.82	98.99	4.72	0.70	0.95	0.94	4.63	4.61	4.63	41
長期 (7-)	23,442	89.97	90.24	15.35	1.09	1.80	1.68	12.77	12.65	12.66	44
長期 (7-11)	9,963	98.45	98.72	8.73	1.09	1.30	1.28	8.32	8.26	8.31	48
超長期 (11-)	13,479	83.71	83.98	20.24	1.09	2.23	2.03	16.63	16.46	16.44	41
AAA~BB 格	74,037	96.22	96.41	7.26	0.77	1.14	1.11	6.21	6.17	6.18	41
短期 (1-3)	22,715	99.48	99.61	2.04	0.51	0.78	0.78	2.02	2.02	2.02	38
中期 (3-7)	27,881	98.82	98.99	4.72	0.70	0.95	0.94	4.63	4.61	4.63	41
長期 (7-)	23,442	89.97	90.24	15.35	1.09	1.80	1.68	12.77	12.65	12.66	44
長期 (7-11)	9,963	98.45	98.72	8.73	1.09	1.30	1.28	8.32	8.26	8.31	48
超長期 (11-)	13,479	83.71	83.98	20.24	1.09	2.23	2.03	16.63	16.46	16.44	41
AAA 格	11,605	97.30	97.41	5.45	0.44	0.81	0.79	4.70	4.67	4.68	22
短期 (1-3)	4,515	99.29	99.33	1.94	0.20	0.58	0.58	1.93	1.92	1.93	20
中期 (3-7)	5,222	98.70	98.81	4.60	0.47	0.75	0.74	4.54	4.52	4.54	22
長期 (7-)	1,868	88.62	88.84	16.31	0.94	1.60	1.47	12.69	12.57	12.53	27
長期 (7-11)	1,066	98.42	98.63	8.62	0.87	1.08	1.07	8.29	8.25	8.29	27
超長期 (11-)	802	75.59	75.82	26.53	1.04	2.50	2.16	20.28	20.05	19.87	27
AA 格	41,481	95.48	95.69	8.68	0.83	1.17	1.12	7.24	7.18	7.19	34
短期 (1-3)	11,135	99.70	99.83	2.06	0.56	0.72	0.72	2.05	2.04	2.05	32
中期 (3-7)	14,094	99.26	99.43	4.79	0.76	0.90	0.89	4.69	4.67	4.69	36
長期 (7-)	16,252	89.32	89.60	16.60	1.08	1.77	1.66	13.64	13.52	13.51	33
長期 (7-11)	5,904	99.31	99.58	8.80	1.08	1.17	1.16	8.38	8.33	8.38	35
超長期 (11-)	10,348	83.63	83.90	21.05	1.09	2.18	1.99	17.20	17.03	16.99	31
A 格	20,952	97.09	97.28	5.44	0.81	1.28	1.26	5.07	5.03	5.06	65
短期 (1-3)	7,065	99.26	99.42	2.06	0.62	0.99	0.99	2.04	2.03	2.04	59
中期 (3-7)	8,565	98.19	98.36	4.67	0.76	1.15	1.14	4.57	4.55	4.57	61
長期 (7-)	5,321	92.43	92.71	11.19	1.16	1.93	1.84	10.21	10.11	10.19	82
長期 (7-11)	2,993	96.76	97.04	8.64	1.19	1.64	1.60	8.20	8.13	8.19	81
超長期 (11-)	2,328	86.86	87.15	14.45	1.12	2.34	2.18	13.09	12.95	13.05	83
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10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	51,233	95.75	95.94	8.09	0.74	1.09	1.05	6.75	6.70	6.71	30
短期(1-3)	14,813	99.59	99.70	1.96	0.44	0.66	0.66	1.95	1.95	1.95	27
中期(3-7)	18,351	99.12	99.27	4.71	0.67	0.84	0.84	4.63	4.61	4.63	31
長期(7-)	18,069	89.19	89.46	16.54	1.06	1.75	1.63	13.52	13.40	13.39	32
長期(7-11)	6,939	99.12	99.38	8.71	1.02	1.14	1.14	8.32	8.27	8.31	34
超長期(11-)	11,130	83.01	83.28	21.43	1.08	2.20	2.00	17.40	17.21	17.17	31
AAA～A格	70,172	96.06	96.24	7.41	0.75	1.13	1.10	6.32	6.27	6.29	39
短期(1-3)	20,867	99.49	99.60	1.97	0.47	0.74	0.74	1.96	1.95	1.96	35
中期(3-7)	26,117	98.84	99.00	4.70	0.69	0.92	0.92	4.61	4.59	4.61	39
長期(7-)	23,188	89.83	90.10	15.35	1.07	1.79	1.68	12.77	12.65	12.66	43
長期(7-11)	9,838	98.38	98.65	8.67	1.06	1.29	1.27	8.27	8.22	8.27	47
超長期(11-)	13,350	83.54	83.81	20.27	1.07	2.22	2.03	16.67	16.50	16.48	40
AAA～BBB格	70,172	96.06	96.24	7.41	0.75	1.13	1.10	6.32	6.27	6.29	39
短期(1-3)	20,867	99.49	99.60	1.97	0.47	0.74	0.74	1.96	1.95	1.96	35
中期(3-7)	26,117	98.84	99.00	4.70	0.69	0.92	0.92	4.61	4.59	4.61	39
長期(7-)	23,188	89.83	90.10	15.35	1.07	1.79	1.68	12.77	12.65	12.66	43
長期(7-11)	9,838	98.38	98.65	8.67	1.06	1.29	1.27	8.27	8.22	8.27	47
超長期(11-)	13,350	83.54	83.81	20.27	1.07	2.22	2.03	16.67	16.50	16.48	40
AAA～BB格	70,172	96.06	96.24	7.41	0.75	1.13	1.10	6.32	6.27	6.29	39
短期(1-3)	20,867	99.49	99.60	1.97	0.47	0.74	0.74	1.96	1.95	1.96	35
中期(3-7)	26,117	98.84	99.00	4.70	0.69	0.92	0.92	4.61	4.59	4.61	39
長期(7-)	23,188	89.83	90.10	15.35	1.07	1.79	1.68	12.77	12.65	12.66	43
長期(7-11)	9,838	98.38	98.65	8.67	1.06	1.29	1.27	8.27	8.22	8.27	47
超長期(11-)	13,350	83.54	83.81	20.27	1.07	2.22	2.03	16.67	16.50	16.48	40
AAA格	11,570	97.30	97.40	5.43	0.44	0.81	0.78	4.68	4.65	4.66	22
短期(1-3)	4,560	99.29	99.34	1.92	0.20	0.58	0.58	1.91	1.91	1.91	19
中期(3-7)	5,112	98.70	98.81	4.58	0.47	0.75	0.74	4.52	4.50	4.52	22
長期(7-)	1,898	88.72	88.94	16.16	0.93	1.58	1.46	12.59	12.48	12.44	27
長期(7-11)	1,096	98.33	98.55	8.58	0.85	1.07	1.06	8.26	8.22	8.26	27
超長期(11-)	802	75.59	75.82	26.53	1.04	2.50	2.16	20.28	20.05	19.87	27
AA格	39,663	95.30	95.51	8.87	0.83	1.17	1.12	7.36	7.31	7.32	33
短期(1-3)	10,254	99.73	99.86	1.98	0.55	0.69	0.69	1.97	1.97	1.97	30
中期(3-7)	13,239	99.27	99.45	4.76	0.74	0.88	0.88	4.67	4.65	4.67	34
長期(7-)	16,171	89.25	89.52	16.59	1.07	1.77	1.65	13.63	13.51	13.50	33
長期(7-11)	5,843	99.26	99.53	8.73	1.06	1.16	1.15	8.33	8.28	8.32	35
超長期(11-)	10,328	83.58	83.86	21.03	1.08	2.18	1.99	17.19	17.01	16.98	31
A格	18,939	96.87	97.06	5.56	0.77	1.26	1.23	5.17	5.13	5.17	62
短期(1-3)	6,054	99.23	99.36	1.99	0.54	0.93	0.93	1.98	1.97	1.98	54
中期(3-7)	7,766	98.18	98.35	4.67	0.73	1.12	1.11	4.58	4.56	4.58	58
長期(7-)	5,119	92.09	92.36	11.14	1.11	1.91	1.82	10.19	10.10	10.17	80
長期(7-11)	2,899	96.61	96.89	8.59	1.16	1.63	1.59	8.15	8.09	8.15	80
超長期(11-)	2,220	86.19	86.45	14.47	1.05	2.33	2.16	13.17	13.03	13.13	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 最高格付別・ポートフォリオ指標 (2024年10月末、11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	51,540	95.78	95.96	8.12	0.74	1.09	1.05	6.78	6.73	6.74	30
短期 (1-3)	14,779	99.58	99.69	2.01	0.44	0.66	0.66	2.00	2.00	2.00	27
中期 (3-7)	18,700	99.10	99.26	4.76	0.67	0.85	0.84	4.67	4.65	4.67	31
長期 (7-)	18,061	89.22	89.49	16.59	1.07	1.76	1.64	13.56	13.44	13.43	32
長期 (7-11)	6,915	99.17	99.44	8.77	1.04	1.15	1.15	8.37	8.32	8.37	34
超長期 (11-)	11,146	83.04	83.32	21.45	1.08	2.20	2.00	17.41	17.23	17.18	31
AAA~A 格	70,661	96.08	96.26	7.44	0.75	1.14	1.10	6.35	6.30	6.32	39
短期 (1-3)	20,822	99.47	99.59	2.02	0.47	0.74	0.74	2.01	2.00	2.01	35
中期 (3-7)	26,676	98.83	98.99	4.75	0.69	0.93	0.92	4.66	4.64	4.66	39
長期 (7-)	23,163	89.86	90.13	15.40	1.08	1.79	1.68	12.81	12.69	12.70	43
長期 (7-11)	9,802	98.45	98.72	8.73	1.08	1.29	1.27	8.32	8.27	8.32	47
超長期 (11-)	13,361	83.56	83.83	20.29	1.08	2.23	2.03	16.69	16.51	16.49	40
AAA~BBB 格	70,661	96.08	96.26	7.44	0.75	1.14	1.10	6.35	6.30	6.32	39
短期 (1-3)	20,822	99.47	99.59	2.02	0.47	0.74	0.74	2.01	2.00	2.01	35
中期 (3-7)	26,676	98.83	98.99	4.75	0.69	0.93	0.92	4.66	4.64	4.66	39
長期 (7-)	23,163	89.86	90.13	15.40	1.08	1.79	1.68	12.81	12.69	12.70	43
長期 (7-11)	9,802	98.45	98.72	8.73	1.08	1.29	1.27	8.32	8.27	8.32	47
超長期 (11-)	13,361	83.56	83.83	20.29	1.08	2.23	2.03	16.69	16.51	16.49	40
AAA~BB 格	70,661	96.08	96.26	7.44	0.75	1.14	1.10	6.35	6.30	6.32	39
短期 (1-3)	20,822	99.47	99.59	2.02	0.47	0.74	0.74	2.01	2.00	2.01	35
中期 (3-7)	26,676	98.83	98.99	4.75	0.69	0.93	0.92	4.66	4.64	4.66	39
長期 (7-)	23,163	89.86	90.13	15.40	1.08	1.79	1.68	12.81	12.69	12.70	43
長期 (7-11)	9,802	98.45	98.72	8.73	1.08	1.29	1.27	8.32	8.27	8.32	47
超長期 (11-)	13,361	83.56	83.83	20.29	1.08	2.23	2.03	16.69	16.51	16.49	40
AAA 格	11,605	97.30	97.41	5.45	0.44	0.81	0.79	4.70	4.67	4.68	22
短期 (1-3)	4,515	99.29	99.33	1.94	0.20	0.58	0.58	1.93	1.92	1.93	20
中期 (3-7)	5,222	98.70	98.81	4.60	0.47	0.75	0.74	4.54	4.52	4.54	22
長期 (7-)	1,868	88.62	88.84	16.31	0.94	1.60	1.47	12.69	12.57	12.53	27
長期 (7-11)	1,066	98.42	98.63	8.62	0.87	1.08	1.07	8.29	8.25	8.29	27
超長期 (11-)	802	75.59	75.82	26.53	1.04	2.50	2.16	20.28	20.05	19.87	27
AA 格	39,935	95.33	95.53	8.90	0.83	1.17	1.13	7.40	7.34	7.35	33
短期 (1-3)	10,265	99.71	99.84	2.05	0.55	0.70	0.70	2.03	2.03	2.03	30
中期 (3-7)	13,478	99.26	99.43	4.82	0.75	0.89	0.88	4.72	4.70	4.72	35
長期 (7-)	16,193	89.29	89.56	16.63	1.08	1.77	1.66	13.66	13.54	13.54	33
長期 (7-11)	5,849	99.31	99.58	8.80	1.07	1.17	1.16	8.38	8.33	8.38	35
超長期 (11-)	10,344	83.62	83.90	21.05	1.09	2.18	1.99	17.21	17.03	17.00	31
A 格	19,121	96.90	97.08	5.59	0.77	1.26	1.23	5.20	5.16	5.20	62
短期 (1-3)	6,043	99.21	99.34	2.03	0.53	0.93	0.93	2.02	2.01	2.02	54
中期 (3-7)	7,976	98.18	98.35	4.72	0.74	1.12	1.11	4.62	4.60	4.62	58
長期 (7-)	5,102	92.15	92.42	11.18	1.12	1.91	1.82	10.22	10.13	10.20	80
長期 (7-11)	2,887	96.72	97.00	8.64	1.17	1.63	1.59	8.20	8.14	8.20	79
超長期 (11-)	2,215	86.18	86.44	14.48	1.05	2.33	2.16	13.18	13.04	13.14	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 最低格付別・ポートフォリオ指標 (2024年10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	11,636	95.68	95.84	7.09	0.65	1.05	1.01	5.85	5.80	5.81	34
短期(1-3)	3,731	99.50	99.61	1.95	0.44	0.69	0.69	1.94	1.93	1.94	31
中期(3-7)	4,636	98.79	98.94	4.51	0.61	0.89	0.88	4.43	4.42	4.43	36
長期(7-)	3,269	86.91	87.13	16.62	0.93	1.77	1.62	13.22	13.09	13.07	36
長期(7-11)	1,450	98.10	98.35	8.68	0.92	1.18	1.17	8.33	8.28	8.32	37
超長期(11-)	1,818	77.99	78.17	22.95	0.93	2.36	2.08	18.13	17.93	17.83	35
AAA~A格	67,924	96.04	96.22	7.43	0.74	1.13	1.09	6.33	6.28	6.29	38
短期(1-3)	20,464	99.50	99.61	1.97	0.47	0.74	0.73	1.96	1.95	1.96	35
中期(3-7)	24,938	98.82	98.97	4.70	0.67	0.91	0.91	4.62	4.60	4.62	38
長期(7-)	22,522	89.83	90.10	15.40	1.07	1.78	1.67	12.79	12.67	12.69	43
長期(7-11)	9,520	98.42	98.69	8.67	1.07	1.28	1.27	8.27	8.22	8.27	47
超長期(11-)	13,003	83.55	83.82	20.32	1.07	2.22	2.02	16.69	16.52	16.50	39
AAA~BBB格	69,932	96.04	96.22	7.41	0.74	1.13	1.09	6.32	6.28	6.29	39
短期(1-3)	20,867	99.49	99.60	1.97	0.47	0.74	0.74	1.96	1.95	1.96	35
中期(3-7)	25,902	98.81	98.97	4.70	0.67	0.92	0.91	4.62	4.59	4.62	38
長期(7-)	23,163	89.83	90.10	15.35	1.07	1.79	1.67	12.77	12.65	12.66	43
長期(7-11)	9,838	98.38	98.65	8.67	1.06	1.29	1.27	8.27	8.22	8.27	47
超長期(11-)	13,325	83.52	83.79	20.28	1.07	2.22	2.03	16.68	16.50	16.49	39
AAA~BB格	70,172	96.06	96.24	7.41	0.75	1.13	1.10	6.32	6.27	6.29	39
短期(1-3)	20,867	99.49	99.60	1.97	0.47	0.74	0.74	1.96	1.95	1.96	35
中期(3-7)	26,117	98.84	99.00	4.70	0.69	0.92	0.92	4.61	4.59	4.61	39
長期(7-)	23,188	89.83	90.10	15.35	1.07	1.79	1.68	12.77	12.65	12.66	43
長期(7-11)	9,838	98.38	98.65	8.67	1.06	1.29	1.27	8.27	8.22	8.27	47
超長期(11-)	13,350	83.54	83.81	20.27	1.07	2.22	2.03	16.67	16.50	16.48	40
AAA格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA格	11,636	95.68	95.84	7.09	0.65	1.05	1.01	5.85	5.80	5.81	34
短期(1-3)	3,731	99.50	99.61	1.95	0.44	0.69	0.69	1.94	1.93	1.94	31
中期(3-7)	4,636	98.79	98.94	4.51	0.61	0.89	0.88	4.43	4.42	4.43	36
長期(7-)	3,269	86.91	87.13	16.62	0.93	1.77	1.62	13.22	13.09	13.07	36
長期(7-11)	1,450	98.10	98.35	8.68	0.92	1.18	1.17	8.33	8.28	8.32	37
超長期(11-)	1,818	77.99	78.17	22.95	0.93	2.36	2.08	18.13	17.93	17.83	35
A格	56,289	96.12	96.31	7.50	0.76	1.14	1.11	6.43	6.38	6.39	39
短期(1-3)	16,733	99.50	99.61	1.98	0.48	0.74	0.74	1.96	1.96	1.96	35
中期(3-7)	20,302	98.82	98.98	4.75	0.68	0.92	0.91	4.66	4.64	4.66	38
長期(7-)	19,254	90.33	90.61	15.19	1.10	1.79	1.68	12.72	12.61	12.62	44
長期(7-11)	8,069	98.47	98.75	8.67	1.09	1.30	1.28	8.26	8.21	8.26	48
超長期(11-)	11,184	84.45	84.73	19.90	1.10	2.20	2.01	16.47	16.30	16.30	40
BBB格	2,007	95.91	96.09	6.99	0.73	1.23	1.19	6.25	6.20	6.23	49
短期(1-3)	403	98.92	99.02	2.06	0.37	0.91	0.90	2.05	2.04	2.05	50
中期(3-7)	964	98.74	98.90	4.64	0.70	0.99	0.98	4.56	4.54	4.56	45
長期(7-)	641	89.78	90.03	13.64	1.00	1.84	1.73	11.94	11.83	11.88	55
長期(7-11)	318	97.20	97.46	8.61	1.01	1.40	1.38	8.24	8.19	8.24	58
超長期(11-)	323	82.46	82.70	18.59	0.99	2.35	2.14	16.23	16.05	16.11	52
BB格	240	100.83	101.45	5.57	2.26	1.93	1.93	5.04	4.99	5.03	132
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	215	101.69	102.26	4.41	2.25	1.82	1.83	4.20	4.16	4.20	131
長期(7-)	25	93.47	94.48	15.57	2.37	2.98	2.89	12.87	12.69	12.79	147
長期(7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期(11-)	25	93.47	94.48	15.57	2.37	2.98	2.89	12.87	12.69	12.79	147
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10月末、11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	12,147	95.76	95.91	7.06	0.65	1.05	1.01	5.86	5.81	5.82	35
短期 (1-3)	3,885	99.48	99.59	2.02	0.44	0.70	0.70	2.01	2.00	2.01	31
中期 (3-7)	4,926	98.77	98.92	4.59	0.63	0.90	0.89	4.51	4.49	4.51	37
長期 (7-)	3,336	86.99	87.20	16.60	0.93	1.77	1.63	13.22	13.10	13.07	36
長期 (7-11)	1,480	98.12	98.37	8.70	0.93	1.18	1.17	8.34	8.30	8.34	37
超長期 (11-)	1,856	78.11	78.29	22.89	0.93	2.36	2.09	18.11	17.91	17.82	36
AAA~A 格	68,645	96.07	96.25	7.44	0.75	1.13	1.09	6.35	6.31	6.32	38
短期 (1-3)	20,490	99.48	99.60	2.02	0.47	0.74	0.74	2.01	2.00	2.01	34
中期 (3-7)	25,627	98.80	98.96	4.75	0.68	0.92	0.91	4.66	4.64	4.66	38
長期 (7-)	22,529	89.87	90.14	15.44	1.08	1.79	1.68	12.83	12.71	12.72	42
長期 (7-11)	9,506	98.50	98.77	8.74	1.08	1.28	1.27	8.32	8.27	8.32	46
超長期 (11-)	13,024	83.57	83.84	20.34	1.08	2.22	2.02	16.70	16.53	16.51	39
AAA~BBB 格	70,421	96.06	96.24	7.44	0.75	1.13	1.10	6.36	6.31	6.32	39
短期 (1-3)	20,822	99.47	99.59	2.02	0.47	0.74	0.74	2.01	2.00	2.01	35
中期 (3-7)	26,461	98.80	98.96	4.75	0.68	0.92	0.92	4.66	4.64	4.66	38
長期 (7-)	23,138	89.86	90.13	15.40	1.08	1.79	1.68	12.81	12.69	12.70	43
長期 (7-11)	9,802	98.45	98.72	8.73	1.08	1.29	1.27	8.32	8.27	8.32	47
超長期 (11-)	13,336	83.54	83.81	20.30	1.08	2.22	2.03	16.69	16.52	16.50	39
AAA~BB 格	70,661	96.08	96.26	7.44	0.75	1.14	1.10	6.35	6.30	6.32	39
短期 (1-3)	20,822	99.47	99.59	2.02	0.47	0.74	0.74	2.01	2.00	2.01	35
中期 (3-7)	26,676	98.83	98.99	4.75	0.69	0.93	0.92	4.66	4.64	4.66	39
長期 (7-)	23,163	89.86	90.13	15.40	1.08	1.79	1.68	12.81	12.69	12.70	43
長期 (7-11)	9,802	98.45	98.72	8.73	1.08	1.29	1.27	8.32	8.27	8.32	47
超長期 (11-)	13,361	83.56	83.83	20.29	1.08	2.23	2.03	16.69	16.51	16.49	40
AAA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA 格	12,147	95.76	95.91	7.06	0.65	1.05	1.01	5.86	5.81	5.82	35
短期 (1-3)	3,885	99.48	99.59	2.02	0.44	0.70	0.70	2.01	2.00	2.01	31
中期 (3-7)	4,926	98.77	98.92	4.59	0.63	0.90	0.89	4.51	4.49	4.51	37
長期 (7-)	3,336	86.99	87.20	16.60	0.93	1.77	1.63	13.22	13.10	13.07	36
長期 (7-11)	1,480	98.12	98.37	8.70	0.93	1.18	1.17	8.34	8.30	8.34	37
超長期 (11-)	1,856	78.11	78.29	22.89	0.93	2.36	2.09	18.11	17.91	17.82	36
A 格	56,499	96.14	96.33	7.53	0.77	1.15	1.11	6.46	6.41	6.43	39
短期 (1-3)	16,605	99.49	99.60	2.02	0.48	0.75	0.75	2.01	2.00	2.01	35
中期 (3-7)	20,701	98.81	98.97	4.79	0.69	0.92	0.92	4.70	4.68	4.70	38
長期 (7-)	19,193	90.37	90.65	15.24	1.11	1.79	1.68	12.76	12.65	12.66	44
長期 (7-11)	8,025	98.57	98.84	8.74	1.11	1.30	1.29	8.32	8.27	8.31	48
超長期 (11-)	11,168	84.48	84.76	19.92	1.10	2.20	2.02	16.49	16.32	16.31	40
BBB 格	1,775	95.61	95.81	7.31	0.76	1.28	1.23	6.50	6.45	6.48	52
短期 (1-3)	333	98.87	98.98	2.11	0.42	0.96	0.95	2.10	2.09	2.10	55
中期 (3-7)	834	98.79	98.98	4.66	0.73	1.01	1.00	4.57	4.55	4.57	47
長期 (7-)	609	89.47	89.73	13.80	1.00	1.87	1.75	12.06	11.94	12.00	56
長期 (7-11)	296	96.86	97.14	8.62	0.99	1.43	1.40	8.25	8.19	8.25	60
超長期 (11-)	313	82.46	82.71	18.71	1.00	2.36	2.14	16.29	16.12	16.17	52
BB 格	240	100.83	101.45	5.57	2.26	1.93	1.93	5.04	4.99	5.03	132
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	215	101.69	102.26	4.41	2.25	1.82	1.83	4.20	4.16	4.20	131
長期 (7-)	25	93.47	94.48	15.57	2.37	2.98	2.89	12.87	12.69	12.79	147
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	25	93.47	94.48	15.57	2.37	2.98	2.89	12.87	12.69	12.79	147
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10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	41,256	95.61	95.80	8.62	0.78	1.09	1.05	7.08	7.03	7.03	27
短期 (1-3)	11,630	99.67	99.78	1.98	0.45	0.63	0.63	1.97	1.97	1.97	24
中期 (3-7)	14,044	99.53	99.69	4.66	0.71	0.81	0.80	4.58	4.56	4.58	27
長期 (7-)	15,583	89.06	89.34	17.13	1.09	1.75	1.63	13.85	13.72	13.71	29
長期 (7-11)	5,764	99.59	99.87	8.78	1.06	1.12	1.11	8.37	8.32	8.36	30
超長期 (11-)	9,818	82.87	83.15	22.04	1.10	2.21	2.00	17.72	17.53	17.47	29
AAA - A 格	64,051	95.97	96.15	7.64	0.75	1.12	1.09	6.48	6.43	6.44	36
短期 (1-3)	18,866	99.52	99.64	1.98	0.46	0.71	0.71	1.97	1.97	1.97	32
中期 (3-7)	23,287	98.95	99.12	4.71	0.69	0.90	0.90	4.62	4.60	4.62	37
長期 (7-)	21,898	89.73	90.00	15.63	1.07	1.78	1.66	12.94	12.82	12.83	40
長期 (7-11)	9,060	98.58	98.84	8.70	1.05	1.24	1.23	8.30	8.25	8.30	43
超長期 (11-)	12,838	83.48	83.76	20.52	1.08	2.22	2.03	16.81	16.63	16.61	38
AAA - BBB 格	64,213	95.97	96.15	7.63	0.75	1.13	1.09	6.47	6.42	6.43	37
短期 (1-3)	18,929	99.52	99.63	1.98	0.46	0.71	0.71	1.97	1.97	1.97	32
中期 (3-7)	23,375	98.95	99.11	4.71	0.69	0.91	0.90	4.62	4.60	4.62	37
長期 (7-)	21,909	89.73	89.99	15.62	1.07	1.78	1.67	12.94	12.82	12.83	40
長期 (7-11)	9,071	98.56	98.82	8.70	1.05	1.24	1.23	8.30	8.25	8.30	43
超長期 (11-)	12,838	83.48	83.76	20.52	1.08	2.22	2.03	16.81	16.63	16.61	38
AAA - BB 格	64,213	95.97	96.15	7.63	0.75	1.13	1.09	6.47	6.42	6.43	37
短期 (1-3)	18,929	99.52	99.63	1.98	0.46	0.71	0.71	1.97	1.97	1.97	32
中期 (3-7)	23,375	98.95	99.11	4.71	0.69	0.91	0.90	4.62	4.60	4.62	37
長期 (7-)	21,909	89.73	89.99	15.62	1.07	1.78	1.67	12.94	12.82	12.83	40
長期 (7-11)	9,071	98.56	98.82	8.70	1.05	1.24	1.23	8.30	8.25	8.30	43
超長期 (11-)	12,838	83.48	83.76	20.52	1.08	2.22	2.03	16.81	16.63	16.61	38
AAA 格	885	98.30	98.36	3.73	0.32	0.76	0.75	3.65	3.63	3.65	26
短期 (1-3)	465	99.13	99.16	2.05	0.20	0.65	0.64	2.05	2.04	2.05	25
中期 (3-7)	320	98.32	98.36	4.41	0.42	0.78	0.78	4.36	4.34	4.36	26
長期 (7-)	100	94.37	94.61	9.39	0.57	1.20	1.16	9.06	9.01	9.06	29
長期 (7-11)	70	96.74	97.00	8.30	0.62	1.05	1.04	8.07	8.03	8.07	27
超長期 (11-)	30	88.85	89.03	11.92	0.45	1.56	1.47	11.57	11.49	11.56	32
AA 格	40,371	95.55	95.75	8.73	0.79	1.10	1.05	7.16	7.10	7.10	27
短期 (1-3)	11,165	99.69	99.80	1.98	0.46	0.63	0.63	1.97	1.96	1.97	24
中期 (3-7)	13,724	99.55	99.72	4.67	0.72	0.81	0.80	4.58	4.56	4.58	27
長期 (7-)	15,483	89.02	89.30	17.18	1.09	1.76	1.64	13.88	13.75	13.74	29
長期 (7-11)	5,694	99.63	99.90	8.78	1.07	1.12	1.11	8.37	8.32	8.37	30
超長期 (11-)	9,788	82.85	83.13	22.07	1.11	2.21	2.00	17.74	17.55	17.49	29
A 格	22,795	96.61	96.78	5.87	0.70	1.19	1.16	5.40	5.36	5.39	53
短期 (1-3)	7,236	99.29	99.41	1.98	0.47	0.83	0.83	1.97	1.96	1.97	44
中期 (3-7)	9,243	98.08	98.24	4.78	0.66	1.06	1.05	4.69	4.66	4.69	51
長期 (7-)	6,315	91.39	91.63	11.92	1.03	1.83	1.74	10.77	10.67	10.74	67
長期 (7-11)	3,295	96.82	97.05	8.58	1.03	1.47	1.44	8.19	8.13	8.18	65
超長期 (11-)	3,020	85.47	85.72	15.56	1.02	2.27	2.10	13.96	13.81	13.90	69
BBB 格	162	96.22	96.49	3.63	1.00	2.05	2.00	3.50	3.46	3.50	152
短期 (1-3)	63	97.60	97.85	2.05	0.82	2.03	2.01	2.03	2.01	2.03	161
中期 (3-7)	88	97.46	97.72	4.32	1.12	1.75	1.72	4.21	4.18	4.21	121
長期 (7-)	11	78.45	78.85	7.13	1.07	5.22	4.66	6.81	6.65	6.81	401
長期 (7-11)	11	78.45	78.85	7.13	1.07	5.22	4.66	6.81	6.65	6.81	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	5,959	97.00	97.17	5.02	0.70	1.22	1.19	4.73	4.70	4.73	62
短期 (1-3)	1,938	99.23	99.34	1.86	0.57	0.98	0.97	1.85	1.84	1.85	59
中期 (3-7)	2,742	97.90	98.04	4.62	0.62	1.08	1.06	4.55	4.52	4.55	54
長期 (7-)	1,279	91.69	92.02	10.67	1.06	1.96	1.84	9.87	9.78	9.86	86
長期 (7-11)	767	96.23	96.61	8.32	1.21	1.78	1.70	7.90	7.84	7.90	94
超長期 (11-)	512	84.90	85.15	14.19	0.85	2.27	2.07	13.22	13.09	13.19	73

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10月末、11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	41,872	95.64	95.84	8.61	0.78	1.09	1.05	7.09	7.03	7.04	27
短期 (1-3)	11,739	99.64	99.75	2.03	0.45	0.64	0.64	2.02	2.01	2.02	24
中期 (3-7)	14,503	99.50	99.66	4.71	0.72	0.81	0.81	4.62	4.61	4.62	28
長期 (7-)	15,631	89.06	89.34	17.17	1.09	1.76	1.64	13.89	13.76	13.74	29
長期 (7-11)	5,765	99.60	99.87	8.83	1.07	1.12	1.12	8.41	8.36	8.40	30
超長期 (11-)	9,865	82.90	83.18	22.05	1.11	2.21	2.00	17.73	17.54	17.49	29
AAA~A 格	64,386	95.98	96.17	7.67	0.76	1.13	1.09	6.51	6.47	6.48	36
短期 (1-3)	18,758	99.50	99.61	2.03	0.45	0.71	0.71	2.02	2.01	2.02	32
中期 (3-7)	23,758	98.94	99.10	4.76	0.70	0.91	0.90	4.67	4.64	4.67	37
長期 (7-)	21,871	89.76	90.03	15.68	1.08	1.78	1.67	12.99	12.87	12.88	40
長期 (7-11)	9,022	98.66	98.92	8.77	1.07	1.24	1.23	8.35	8.30	8.35	43
超長期 (11-)	12,849	83.51	83.78	20.54	1.09	2.22	2.03	16.83	16.65	16.63	38
AAA~BBB 格	64,548	95.99	96.17	7.66	0.76	1.13	1.09	6.51	6.46	6.47	37
短期 (1-3)	18,820	99.50	99.61	2.03	0.46	0.72	0.72	2.02	2.01	2.02	32
中期 (3-7)	23,846	98.93	99.09	4.75	0.70	0.91	0.91	4.66	4.64	4.66	37
長期 (7-)	21,882	89.75	90.02	15.68	1.08	1.78	1.67	12.98	12.86	12.87	40
長期 (7-11)	9,033	98.64	98.89	8.77	1.07	1.25	1.24	8.35	8.30	8.35	43
超長期 (11-)	12,849	83.51	83.78	20.54	1.09	2.22	2.03	16.83	16.65	16.63	38
AAA~BB 格	64,548	95.99	96.17	7.66	0.76	1.13	1.09	6.51	6.46	6.47	37
短期 (1-3)	18,820	99.50	99.61	2.03	0.46	0.72	0.72	2.02	2.01	2.02	32
中期 (3-7)	23,846	98.93	99.09	4.75	0.70	0.91	0.91	4.66	4.64	4.66	37
長期 (7-)	21,882	89.75	90.02	15.68	1.08	1.78	1.67	12.98	12.86	12.87	40
長期 (7-11)	9,033	98.64	98.89	8.77	1.07	1.25	1.24	8.35	8.30	8.35	43
超長期 (11-)	12,849	83.51	83.78	20.54	1.09	2.22	2.03	16.83	16.65	16.63	38
AAA 格	885	98.30	98.36	3.73	0.32	0.76	0.75	3.65	3.63	3.65	26
短期 (1-3)	465	99.13	99.16	2.05	0.20	0.65	0.64	2.05	2.04	2.05	25
中期 (3-7)	320	98.32	98.36	4.41	0.42	0.78	0.78	4.36	4.34	4.36	26
長期 (7-)	100	94.37	94.61	9.39	0.57	1.20	1.16	9.06	9.01	9.06	29
長期 (7-11)	70	96.74	97.00	8.30	0.62	1.05	1.04	8.07	8.03	8.07	27
超長期 (11-)	30	88.85	89.03	11.92	0.45	1.56	1.47	11.57	11.49	11.56	32
AA 格	40,987	95.59	95.78	8.72	0.79	1.10	1.05	7.16	7.11	7.11	27
短期 (1-3)	11,274	99.67	99.78	2.03	0.46	0.64	0.64	2.02	2.01	2.02	24
中期 (3-7)	14,183	99.53	99.69	4.72	0.72	0.81	0.81	4.63	4.61	4.63	28
長期 (7-)	15,531	89.03	89.31	17.22	1.10	1.76	1.64	13.92	13.79	13.77	29
長期 (7-11)	5,695	99.63	99.91	8.83	1.08	1.12	1.12	8.41	8.36	8.41	31
超長期 (11-)	9,835	82.89	83.17	22.08	1.11	2.21	2.01	17.75	17.56	17.51	29
A 格	22,514	96.62	96.78	5.93	0.71	1.19	1.16	5.46	5.42	5.45	53
短期 (1-3)	7,019	99.27	99.38	2.03	0.46	0.84	0.84	2.02	2.01	2.02	44
中期 (3-7)	9,255	98.06	98.21	4.82	0.67	1.06	1.05	4.73	4.71	4.73	52
長期 (7-)	6,240	91.51	91.74	11.94	1.04	1.82	1.74	10.79	10.69	10.76	67
長期 (7-11)	3,256	97.00	97.23	8.67	1.06	1.46	1.44	8.26	8.20	8.25	64
超長期 (11-)	2,984	85.51	85.76	15.52	1.02	2.27	2.10	13.93	13.78	13.87	69
BBB 格	162	96.22	96.49	3.63	1.00	2.05	2.00	3.50	3.46	3.50	152
短期 (1-3)	63	97.60	97.85	2.05	0.82	2.03	2.01	2.03	2.01	2.03	161
中期 (3-7)	88	97.46	97.72	4.32	1.12	1.75	1.72	4.21	4.18	4.21	121
長期 (7-)	11	78.45	78.85	7.13	1.07	5.22	4.66	6.81	6.65	6.81	401
長期 (7-11)	11	78.45	78.85	7.13	1.07	5.22	4.66	6.81	6.65	6.81	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	6,113	97.07	97.24	5.03	0.71	1.22	1.19	4.74	4.70	4.73	62
短期 (1-3)	2,002	99.25	99.38	1.89	0.58	0.97	0.97	1.88	1.87	1.88	59
中期 (3-7)	2,830	97.94	98.07	4.68	0.63	1.08	1.07	4.60	4.57	4.60	54
長期 (7-)	1,281	91.74	92.07	10.69	1.07	1.96	1.84	9.88	9.79	9.87	86
長期 (7-11)	769	96.29	96.67	8.35	1.22	1.78	1.70	7.93	7.86	7.92	94
超長期 (11-)	512	84.90	85.15	14.19	0.85	2.27	2.07	13.22	13.09	13.19	73

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10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	30,167	96.81	96.96	5.91	0.57	0.98	0.95	5.26	5.23	5.24	34
短期 (1-3)	10,304	99.40	99.49	1.93	0.36	0.68	0.68	1.93	1.92	1.93	29
中期 (3-7)	12,590	98.37	98.50	4.69	0.54	0.88	0.87	4.62	4.60	4.62	34
長期 (7-)	7,273	90.45	90.68	13.65	0.92	1.64	1.54	11.65	11.55	11.58	41
長期 (7-11)	3,864	97.74	97.98	8.57	0.90	1.20	1.19	8.23	8.18	8.23	40
超長期 (11-)	3,409	82.19	82.40	19.41	0.94	2.23	2.02	16.26	16.09	16.09	43
AAA~A 格	42,089	96.73	96.88	5.87	0.64	1.09	1.06	5.29	5.25	5.27	44
短期 (1-3)	13,854	99.35	99.45	1.95	0.41	0.75	0.75	1.94	1.93	1.94	36
中期 (3-7)	17,450	98.32	98.47	4.70	0.61	0.96	0.95	4.62	4.59	4.62	42
長期 (7-)	10,785	90.78	91.02	12.80	0.99	1.78	1.68	11.15	11.05	11.10	58
長期 (7-11)	5,815	96.96	97.20	8.60	0.99	1.40	1.37	8.23	8.17	8.22	58
超長期 (11-)	4,970	83.55	83.78	17.71	1.00	2.29	2.09	15.13	14.97	15.00	59
AAA~BBB 格	42,089	96.73	96.88	5.87	0.64	1.09	1.06	5.29	5.25	5.27	44
短期 (1-3)	13,854	99.35	99.45	1.95	0.41	0.75	0.75	1.94	1.93	1.94	36
中期 (3-7)	17,450	98.32	98.47	4.70	0.61	0.96	0.95	4.62	4.59	4.62	42
長期 (7-)	10,785	90.78	91.02	12.80	0.99	1.78	1.68	11.15	11.05	11.10	58
長期 (7-11)	5,815	96.96	97.20	8.60	0.99	1.40	1.37	8.23	8.17	8.22	58
超長期 (11-)	4,970	83.55	83.78	17.71	1.00	2.29	2.09	15.13	14.97	15.00	59
AAA~BB 格	42,089	96.73	96.88	5.87	0.64	1.09	1.06	5.29	5.25	5.27	44
短期 (1-3)	13,854	99.35	99.45	1.95	0.41	0.75	0.75	1.94	1.93	1.94	36
中期 (3-7)	17,450	98.32	98.47	4.70	0.61	0.96	0.95	4.62	4.59	4.62	42
長期 (7-)	10,785	90.78	91.02	12.80	0.99	1.78	1.68	11.15	11.05	11.10	58
長期 (7-11)	5,815	96.96	97.20	8.60	0.99	1.40	1.37	8.23	8.17	8.22	58
超長期 (11-)	4,970	83.55	83.78	17.71	1.00	2.29	2.09	15.13	14.97	15.00	59
AAA 格	11,095	97.22	97.33	5.54	0.44	0.81	0.79	4.76	4.73	4.74	21
短期 (1-3)	4,275	99.30	99.35	1.90	0.20	0.58	0.58	1.90	1.89	1.90	19
中期 (3-7)	4,922	98.69	98.80	4.60	0.47	0.75	0.74	4.54	4.52	4.54	21
長期 (7-)	1,898	88.72	88.94	16.16	0.93	1.58	1.46	12.59	12.48	12.44	27
長期 (7-11)	1,096	98.33	98.55	8.58	0.85	1.07	1.06	8.26	8.22	8.26	27
超長期 (11-)	802	75.59	75.82	26.53	1.04	2.50	2.16	20.28	20.05	19.87	27
AA 格	19,072	96.58	96.74	6.13	0.64	1.08	1.05	5.55	5.52	5.54	41
短期 (1-3)	6,030	99.48	99.60	1.96	0.48	0.75	0.75	1.95	1.94	1.95	36
中期 (3-7)	7,667	98.17	98.31	4.75	0.58	0.96	0.95	4.67	4.65	4.67	42
長期 (7-)	5,375	91.06	91.29	12.76	0.92	1.66	1.57	11.33	11.23	11.28	46
長期 (7-11)	2,768	97.51	97.76	8.57	0.92	1.26	1.24	8.22	8.17	8.22	45
超長期 (11-)	2,607	84.22	84.42	17.22	0.91	2.16	1.98	15.15	14.99	15.05	47
A 格	11,922	96.50	96.69	5.76	0.83	1.36	1.33	5.35	5.30	5.34	70
短期 (1-3)	3,549	99.19	99.31	1.99	0.55	0.97	0.96	1.97	1.96	1.97	57
中期 (3-7)	4,861	98.19	98.37	4.71	0.81	1.19	1.18	4.61	4.58	4.61	65
長期 (7-)	3,512	91.46	91.73	11.03	1.14	2.05	1.95	10.13	10.03	10.12	93
長期 (7-11)	1,951	95.40	95.66	8.65	1.16	1.80	1.75	8.21	8.14	8.21	95
超長期 (11-)	1,562	86.54	86.81	14.00	1.11	2.40	2.23	12.78	12.64	12.75	91
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	28,083	95.05	95.28	9.72	0.90	1.21	1.15	7.90	7.83	7.83	31
短期 (1-3)	7,013	99.77	99.91	2.02	0.58	0.71	0.71	2.01	2.00	2.01	32
中期 (3-7)	8,667	99.88	100.07	4.70	0.83	0.85	0.85	4.60	4.58	4.60	32
長期 (7-)	12,403	89.01	89.31	17.57	1.14	1.80	1.67	14.20	14.07	14.05	30
長期 (7-11)	4,023	100.43	100.73	8.78	1.17	1.12	1.12	8.33	8.28	8.33	31
超長期 (11-)	8,380	83.53	83.82	21.79	1.12	2.19	1.99	17.59	17.40	17.35	28

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10月末、11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	30,223	96.82	96.96	5.95	0.57	0.98	0.96	5.30	5.27	5.28	34
短期 (1-3)	10,276	99.39	99.48	1.99	0.36	0.68	0.68	1.98	1.97	1.98	29
中期 (3-7)	12,711	98.35	98.48	4.74	0.54	0.88	0.87	4.66	4.64	4.66	34
長期 (7-)	7,236	90.47	90.70	13.70	0.93	1.65	1.55	11.69	11.59	11.62	41
長期 (7-11)	3,827	97.84	98.09	8.62	0.92	1.21	1.20	8.27	8.22	8.27	40
超長期 (11-)	3,409	82.19	82.40	19.41	0.94	2.23	2.02	16.26	16.09	16.09	43
AAA~A 格	42,264	96.74	96.89	5.90	0.65	1.09	1.06	5.32	5.28	5.31	44
短期 (1-3)	13,845	99.33	99.43	2.00	0.41	0.75	0.75	1.99	1.98	1.99	36
中期 (3-7)	17,686	98.31	98.45	4.74	0.62	0.97	0.96	4.66	4.64	4.66	43
長期 (7-)	10,733	90.81	91.05	12.84	1.00	1.78	1.68	11.19	11.09	11.13	58
長期 (7-11)	5,763	97.06	97.31	8.65	1.01	1.40	1.38	8.26	8.21	8.26	58
超長期 (11-)	4,970	83.55	83.78	17.71	1.00	2.29	2.09	15.13	14.97	15.00	59
AAA~BBB 格	42,264	96.74	96.89	5.90	0.65	1.09	1.06	5.32	5.28	5.31	44
短期 (1-3)	13,845	99.33	99.43	2.00	0.41	0.75	0.75	1.99	1.98	1.99	36
中期 (3-7)	17,686	98.31	98.45	4.74	0.62	0.97	0.96	4.66	4.64	4.66	43
長期 (7-)	10,733	90.81	91.05	12.84	1.00	1.78	1.68	11.19	11.09	11.13	58
長期 (7-11)	5,763	97.06	97.31	8.65	1.01	1.40	1.38	8.26	8.21	8.26	58
超長期 (11-)	4,970	83.55	83.78	17.71	1.00	2.29	2.09	15.13	14.97	15.00	59
AAA~BB 格	42,264	96.74	96.89	5.90	0.65	1.09	1.06	5.32	5.28	5.31	44
短期 (1-3)	13,845	99.33	99.43	2.00	0.41	0.75	0.75	1.99	1.98	1.99	36
中期 (3-7)	17,686	98.31	98.45	4.74	0.62	0.97	0.96	4.66	4.64	4.66	43
長期 (7-)	10,733	90.81	91.05	12.84	1.00	1.78	1.68	11.19	11.09	11.13	58
長期 (7-11)	5,763	97.06	97.31	8.65	1.01	1.40	1.38	8.26	8.21	8.26	58
超長期 (11-)	4,970	83.55	83.78	17.71	1.00	2.29	2.09	15.13	14.97	15.00	59
AAA 格	11,130	97.22	97.33	5.56	0.45	0.81	0.79	4.78	4.75	4.76	21
短期 (1-3)	4,230	99.29	99.34	1.92	0.20	0.58	0.58	1.92	1.91	1.92	19
中期 (3-7)	5,032	98.68	98.80	4.62	0.47	0.75	0.74	4.56	4.54	4.56	21
長期 (7-)	1,868	88.62	88.84	16.31	0.94	1.60	1.47	12.69	12.57	12.53	27
長期 (7-11)	1,066	98.42	98.63	8.62	0.87	1.08	1.07	8.29	8.25	8.29	27
超長期 (11-)	802	75.59	75.82	26.53	1.04	2.50	2.16	20.28	20.05	19.87	27
AA 格	19,093	96.58	96.74	6.18	0.65	1.08	1.05	5.61	5.57	5.59	41
短期 (1-3)	6,047	99.46	99.58	2.03	0.48	0.75	0.75	2.02	2.01	2.02	36
中期 (3-7)	7,678	98.14	98.28	4.82	0.59	0.97	0.96	4.73	4.71	4.73	42
長期 (7-)	5,368	91.11	91.34	12.80	0.93	1.66	1.58	11.35	11.26	11.31	46
長期 (7-11)	2,761	97.62	97.88	8.62	0.94	1.26	1.25	8.27	8.21	8.26	45
超長期 (11-)	2,607	84.22	84.42	17.22	0.91	2.16	1.98	15.15	14.99	15.05	47
A 格	12,041	96.53	96.71	5.78	0.83	1.36	1.33	5.37	5.33	5.37	70
短期 (1-3)	3,569	99.16	99.27	2.04	0.53	0.96	0.96	2.03	2.02	2.03	57
中期 (3-7)	4,975	98.18	98.36	4.76	0.82	1.20	1.18	4.66	4.63	4.65	65
長期 (7-)	3,497	91.51	91.77	11.06	1.15	2.05	1.94	10.16	10.06	10.14	93
長期 (7-11)	1,936	95.51	95.77	8.70	1.17	1.79	1.74	8.25	8.18	8.24	94
超長期 (11-)	1,562	86.54	86.81	14.00	1.11	2.40	2.23	12.78	12.64	12.75	91
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	28,397	95.10	95.32	9.72	0.91	1.21	1.16	7.91	7.85	7.85	31
短期 (1-3)	6,977	99.76	99.90	2.06	0.59	0.72	0.72	2.04	2.04	2.04	32
中期 (3-7)	8,990	99.85	100.04	4.75	0.83	0.85	0.85	4.65	4.63	4.65	32
長期 (7-)	12,430	89.05	89.35	17.61	1.15	1.80	1.68	14.23	14.10	14.08	30
長期 (7-11)	4,039	100.43	100.73	8.86	1.19	1.13	1.13	8.40	8.35	8.39	32
超長期 (11-)	8,391	83.57	83.86	21.82	1.13	2.19	1.99	17.61	17.42	17.37	28

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10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	24,217	96.18	96.39	8.60	0.81	1.08	1.04	7.21	7.16	7.17	26
短期 (1-3)	6,862	99.65	99.76	1.99	0.44	0.62	0.62	1.98	1.98	1.98	23
中期 (3-7)	7,860	99.55	99.71	4.65	0.70	0.77	0.77	4.57	4.55	4.57	24
長期 (7-)	9,495	90.87	91.20	16.64	1.16	1.73	1.63	13.74	13.61	13.62	29
長期 (7-11)	3,379	100.13	100.43	8.82	1.11	1.11	1.11	8.38	8.34	8.38	30
超長期 (11-)	6,116	85.76	86.10	20.97	1.19	2.13	1.97	17.19	17.01	16.99	29
AAA~BBB 格	26,302	96.20	96.41	8.48	0.81	1.10	1.06	7.14	7.09	7.10	28
短期 (1-3)	7,202	99.63	99.73	2.00	0.43	0.62	0.62	1.99	1.98	1.99	23
中期 (3-7)	8,951	99.53	99.70	4.65	0.73	0.81	0.81	4.56	4.54	4.56	28
長期 (7-)	10,150	90.82	91.15	16.46	1.16	1.74	1.64	13.63	13.51	13.51	31
長期 (7-11)	3,686	99.94	100.24	8.80	1.10	1.13	1.13	8.38	8.33	8.37	31
超長期 (11-)	6,464	85.63	85.97	20.83	1.19	2.15	1.98	17.12	16.95	16.93	31
AAA~BB 格	26,302	96.20	96.41	8.48	0.81	1.10	1.06	7.14	7.09	7.10	28
短期 (1-3)	7,202	99.63	99.73	2.00	0.43	0.62	0.62	1.99	1.98	1.99	23
中期 (3-7)	8,951	99.53	99.70	4.65	0.73	0.81	0.81	4.56	4.54	4.56	28
長期 (7-)	10,150	90.82	91.15	16.46	1.16	1.74	1.64	13.63	13.51	13.51	31
長期 (7-11)	3,686	99.94	100.24	8.80	1.10	1.13	1.13	8.38	8.33	8.37	31
超長期 (11-)	6,464	85.63	85.97	20.83	1.19	2.15	1.98	17.12	16.95	16.93	31
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	24,217	96.18	96.39	8.60	0.81	1.08	1.04	7.21	7.16	7.17	26
短期 (1-3)	6,862	99.65	99.76	1.99	0.44	0.62	0.62	1.98	1.98	1.98	23
中期 (3-7)	7,860	99.55	99.71	4.65	0.70	0.77	0.77	4.57	4.55	4.57	24
長期 (7-)	9,495	90.87	91.20	16.64	1.16	1.73	1.63	13.74	13.61	13.62	29
長期 (7-11)	3,379	100.13	100.43	8.82	1.11	1.11	1.11	8.38	8.34	8.38	30
超長期 (11-)	6,116	85.76	86.10	20.97	1.19	2.13	1.97	17.19	17.01	16.99	29
BBB 格	2,086	96.46	96.68	7.09	0.88	1.25	1.22	6.31	6.26	6.30	51
短期 (1-3)	340	99.16	99.24	2.06	0.29	0.70	0.70	2.05	2.05	2.05	30
中期 (3-7)	1,091	99.42	99.66	4.62	0.97	1.10	1.10	4.51	4.49	4.51	57
長期 (7-)	655	90.11	90.38	13.82	1.05	1.84	1.73	12.05	11.94	11.99	54
長期 (7-11)	307	97.87	98.12	8.66	1.01	1.29	1.28	8.28	8.23	8.28	48
超長期 (11-)	348	83.25	83.55	18.37	1.09	2.40	2.20	15.96	15.78	15.84	60
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	43,870	95.97	96.14	6.76	0.71	1.16	1.12	5.83	5.78	5.80	46
短期 (1-3)	13,665	99.41	99.54	1.96	0.49	0.80	0.80	1.95	1.94	1.95	41
中期 (3-7)	17,167	98.48	98.63	4.73	0.66	0.99	0.98	4.64	4.62	4.64	45
長期 (7-)	13,038	89.06	89.29	14.49	1.00	1.83	1.70	12.08	11.97	11.99	53
長期 (7-11)	6,152	97.44	97.69	8.59	1.04	1.38	1.36	8.21	8.15	8.20	57
超長期 (11-)	6,886	81.58	81.78	19.75	0.97	2.30	2.07	16.22	16.05	16.03	49

出所:NFRC

- 格付は、Moody's 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10月末、11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	24,274	96.18	96.39	8.63	0.81	1.08	1.05	7.24	7.19	7.20	26
短期 (1-3)	6,846	99.64	99.74	2.04	0.44	0.62	0.62	2.03	2.02	2.03	23
中期 (3-7)	7,949	99.53	99.69	4.69	0.70	0.77	0.77	4.61	4.59	4.61	24
長期 (7-)	9,479	90.88	91.21	16.69	1.17	1.74	1.64	13.77	13.65	13.65	29
長期 (7-11)	3,344	100.20	100.51	8.85	1.13	1.12	1.12	8.41	8.36	8.41	30
超長期 (11-)	6,135	85.80	86.14	20.96	1.20	2.13	1.97	17.18	17.01	16.99	29
AAA~BBB 格	26,127	96.19	96.40	8.54	0.82	1.10	1.06	7.19	7.14	7.15	28
短期 (1-3)	7,116	99.62	99.72	2.04	0.43	0.63	0.63	2.03	2.03	2.03	23
中期 (3-7)	8,910	99.54	99.70	4.69	0.73	0.81	0.81	4.60	4.58	4.60	28
長期 (7-)	10,102	90.81	91.14	16.52	1.16	1.74	1.64	13.67	13.55	13.56	31
長期 (7-11)	3,629	99.99	100.30	8.84	1.12	1.13	1.13	8.40	8.35	8.40	31
超長期 (11-)	6,473	85.67	86.01	20.83	1.19	2.15	1.98	17.12	16.95	16.93	30
AAA~BB 格	26,127	96.19	96.40	8.54	0.82	1.10	1.06	7.19	7.14	7.15	28
短期 (1-3)	7,116	99.62	99.72	2.04	0.43	0.63	0.63	2.03	2.03	2.03	23
中期 (3-7)	8,910	99.54	99.70	4.69	0.73	0.81	0.81	4.60	4.58	4.60	28
長期 (7-)	10,102	90.81	91.14	16.52	1.16	1.74	1.64	13.67	13.55	13.56	31
長期 (7-11)	3,629	99.99	100.30	8.84	1.12	1.13	1.13	8.40	8.35	8.40	31
超長期 (11-)	6,473	85.67	86.01	20.83	1.19	2.15	1.98	17.12	16.95	16.93	30
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	24,274	96.18	96.39	8.63	0.81	1.08	1.05	7.24	7.19	7.20	26
短期 (1-3)	6,846	99.64	99.74	2.04	0.44	0.62	0.62	2.03	2.02	2.03	23
中期 (3-7)	7,949	99.53	99.69	4.69	0.70	0.77	0.77	4.61	4.59	4.61	24
長期 (7-)	9,479	90.88	91.21	16.69	1.17	1.74	1.64	13.77	13.65	13.65	29
長期 (7-11)	3,344	100.20	100.51	8.85	1.13	1.12	1.12	8.41	8.36	8.41	30
超長期 (11-)	6,135	85.80	86.14	20.96	1.20	2.13	1.97	17.18	17.01	16.99	29
BBB 格	1,854	96.23	96.48	7.41	0.94	1.30	1.26	6.56	6.51	6.54	54
短期 (1-3)	270	99.17	99.25	2.13	0.33	0.72	0.71	2.12	2.11	2.12	31
中期 (3-7)	961	99.56	99.83	4.63	1.03	1.13	1.13	4.52	4.49	4.52	60
長期 (7-)	623	89.82	90.11	13.99	1.05	1.86	1.75	12.17	12.06	12.11	55
長期 (7-11)	285	97.57	97.85	8.67	0.98	1.31	1.30	8.30	8.24	8.29	50
超長期 (11-)	338	83.28	83.58	18.48	1.11	2.41	2.21	16.01	15.83	15.89	60
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	44,534	96.02	96.18	6.79	0.71	1.16	1.12	5.86	5.81	5.83	46
短期 (1-3)	13,707	99.40	99.51	2.01	0.49	0.80	0.80	2.00	1.99	2.00	41
中期 (3-7)	17,766	98.47	98.62	4.78	0.67	0.99	0.98	4.69	4.66	4.69	45
長期 (7-)	13,061	89.13	89.35	14.54	1.01	1.83	1.71	12.13	12.01	12.03	53
長期 (7-11)	6,173	97.54	97.79	8.67	1.06	1.38	1.36	8.27	8.22	8.27	56
超長期 (11-)	6,888	81.58	81.79	19.79	0.97	2.30	2.08	16.25	16.08	16.06	49

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10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	851	85.16	85.46	17.54	0.98	1.78	1.59	13.42	13.29	13.27	31
短期 (1-3)	40	102.57	103.22	2.15	1.75	0.64	0.65	2.10	2.10	2.10	25
中期 (3-7)	115	96.62	96.70	5.41	0.22	0.86	0.84	5.36	5.34	5.36	28
長期 (7-)	696	82.27	82.59	20.43	1.06	2.04	1.80	15.80	15.63	15.60	32
長期 (7-11)	212	101.26	101.60	8.62	1.25	1.09	1.09	8.16	8.12	8.16	30
超長期 (11-)	484	73.95	74.26	25.60	0.98	2.61	2.23	20.37	20.13	20.07	33
AAA~A 格	16,321	94.78	94.96	8.95	0.75	1.10	1.05	7.31	7.25	7.26	27
短期 (1-3)	4,033	99.82	99.93	1.95	0.48	0.62	0.62	1.94	1.94	1.94	23
中期 (3-7)	5,592	99.25	99.41	4.89	0.66	0.81	0.81	4.80	4.78	4.80	27
長期 (7-)	6,696	88.03	88.25	16.55	0.99	1.71	1.58	13.33	13.21	13.19	29
長期 (7-11)	2,730	99.83	100.09	8.61	1.08	1.09	1.09	8.21	8.17	8.21	29
超長期 (11-)	3,966	79.90	80.10	22.01	0.93	2.25	2.00	17.73	17.54	17.48	29
AAA~BBB 格	16,536	94.83	95.00	8.89	0.75	1.10	1.05	7.27	7.21	7.22	27
短期 (1-3)	4,083	99.81	99.92	1.95	0.48	0.62	0.62	1.94	1.94	1.94	23
中期 (3-7)	5,727	99.23	99.39	4.87	0.66	0.81	0.81	4.78	4.76	4.78	27
長期 (7-)	6,726	88.06	88.28	16.52	0.99	1.71	1.58	13.31	13.19	13.18	30
長期 (7-11)	2,750	99.83	100.08	8.61	1.08	1.09	1.09	8.21	8.17	8.21	30
超長期 (11-)	3,976	79.92	80.12	21.99	0.93	2.25	2.00	17.72	17.53	17.47	30
AAA~BB 格	16,776	94.92	95.10	8.84	0.77	1.12	1.06	7.23	7.18	7.18	29
短期 (1-3)	4,083	99.81	99.92	1.95	0.48	0.62	0.62	1.94	1.94	1.94	23
中期 (3-7)	5,942	99.32	99.49	4.85	0.72	0.85	0.85	4.76	4.74	4.76	31
長期 (7-)	6,751	88.08	88.31	16.52	1.00	1.72	1.58	13.31	13.19	13.17	30
長期 (7-11)	2,750	99.83	100.08	8.61	1.08	1.09	1.09	8.21	8.17	8.21	30
超長期 (11-)	4,001	80.00	80.21	21.95	0.94	2.25	2.00	17.68	17.49	17.43	30
AAA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA 格	851	85.16	85.46	17.54	0.98	1.78	1.59	13.42	13.29	13.27	31
短期 (1-3)	40	102.57	103.22	2.15	1.75	0.64	0.65	2.10	2.10	2.10	25
中期 (3-7)	115	96.62	96.70	5.41	0.22	0.86	0.84	5.36	5.34	5.36	28
長期 (7-)	696	82.27	82.59	20.43	1.06	2.04	1.80	15.80	15.63	15.60	32
長期 (7-11)	212	101.26	101.60	8.62	1.25	1.09	1.09	8.16	8.12	8.16	30
超長期 (11-)	484	73.95	74.26	25.60	0.98	2.61	2.23	20.37	20.13	20.07	33
A 格	15,470	95.31	95.48	8.47	0.74	1.07	1.02	7.01	6.96	6.96	27
短期 (1-3)	3,993	99.79	99.90	1.95	0.47	0.62	0.62	1.94	1.94	1.94	23
中期 (3-7)	5,477	99.30	99.46	4.88	0.67	0.81	0.81	4.79	4.77	4.79	27
長期 (7-)	6,000	88.70	88.91	16.10	0.98	1.68	1.55	13.06	12.95	12.93	29
長期 (7-11)	2,518	99.71	99.96	8.61	1.06	1.09	1.09	8.22	8.17	8.22	29
超長期 (11-)	3,482	80.73	80.91	21.51	0.93	2.20	1.97	17.39	17.21	17.15	29
BBB 格	215	98.24	98.39	4.42	0.58	0.96	0.95	4.26	4.24	4.26	41
短期 (1-3)	50	99.18	99.27	1.87	0.28	0.73	0.72	1.86	1.85	1.86	34
中期 (3-7)	135	98.56	98.71	4.11	0.59	0.92	0.92	4.05	4.03	4.05	41
長期 (7-)	30	95.26	95.47	10.13	1.08	1.52	1.48	9.43	9.35	9.42	55
長期 (7-11)	20	99.35	99.48	8.38	1.15	1.24	1.23	8.00	7.95	8.00	47
超長期 (11-)	10	87.08	87.44	13.62	0.95	2.18	2.04	12.68	12.55	12.65	74
BB 格	240	100.83	101.45	5.57	2.26	1.93	1.93	5.04	4.99	5.03	132
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	215	101.69	102.26	4.41	2.25	1.82	1.83	4.20	4.16	4.20	131
長期 (7-)	25	93.47	94.48	15.57	2.37	2.98	2.89	12.87	12.69	12.79	147
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	25	93.47	94.48	15.57	2.37	2.98	2.89	12.87	12.69	12.79	147
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	53,396	96.41	96.60	6.96	0.74	1.14	1.11	6.04	5.99	6.01	42
短期 (1-3)	16,784	99.41	99.52	1.98	0.47	0.77	0.77	1.97	1.96	1.97	38
中期 (3-7)	20,175	98.70	98.85	4.65	0.68	0.95	0.94	4.57	4.55	4.57	41
長期 (7-)	16,437	90.55	90.84	14.87	1.10	1.82	1.71	12.55	12.44	12.46	48
長期 (7-11)	7,087	97.81	98.09	8.70	1.06	1.36	1.34	8.29	8.24	8.29	54
超長期 (11-)	9,349	85.05	85.35	19.56	1.13	2.21	2.04	16.27	16.10	16.09	43

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10月末、11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	85.16	85.46	17.54	0.98	1.78	1.59	13.42	13.29	13.27	31
短期 (1-3)	40	102.57	103.22	2.15	1.75	0.64	0.65	2.10	2.10	2.10	25
中期 (3-7)	115	96.62	96.70	5.41	0.22	0.86	0.84	5.36	5.34	5.36	28
長期 (7-)	696	82.27	82.59	20.43	1.06	2.04	1.80	15.80	15.63	15.60	32
長期 (7-11)	212	101.26	101.60	8.62	1.25	1.09	1.09	8.16	8.12	8.16	30
超長期 (11-)	484	73.95	74.26	25.60	0.98	2.61	2.23	20.37	20.13	20.07	33
AAA~A 格	16,361	94.79	94.97	8.97	0.76	1.11	1.05	7.34	7.28	7.28	27
短期 (1-3)	4,038	99.81	99.92	1.99	0.48	0.62	0.62	1.97	1.97	1.97	23
中期 (3-7)	5,629	99.25	99.41	4.92	0.67	0.81	0.81	4.83	4.81	4.83	27
長期 (7-)	6,694	88.03	88.25	16.60	1.00	1.72	1.58	13.37	13.25	13.23	30
長期 (7-11)	2,738	99.78	100.03	8.67	1.08	1.10	1.09	8.27	8.22	8.26	30
超長期 (11-)	3,956	79.89	80.09	22.08	0.94	2.26	2.00	17.78	17.60	17.53	30
AAA~BBB 格	16,576	94.84	95.01	8.91	0.75	1.10	1.05	7.30	7.24	7.24	27
短期 (1-3)	4,088	99.80	99.91	1.98	0.48	0.62	0.62	1.97	1.97	1.97	23
中期 (3-7)	5,764	99.23	99.39	4.90	0.67	0.81	0.81	4.81	4.79	4.81	27
長期 (7-)	6,724	88.06	88.28	16.57	1.00	1.72	1.58	13.35	13.23	13.22	30
長期 (7-11)	2,758	99.77	100.03	8.67	1.08	1.10	1.10	8.27	8.22	8.26	30
超長期 (11-)	3,966	79.91	80.11	22.06	0.94	2.26	2.00	17.77	17.58	17.52	30
AAA~BB 格	16,816	94.92	95.10	8.87	0.78	1.12	1.07	7.26	7.21	7.21	29
短期 (1-3)	4,088	99.80	99.91	1.98	0.48	0.62	0.62	1.97	1.97	1.97	23
中期 (3-7)	5,979	99.32	99.49	4.88	0.72	0.85	0.85	4.79	4.77	4.79	31
長期 (7-)	6,749	88.08	88.30	16.56	1.00	1.72	1.59	13.35	13.23	13.21	30
長期 (7-11)	2,758	99.77	100.03	8.67	1.08	1.10	1.10	8.27	8.22	8.26	30
超長期 (11-)	3,991	79.99	80.20	22.02	0.95	2.26	2.01	17.73	17.55	17.48	31
AAA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA 格	851	85.16	85.46	17.54	0.98	1.78	1.59	13.42	13.29	13.27	31
短期 (1-3)	40	102.57	103.22	2.15	1.75	0.64	0.65	2.10	2.10	2.10	25
中期 (3-7)	115	96.62	96.70	5.41	0.22	0.86	0.84	5.36	5.34	5.36	28
長期 (7-)	696	82.27	82.59	20.43	1.06	2.04	1.80	15.80	15.63	15.60	32
長期 (7-11)	212	101.26	101.60	8.62	1.25	1.09	1.09	8.16	8.12	8.16	30
超長期 (11-)	484	73.95	74.26	25.60	0.98	2.61	2.23	20.37	20.13	20.07	33
A 格	15,510	95.32	95.49	8.50	0.74	1.07	1.03	7.04	6.99	6.99	27
短期 (1-3)	3,998	99.78	99.89	1.98	0.47	0.62	0.62	1.97	1.97	1.97	23
中期 (3-7)	5,514	99.30	99.46	4.91	0.68	0.81	0.81	4.82	4.80	4.82	27
長期 (7-)	5,998	88.69	88.91	16.15	0.99	1.68	1.56	13.11	12.99	12.98	29
長期 (7-11)	2,526	99.65	99.90	8.68	1.06	1.10	1.09	8.28	8.23	8.27	30
超長期 (11-)	3,472	80.72	80.90	21.59	0.94	2.21	1.98	17.45	17.27	17.21	29
BBB 格	215	98.24	98.39	4.42	0.58	0.96	0.95	4.26	4.24	4.26	41
短期 (1-3)	50	99.18	99.27	1.87	0.28	0.73	0.72	1.86	1.85	1.86	34
中期 (3-7)	135	98.56	98.71	4.11	0.59	0.92	0.92	4.05	4.03	4.05	41
長期 (7-)	30	95.26	95.47	10.13	1.08	1.52	1.48	9.43	9.35	9.42	55
長期 (7-11)	20	99.35	99.48	8.38	1.15	1.24	1.23	8.00	7.95	8.00	47
超長期 (11-)	10	87.08	87.44	13.62	0.95	2.18	2.04	12.68	12.55	12.65	74
BB 格	240	100.83	101.45	5.57	2.26	1.93	1.93	5.04	4.99	5.03	132
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	215	101.69	102.26	4.41	2.25	1.82	1.83	4.20	4.16	4.20	131
長期 (7-)	25	93.47	94.48	15.57	2.37	2.98	2.89	12.87	12.69	12.79	147
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	25	93.47	94.48	15.57	2.37	2.98	2.89	12.87	12.69	12.79	147
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	53,845	96.44	96.62	6.99	0.75	1.14	1.11	6.07	6.03	6.05	42
短期 (1-3)	16,735	99.39	99.51	2.03	0.47	0.77	0.77	2.02	2.01	2.02	38
中期 (3-7)	20,697	98.68	98.84	4.71	0.68	0.95	0.95	4.62	4.60	4.62	41
長期 (7-)	16,414	90.60	90.89	14.92	1.11	1.82	1.72	12.59	12.48	12.50	48
長期 (7-11)	7,043	97.93	98.21	8.76	1.08	1.37	1.35	8.34	8.29	8.34	54
超長期 (11-)	9,370	85.08	85.38	19.56	1.13	2.21	2.04	16.27	16.10	16.10	43

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10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	1,334	99.37	99.56	3.22	0.85	1.06	1.06	3.15	3.13	3.15	60
短期(1-3)	715	99.50	99.67	2.11	0.73	0.98	0.97	2.09	2.08	2.09	57
中期(3-7)	560	99.26	99.46	4.04	0.95	1.12	1.12	3.96	3.94	3.96	61
長期(7-)	60	98.88	99.20	8.81	1.36	1.51	1.50	8.25	8.19	8.24	70
長期(7-11)	55	99.07	99.37	8.42	1.31	1.45	1.45	7.97	7.91	7.97	67
超長期(11-)	4	96.45	97.02	13.92	1.99	2.32	2.28	11.97	11.83	11.91	101
AAA~A格	3,125	99.19	99.48	3.61	1.07	1.31	1.31	3.45	3.43	3.45	82
短期(1-3)	1,689	99.51	99.79	2.15	0.96	1.18	1.17	2.13	2.12	2.13	77
中期(3-7)	1,159	98.78	99.03	4.01	1.01	1.32	1.31	3.92	3.90	3.92	81
長期(7-)	278	98.90	99.48	10.85	1.95	2.11	2.10	9.58	9.48	9.55	111
長期(7-11)	157	98.06	98.41	8.55	1.53	1.83	1.81	7.99	7.92	7.98	103
超長期(11-)	121	100.00	100.88	13.85	2.50	2.48	2.47	11.60	11.46	11.54	121
AAA~BBB格	3,125	99.19	99.48	3.61	1.07	1.31	1.31	3.45	3.43	3.45	82
短期(1-3)	1,689	99.51	99.79	2.15	0.96	1.18	1.17	2.13	2.12	2.13	77
中期(3-7)	1,159	98.78	99.03	4.01	1.01	1.32	1.31	3.92	3.90	3.92	81
長期(7-)	278	98.90	99.48	10.85	1.95	2.11	2.10	9.58	9.48	9.55	111
長期(7-11)	157	98.06	98.41	8.55	1.53	1.83	1.81	7.99	7.92	7.98	103
超長期(11-)	121	100.00	100.88	13.85	2.50	2.48	2.47	11.60	11.46	11.54	121
AAA~BB格	3,125	99.19	99.48	3.61	1.07	1.31	1.31	3.45	3.43	3.45	82
短期(1-3)	1,689	99.51	99.79	2.15	0.96	1.18	1.17	2.13	2.12	2.13	77
中期(3-7)	1,159	98.78	99.03	4.01	1.01	1.32	1.31	3.92	3.90	3.92	81
長期(7-)	278	98.90	99.48	10.85	1.95	2.11	2.10	9.58	9.48	9.55	111
長期(7-11)	157	98.06	98.41	8.55	1.53	1.83	1.81	7.99	7.92	7.98	103
超長期(11-)	121	100.00	100.88	13.85	2.50	2.48	2.47	11.60	11.46	11.54	121
AAA格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA格	1,334	99.37	99.56	3.22	0.85	1.06	1.06	3.15	3.13	3.15	60
短期(1-3)	715	99.50	99.67	2.11	0.73	0.98	0.97	2.09	2.08	2.09	57
中期(3-7)	560	99.26	99.46	4.04	0.95	1.12	1.12	3.96	3.94	3.96	61
長期(7-)	60	98.88	99.20	8.81	1.36	1.51	1.50	8.25	8.19	8.24	70
長期(7-11)	55	99.07	99.37	8.42	1.31	1.45	1.45	7.97	7.91	7.97	67
超長期(11-)	4	96.45	97.02	13.92	1.99	2.32	2.28	11.97	11.83	11.91	101
A格	1,791	99.05	99.42	3.91	1.23	1.50	1.50	3.68	3.65	3.67	98
短期(1-3)	974	99.53	99.88	2.18	1.13	1.32	1.32	2.15	2.14	2.15	92
中期(3-7)	599	98.33	98.62	3.98	1.07	1.51	1.50	3.89	3.86	3.89	100
長期(7-)	218	98.91	99.56	11.41	2.11	2.28	2.27	9.94	9.83	9.91	122
長期(7-11)	102	97.51	97.89	8.62	1.66	2.04	2.02	8.00	7.92	7.99	123
超長期(11-)	116	100.13	101.02	13.85	2.52	2.48	2.48	11.59	11.45	11.53	122
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10月末、11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	1,546	99.42	99.60	3.24	0.85	1.04	1.03	3.18	3.16	3.18	57
短期 (1-3)	870	99.55	99.71	2.24	0.74	0.95	0.95	2.23	2.21	2.23	54
中期 (3-7)	616	99.30	99.48	4.12	0.95	1.11	1.11	4.03	4.01	4.03	60
長期 (7-)	60	98.88	99.20	8.81	1.36	1.51	1.50	8.25	8.19	8.24	70
長期 (7-11)	55	99.07	99.37	8.42	1.31	1.45	1.45	7.97	7.91	7.97	67
超長期 (11-)	4	96.45	97.02	13.92	1.99	2.32	2.28	11.97	11.83	11.91	101
AAA~A 格	3,377	99.23	99.51	3.59	1.06	1.29	1.29	3.44	3.42	3.44	80
短期 (1-3)	1,893	99.56	99.83	2.23	0.97	1.16	1.16	2.20	2.19	2.20	75
中期 (3-7)	1,205	98.78	99.02	4.06	1.00	1.31	1.30	3.97	3.94	3.97	79
長期 (7-)	279	98.90	99.48	10.85	1.95	2.12	2.10	9.58	9.47	9.55	111
長期 (7-11)	162	98.14	98.51	8.61	1.56	1.84	1.83	8.03	7.96	8.02	104
超長期 (11-)	118	99.95	100.82	13.93	2.50	2.48	2.48	11.66	11.51	11.59	121
AAA~BBB 格	3,377	99.23	99.51	3.59	1.06	1.29	1.29	3.44	3.42	3.44	80
短期 (1-3)	1,893	99.56	99.83	2.23	0.97	1.16	1.16	2.20	2.19	2.20	75
中期 (3-7)	1,205	98.78	99.02	4.06	1.00	1.31	1.30	3.97	3.94	3.97	79
長期 (7-)	279	98.90	99.48	10.85	1.95	2.12	2.10	9.58	9.47	9.55	111
長期 (7-11)	162	98.14	98.51	8.61	1.56	1.84	1.83	8.03	7.96	8.02	104
超長期 (11-)	118	99.95	100.82	13.93	2.50	2.48	2.48	11.66	11.51	11.59	121
AAA~BB 格	3,377	99.23	99.51	3.59	1.06	1.29	1.29	3.44	3.42	3.44	80
短期 (1-3)	1,893	99.56	99.83	2.23	0.97	1.16	1.16	2.20	2.19	2.20	75
中期 (3-7)	1,205	98.78	99.02	4.06	1.00	1.31	1.30	3.97	3.94	3.97	79
長期 (7-)	279	98.90	99.48	10.85	1.95	2.12	2.10	9.58	9.47	9.55	111
長期 (7-11)	162	98.14	98.51	8.61	1.56	1.84	1.83	8.03	7.96	8.02	104
超長期 (11-)	118	99.95	100.82	13.93	2.50	2.48	2.48	11.66	11.51	11.59	121
AAA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA 格	1,546	99.42	99.60	3.24	0.85	1.04	1.03	3.18	3.16	3.18	57
短期 (1-3)	870	99.55	99.71	2.24	0.74	0.95	0.95	2.23	2.21	2.23	54
中期 (3-7)	616	99.30	99.48	4.12	0.95	1.11	1.11	4.03	4.01	4.03	60
長期 (7-)	60	98.88	99.20	8.81	1.36	1.51	1.50	8.25	8.19	8.24	70
長期 (7-11)	55	99.07	99.37	8.42	1.31	1.45	1.45	7.97	7.91	7.97	67
超長期 (11-)	4	96.45	97.02	13.92	1.99	2.32	2.28	11.97	11.83	11.91	101
A 格	1,831	99.07	99.43	3.89	1.24	1.51	1.50	3.66	3.63	3.66	99
短期 (1-3)	1,022	99.57	99.92	2.22	1.16	1.34	1.34	2.19	2.17	2.19	93
中期 (3-7)	589	98.25	98.52	4.00	1.05	1.52	1.50	3.90	3.88	3.90	100
長期 (7-)	220	98.91	99.56	11.40	2.12	2.28	2.27	9.94	9.82	9.90	122
長期 (7-11)	106	97.66	98.06	8.70	1.69	2.05	2.03	8.06	7.98	8.05	123
超長期 (11-)	113	100.08	100.96	13.93	2.52	2.49	2.48	11.64	11.50	11.58	122
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 最低格付別・ポートフォリオ指標 (2024年10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	310	99.27	99.48	3.00	0.76	1.01	1.01	2.95	2.94	2.95	56
短期 (1-3)	199	99.56	99.77	2.12	0.76	0.97	0.97	2.10	2.09	2.10	57
中期 (3-7)	98	98.88	99.07	4.08	0.74	1.05	1.04	4.02	4.00	4.02	53
長期 (7-)	14	97.96	98.11	8.03	0.94	1.27	1.25	7.75	7.70	7.75	51
長期 (7-11)	14	97.96	98.11	8.03	0.94	1.27	1.25	7.75	7.70	7.75	51
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AAA~A 格	2,009	99.59	99.88	3.37	0.98	1.14	1.14	3.25	3.23	3.25	67
短期 (1-3)	1,160	99.61	99.89	2.08	0.88	1.06	1.06	2.06	2.05	2.06	66
中期 (3-7)	709	99.22	99.46	4.00	0.97	1.15	1.14	3.92	3.90	3.92	64
長期 (7-)	141	101.24	101.98	10.76	1.87	1.81	1.82	9.56	9.47	9.54	83
長期 (7-11)	79	98.17	98.49	8.39	1.19	1.47	1.45	7.98	7.92	7.97	68
超長期 (11-)	62	105.18	106.44	13.79	2.73	2.21	2.26	11.45	11.32	11.39	101
AAA~BBB 格	3,125	99.19	99.48	3.61	1.07	1.31	1.31	3.45	3.43	3.45	82
短期 (1-3)	1,689	99.51	99.79	2.15	0.96	1.18	1.17	2.13	2.12	2.13	77
中期 (3-7)	1,159	98.78	99.03	4.01	1.01	1.32	1.31	3.92	3.90	3.92	81
長期 (7-)	278	98.90	99.48	10.85	1.95	2.11	2.10	9.58	9.48	9.55	111
長期 (7-11)	157	98.06	98.41	8.55	1.53	1.83	1.81	7.99	7.92	7.98	103
超長期 (11-)	121	100.00	100.88	13.85	2.50	2.48	2.47	11.60	11.46	11.54	121
AAA~BB 格	3,125	99.19	99.48	3.61	1.07	1.31	1.31	3.45	3.43	3.45	82
短期 (1-3)	1,689	99.51	99.79	2.15	0.96	1.18	1.17	2.13	2.12	2.13	77
中期 (3-7)	1,159	98.78	99.03	4.01	1.01	1.32	1.31	3.92	3.90	3.92	81
長期 (7-)	278	98.90	99.48	10.85	1.95	2.11	2.10	9.58	9.48	9.55	111
長期 (7-11)	157	98.06	98.41	8.55	1.53	1.83	1.81	7.99	7.92	7.98	103
超長期 (11-)	121	100.00	100.88	13.85	2.50	2.48	2.47	11.60	11.46	11.54	121
AAA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA 格	310	99.27	99.48	3.00	0.76	1.01	1.01	2.95	2.94	2.95	56
短期 (1-3)	199	99.56	99.77	2.12	0.76	0.97	0.97	2.10	2.09	2.10	57
中期 (3-7)	98	98.88	99.07	4.08	0.74	1.05	1.04	4.02	4.00	4.02	53
長期 (7-)	14	97.96	98.11	8.03	0.94	1.27	1.25	7.75	7.70	7.75	51
長期 (7-11)	14	97.96	98.11	8.03	0.94	1.27	1.25	7.75	7.70	7.75	51
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
A 格	1,700	99.65	99.96	3.43	1.02	1.17	1.17	3.31	3.28	3.30	69
短期 (1-3)	961	99.62	99.91	2.07	0.90	1.08	1.08	2.05	2.04	2.05	68
中期 (3-7)	611	99.28	99.53	3.99	1.00	1.16	1.16	3.91	3.88	3.90	66
長期 (7-)	127	101.60	102.39	11.05	1.97	1.86	1.88	9.75	9.66	9.72	86
長期 (7-11)	65	98.21	98.57	8.47	1.24	1.51	1.49	8.02	7.96	8.02	72
超長期 (11-)	62	105.18	106.44	13.79	2.73	2.21	2.26	11.45	11.32	11.39	101
BBB 格	1,116	98.46	98.75	4.06	1.23	1.62	1.61	3.82	3.78	3.81	109
短期 (1-3)	529	99.29	99.58	2.31	1.14	1.43	1.43	2.27	2.26	2.27	102
中期 (3-7)	450	98.09	98.34	4.02	1.08	1.60	1.59	3.92	3.89	3.92	109
長期 (7-)	137	96.50	96.92	10.95	2.04	2.45	2.40	9.60	9.48	9.57	141
長期 (7-11)	78	97.95	98.32	8.71	1.88	2.20	2.18	8.00	7.92	8.00	138
超長期 (11-)	59	94.58	95.05	13.92	2.25	2.78	2.71	11.78	11.63	11.72	144
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10月末、11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	472	99.43	99.60	3.18	0.79	0.98	0.97	3.13	3.11	3.13	52
短期 (1-3)	309	99.64	99.81	2.39	0.77	0.94	0.93	2.37	2.36	2.37	52
中期 (3-7)	149	99.13	99.30	4.36	0.81	1.04	1.03	4.28	4.26	4.28	51
長期 (7-)	14	97.96	98.11	8.03	0.94	1.27	1.25	7.75	7.70	7.75	51
長期 (7-11)	14	97.96	98.11	8.03	0.94	1.27	1.25	7.75	7.70	7.75	51
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AAA~A 格	2,221	99.61	99.88	3.37	0.96	1.12	1.12	3.26	3.24	3.26	64
短期 (1-3)	1,325	99.66	99.92	2.18	0.88	1.04	1.04	2.16	2.15	2.16	63
中期 (3-7)	756	99.20	99.42	4.08	0.94	1.13	1.13	4.00	3.98	4.00	62
長期 (7-)	141	101.24	101.98	10.76	1.87	1.81	1.82	9.56	9.47	9.54	83
長期 (7-11)	82	98.31	98.67	8.49	1.23	1.49	1.48	8.04	7.98	8.04	70
超長期 (11-)	59	105.34	106.60	13.93	2.75	2.22	2.27	11.54	11.41	11.48	100
AAA~BBB 格	3,377	99.23	99.51	3.59	1.06	1.29	1.29	3.44	3.42	3.44	80
短期 (1-3)	1,893	99.56	99.83	2.23	0.97	1.16	1.16	2.20	2.19	2.20	75
中期 (3-7)	1,205	98.78	99.02	4.06	1.00	1.31	1.30	3.97	3.94	3.97	79
長期 (7-)	279	98.90	99.48	10.85	1.95	2.12	2.10	9.58	9.47	9.55	111
長期 (7-11)	162	98.14	98.51	8.61	1.56	1.84	1.83	8.03	7.96	8.02	104
超長期 (11-)	118	99.95	100.82	13.93	2.50	2.48	2.48	11.66	11.51	11.59	121
AAA~BB 格	3,377	99.23	99.51	3.59	1.06	1.29	1.29	3.44	3.42	3.44	80
短期 (1-3)	1,893	99.56	99.83	2.23	0.97	1.16	1.16	2.20	2.19	2.20	75
中期 (3-7)	1,205	98.78	99.02	4.06	1.00	1.31	1.30	3.97	3.94	3.97	79
長期 (7-)	279	98.90	99.48	10.85	1.95	2.12	2.10	9.58	9.47	9.55	111
長期 (7-11)	162	98.14	98.51	8.61	1.56	1.84	1.83	8.03	7.96	8.02	104
超長期 (11-)	118	99.95	100.82	13.93	2.50	2.48	2.48	11.66	11.51	11.59	121
AAA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA 格	472	99.43	99.60	3.18	0.79	0.98	0.97	3.13	3.11	3.13	52
短期 (1-3)	309	99.64	99.81	2.39	0.77	0.94	0.93	2.37	2.36	2.37	52
中期 (3-7)	149	99.13	99.30	4.36	0.81	1.04	1.03	4.28	4.26	4.28	51
長期 (7-)	14	97.96	98.11	8.03	0.94	1.27	1.25	7.75	7.70	7.75	51
長期 (7-11)	14	97.96	98.11	8.03	0.94	1.27	1.25	7.75	7.70	7.75	51
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
A 格	1,750	99.65	99.96	3.42	1.01	1.16	1.16	3.30	3.28	3.29	68
短期 (1-3)	1,016	99.67	99.96	2.12	0.91	1.07	1.07	2.09	2.08	2.09	67
中期 (3-7)	606	99.21	99.45	4.01	0.98	1.16	1.15	3.93	3.91	3.93	65
長期 (7-)	127	101.60	102.39	11.05	1.97	1.86	1.88	9.75	9.66	9.72	86
長期 (7-11)	68	98.38	98.78	8.58	1.29	1.54	1.53	8.10	8.04	8.09	74
超長期 (11-)	59	105.34	106.60	13.93	2.75	2.22	2.27	11.54	11.41	11.48	100
BBB 格	1,155	98.51	98.79	4.02	1.24	1.63	1.61	3.79	3.76	3.79	110
短期 (1-3)	568	99.32	99.60	2.34	1.17	1.45	1.45	2.31	2.29	2.31	103
中期 (3-7)	450	98.09	98.34	4.02	1.08	1.60	1.59	3.92	3.89	3.92	109
長期 (7-)	138	96.52	96.94	10.94	2.05	2.45	2.41	9.59	9.47	9.56	141
長期 (7-11)	79	97.97	98.34	8.73	1.89	2.20	2.19	8.02	7.93	8.01	139
超長期 (11-)	59	94.58	95.05	13.92	2.25	2.78	2.71	11.78	11.63	11.72	144
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10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	100.16	100.59	1.67	1.37	1.28	1.28	1.65	1.64	1.65	91
短期 (1-3)	30	100.16	100.59	1.67	1.37	1.28	1.28	1.65	1.64	1.65	91
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AAA~A 格	740	98.95	99.28	3.00	0.98	1.29	1.29	2.93	2.92	2.93	84
短期 (1-3)	394	99.45	99.79	1.98	0.95	1.19	1.19	1.96	1.95	1.96	80
中期 (3-7)	317	98.64	98.96	3.82	1.02	1.40	1.39	3.74	3.71	3.74	90
長期 (7-)	29	95.59	95.92	8.01	0.96	1.60	1.57	7.69	7.63	7.69	83
長期 (7-11)	29	95.59	95.92	8.01	0.96	1.60	1.57	7.69	7.63	7.69	83
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AAA~BBB 格	740	98.95	99.28	3.00	0.98	1.29	1.29	2.93	2.92	2.93	84
短期 (1-3)	394	99.45	99.79	1.98	0.95	1.19	1.19	1.96	1.95	1.96	80
中期 (3-7)	317	98.64	98.96	3.82	1.02	1.40	1.39	3.74	3.71	3.74	90
長期 (7-)	29	95.59	95.92	8.01	0.96	1.60	1.57	7.69	7.63	7.69	83
長期 (7-11)	29	95.59	95.92	8.01	0.96	1.60	1.57	7.69	7.63	7.69	83
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AAA~BB 格	740	98.95	99.28	3.00	0.98	1.29	1.29	2.93	2.92	2.93	84
短期 (1-3)	394	99.45	99.79	1.98	0.95	1.19	1.19	1.96	1.95	1.96	80
中期 (3-7)	317	98.64	98.96	3.82	1.02	1.40	1.39	3.74	3.71	3.74	90
長期 (7-)	29	95.59	95.92	8.01	0.96	1.60	1.57	7.69	7.63	7.69	83
長期 (7-11)	29	95.59	95.92	8.01	0.96	1.60	1.57	7.69	7.63	7.69	83
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	100.16	100.59	1.67	1.37	1.28	1.28	1.65	1.64	1.65	91
短期 (1-3)	30	100.16	100.59	1.67	1.37	1.28	1.28	1.65	1.64	1.65	91
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
A 格	710	98.90	99.23	3.06	0.97	1.29	1.29	2.99	2.97	2.99	84
短期 (1-3)	364	99.39	99.73	2.01	0.92	1.18	1.18	1.98	1.97	1.98	79
中期 (3-7)	317	98.64	98.96	3.82	1.02	1.40	1.39	3.74	3.71	3.74	90
長期 (7-)	29	95.59	95.92	8.01	0.96	1.60	1.57	7.69	7.63	7.69	83
長期 (7-11)	29	95.59	95.92	8.01	0.96	1.60	1.57	7.69	7.63	7.69	83
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	2,385	99.26	99.54	3.80	1.09	1.32	1.31	3.61	3.58	3.61	81
短期 (1-3)	1,295	99.53	99.79	2.20	0.96	1.17	1.17	2.18	2.17	2.18	77
中期 (3-7)	842	98.83	99.05	4.08	1.01	1.29	1.29	3.99	3.96	3.99	78
長期 (7-)	249	99.29	99.90	11.18	2.07	2.17	2.16	9.79	9.68	9.76	114
長期 (7-11)	128	98.62	98.97	8.67	1.67	1.88	1.87	8.06	7.98	8.05	107
超長期 (11-)	121	100.00	100.88	13.85	2.50	2.48	2.47	11.60	11.46	11.54	121

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10月末、11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	100.16	100.59	1.67	1.37	1.28	1.28	1.65	1.64	1.65	91
短期 (1-3)	30	100.16	100.59	1.67	1.37	1.28	1.28	1.65	1.64	1.65	91
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AAA~A 格	740	98.95	99.28	3.00	0.98	1.29	1.29	2.93	2.92	2.93	84
短期 (1-3)	394	99.45	99.79	1.98	0.95	1.19	1.19	1.96	1.95	1.96	80
中期 (3-7)	317	98.64	98.96	3.82	1.02	1.40	1.39	3.74	3.71	3.74	90
長期 (7-)	29	95.59	95.92	8.01	0.96	1.60	1.57	7.69	7.63	7.69	83
長期 (7-11)	29	95.59	95.92	8.01	0.96	1.60	1.57	7.69	7.63	7.69	83
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AAA~BBB 格	740	98.95	99.28	3.00	0.98	1.29	1.29	2.93	2.92	2.93	84
短期 (1-3)	394	99.45	99.79	1.98	0.95	1.19	1.19	1.96	1.95	1.96	80
中期 (3-7)	317	98.64	98.96	3.82	1.02	1.40	1.39	3.74	3.71	3.74	90
長期 (7-)	29	95.59	95.92	8.01	0.96	1.60	1.57	7.69	7.63	7.69	83
長期 (7-11)	29	95.59	95.92	8.01	0.96	1.60	1.57	7.69	7.63	7.69	83
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AAA~BB 格	740	98.95	99.28	3.00	0.98	1.29	1.29	2.93	2.92	2.93	84
短期 (1-3)	394	99.45	99.79	1.98	0.95	1.19	1.19	1.96	1.95	1.96	80
中期 (3-7)	317	98.64	98.96	3.82	1.02	1.40	1.39	3.74	3.71	3.74	90
長期 (7-)	29	95.59	95.92	8.01	0.96	1.60	1.57	7.69	7.63	7.69	83
長期 (7-11)	29	95.59	95.92	8.01	0.96	1.60	1.57	7.69	7.63	7.69	83
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	100.16	100.59	1.67	1.37	1.28	1.28	1.65	1.64	1.65	91
短期 (1-3)	30	100.16	100.59	1.67	1.37	1.28	1.28	1.65	1.64	1.65	91
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
A 格	710	98.90	99.23	3.06	0.97	1.29	1.29	2.99	2.97	2.99	84
短期 (1-3)	364	99.39	99.73	2.01	0.92	1.18	1.18	1.98	1.97	1.98	79
中期 (3-7)	317	98.64	98.96	3.82	1.02	1.40	1.39	3.74	3.71	3.74	90
長期 (7-)	29	95.59	95.92	8.01	0.96	1.60	1.57	7.69	7.63	7.69	83
長期 (7-11)	29	95.59	95.92	8.01	0.96	1.60	1.57	7.69	7.63	7.69	83
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	2,637	99.31	99.57	3.76	1.08	1.29	1.29	3.58	3.56	3.58	79
短期 (1-3)	1,499	99.59	99.84	2.30	0.97	1.15	1.15	2.27	2.26	2.27	74
中期 (3-7)	888	98.83	99.04	4.14	0.99	1.28	1.27	4.05	4.03	4.05	76
長期 (7-)	250	99.29	99.90	11.18	2.07	2.17	2.16	9.79	9.68	9.75	114
長期 (7-11)	132	98.70	99.08	8.74	1.69	1.89	1.88	8.10	8.02	8.09	108
超長期 (11-)	118	99.95	100.82	13.93	2.50	2.48	2.48	11.66	11.51	11.59	121

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10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	243	99.32	99.61	3.24	1.04	1.24	1.23	3.13	3.11	3.13	77
短期 (1-3)	155	99.71	99.96	2.12	0.97	1.13	1.13	2.10	2.09	2.10	73
中期 (3-7)	66	99.24	99.60	4.01	1.09	1.30	1.29	3.91	3.89	3.91	79
長期 (7-)	22	96.83	97.21	8.80	1.36	1.80	1.78	8.14	8.06	8.12	97
長期 (7-11)	18	96.91	97.26	7.60	1.21	1.68	1.66	7.24	7.19	7.24	97
超長期 (11-)	4	96.45	97.02	13.92	1.99	2.32	2.28	11.97	11.83	11.91	101
AAA~A 格	1,085	99.22	99.61	4.48	1.39	1.60	1.59	4.15	4.11	4.14	104
短期 (1-3)	603	99.68	100.04	2.25	1.23	1.37	1.37	2.22	2.20	2.22	96
中期 (3-7)	284	98.35	98.64	4.21	1.19	1.60	1.59	4.10	4.07	4.10	108
長期 (7-)	198	99.02	99.70	11.65	2.17	2.31	2.30	10.09	9.97	10.05	123
長期 (7-11)	81	97.68	98.07	8.34	1.68	2.04	2.02	7.75	7.67	7.75	126
超長期 (11-)	118	99.95	100.82	13.93	2.50	2.48	2.48	11.66	11.51	11.59	121
AAA~BBB 格	1,085	99.22	99.61	4.48	1.39	1.60	1.59	4.15	4.11	4.14	104
短期 (1-3)	603	99.68	100.04	2.25	1.23	1.37	1.37	2.22	2.20	2.22	96
中期 (3-7)	284	98.35	98.64	4.21	1.19	1.60	1.59	4.10	4.07	4.10	108
長期 (7-)	198	99.02	99.70	11.65	2.17	2.31	2.30	10.09	9.97	10.05	123
長期 (7-11)	81	97.68	98.07	8.34	1.68	2.04	2.02	7.75	7.67	7.75	126
超長期 (11-)	118	99.95	100.82	13.93	2.50	2.48	2.48	11.66	11.51	11.59	121
AAA~BB 格	1,085	99.22	99.61	4.48	1.39	1.60	1.59	4.15	4.11	4.14	104
短期 (1-3)	603	99.68	100.04	2.25	1.23	1.37	1.37	2.22	2.20	2.22	96
中期 (3-7)	284	98.35	98.64	4.21	1.19	1.60	1.59	4.10	4.07	4.10	108
長期 (7-)	198	99.02	99.70	11.65	2.17	2.31	2.30	10.09	9.97	10.05	123
長期 (7-11)	81	97.68	98.07	8.34	1.68	2.04	2.02	7.75	7.67	7.75	126
超長期 (11-)	118	99.95	100.82	13.93	2.50	2.48	2.48	11.66	11.51	11.59	121
AAA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA 格	243	99.32	99.61	3.24	1.04	1.24	1.23	3.13	3.11	3.13	77
短期 (1-3)	155	99.71	99.96	2.12	0.97	1.13	1.13	2.10	2.09	2.10	73
中期 (3-7)	66	99.24	99.60	4.01	1.09	1.30	1.29	3.91	3.89	3.91	79
長期 (7-)	22	96.83	97.21	8.80	1.36	1.80	1.78	8.14	8.06	8.12	97
長期 (7-11)	18	96.91	97.26	7.60	1.21	1.68	1.66	7.24	7.19	7.24	97
超長期 (11-)	4	96.45	97.02	13.92	1.99	2.32	2.28	11.97	11.83	11.91	101
A 格	842	99.19	99.62	4.84	1.49	1.71	1.70	4.44	4.40	4.43	112
短期 (1-3)	448	99.68	100.07	2.30	1.32	1.45	1.45	2.26	2.24	2.26	104
中期 (3-7)	218	98.09	98.35	4.27	1.21	1.69	1.68	4.15	4.12	4.15	116
長期 (7-)	176	99.30	100.01	12.01	2.27	2.37	2.36	10.33	10.21	10.29	126
長期 (7-11)	63	97.90	98.31	8.55	1.82	2.15	2.13	7.90	7.81	7.89	135
超長期 (11-)	113	100.08	100.96	13.93	2.52	2.49	2.48	11.64	11.50	11.58	122
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	2,040	99.17	99.41	3.15	0.89	1.16	1.16	3.08	3.06	3.08	70
短期 (1-3)	1,086	99.42	99.65	2.10	0.81	1.07	1.07	2.08	2.07	2.08	67
中期 (3-7)	875	98.92	99.15	3.94	0.95	1.23	1.23	3.86	3.84	3.86	73
長期 (7-)	79	98.60	98.94	8.86	1.41	1.63	1.62	8.29	8.23	8.29	80
長期 (7-11)	76	98.46	98.76	8.78	1.37	1.61	1.59	8.24	8.17	8.23	79
超長期 (11-)	3	102.13	103.34	11.00	2.41	2.17	2.19	9.63	9.53	9.61	117

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10月末、11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	293	99.40	99.67	3.21	0.99	1.17	1.16	3.11	3.09	3.11	70
短期 (1-3)	200	99.74	99.96	2.28	0.92	1.06	1.06	2.26	2.25	2.26	65
中期 (3-7)	71	99.27	99.61	4.06	1.08	1.27	1.27	3.97	3.95	3.97	76
長期 (7-)	22	96.83	97.21	8.80	1.36	1.80	1.78	8.14	8.06	8.12	97
長期 (7-11)	18	96.91	97.26	7.60	1.21	1.68	1.66	7.24	7.19	7.24	97
超長期 (11-)	4	96.45	97.02	13.92	1.99	2.32	2.28	11.97	11.83	11.91	101
AAA~A 格	1,175	99.26	99.64	4.38	1.37	1.57	1.57	4.06	4.02	4.05	102
短期 (1-3)	696	99.75	100.10	2.34	1.24	1.35	1.35	2.30	2.28	2.30	94
中期 (3-7)	279	98.20	98.45	4.26	1.13	1.60	1.58	4.16	4.12	4.15	107
長期 (7-)	200	99.02	99.70	11.64	2.17	2.31	2.30	10.08	9.97	10.04	123
長期 (7-11)	82	97.70	98.09	8.36	1.70	2.05	2.03	7.77	7.69	7.76	127
超長期 (11-)	118	99.95	100.82	13.93	2.50	2.48	2.48	11.66	11.51	11.59	121
AAA~BBB 格	1,175	99.26	99.64	4.38	1.37	1.57	1.57	4.06	4.02	4.05	102
短期 (1-3)	696	99.75	100.10	2.34	1.24	1.35	1.35	2.30	2.28	2.30	94
中期 (3-7)	279	98.20	98.45	4.26	1.13	1.60	1.58	4.16	4.12	4.15	107
長期 (7-)	200	99.02	99.70	11.64	2.17	2.31	2.30	10.08	9.97	10.04	123
長期 (7-11)	82	97.70	98.09	8.36	1.70	2.05	2.03	7.77	7.69	7.76	127
超長期 (11-)	118	99.95	100.82	13.93	2.50	2.48	2.48	11.66	11.51	11.59	121
AAA~BB 格	1,175	99.26	99.64	4.38	1.37	1.57	1.57	4.06	4.02	4.05	102
短期 (1-3)	696	99.75	100.10	2.34	1.24	1.35	1.35	2.30	2.28	2.30	94
中期 (3-7)	279	98.20	98.45	4.26	1.13	1.60	1.58	4.16	4.12	4.15	107
長期 (7-)	200	99.02	99.70	11.64	2.17	2.31	2.30	10.08	9.97	10.04	123
長期 (7-11)	82	97.70	98.09	8.36	1.70	2.05	2.03	7.77	7.69	7.76	127
超長期 (11-)	118	99.95	100.82	13.93	2.50	2.48	2.48	11.66	11.51	11.59	121
AAA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA 格	293	99.40	99.67	3.21	0.99	1.17	1.16	3.11	3.09	3.11	70
短期 (1-3)	200	99.74	99.96	2.28	0.92	1.06	1.06	2.26	2.25	2.26	65
中期 (3-7)	71	99.27	99.61	4.06	1.08	1.27	1.27	3.97	3.95	3.97	76
長期 (7-)	22	96.83	97.21	8.80	1.36	1.80	1.78	8.14	8.06	8.12	97
長期 (7-11)	18	96.91	97.26	7.60	1.21	1.68	1.66	7.24	7.19	7.24	97
超長期 (11-)	4	96.45	97.02	13.92	1.99	2.32	2.28	11.97	11.83	11.91	101
A 格	881	99.21	99.63	4.76	1.50	1.71	1.70	4.38	4.33	4.37	112
短期 (1-3)	496	99.76	100.15	2.36	1.37	1.47	1.47	2.32	2.30	2.32	105
中期 (3-7)	208	97.83	98.06	4.33	1.15	1.71	1.69	4.22	4.18	4.22	118
長期 (7-)	178	99.30	100.01	11.99	2.27	2.37	2.36	10.32	10.20	10.28	126
長期 (7-11)	64	97.92	98.33	8.57	1.83	2.15	2.13	7.91	7.83	7.91	135
超長期 (11-)	113	100.08	100.96	13.93	2.52	2.49	2.48	11.64	11.50	11.58	122
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	2,202	99.21	99.44	3.18	0.89	1.14	1.14	3.11	3.09	3.11	68
短期 (1-3)	1,196	99.45	99.67	2.17	0.81	1.05	1.05	2.15	2.14	2.15	65
中期 (3-7)	926	98.96	99.18	3.99	0.95	1.22	1.21	3.92	3.89	3.92	71
長期 (7-)	79	98.60	98.94	8.86	1.41	1.63	1.62	8.29	8.23	8.29	80
長期 (7-11)	79	98.60	98.94	8.86	1.41	1.63	1.62	8.29	8.23	8.29	80
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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10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	1,164	99.35	99.52	3.20	0.81	1.03	1.02	3.13	3.12	3.13	57
短期 (1-3)	607	99.43	99.59	2.09	0.67	0.94	0.94	2.07	2.06	2.07	55
中期 (3-7)	512	99.26	99.45	4.04	0.93	1.10	1.09	3.96	3.94	3.96	59
長期 (7-)	45	99.18	99.43	8.56	1.24	1.36	1.36	8.13	8.07	8.12	57
長期 (7-11)	45	99.18	99.43	8.56	1.24	1.36	1.36	8.13	8.07	8.12	57
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AAA~A 格	2,065	99.56	99.85	3.42	0.97	1.14	1.14	3.30	3.28	3.30	66
短期 (1-3)	1,160	99.62	99.88	2.09	0.85	1.03	1.03	2.07	2.06	2.07	63
中期 (3-7)	748	99.16	99.41	3.98	0.96	1.17	1.16	3.89	3.87	3.89	66
長期 (7-)	157	100.99	101.69	10.68	1.89	1.85	1.87	9.51	9.42	9.48	88
長期 (7-11)	95	98.26	98.60	8.66	1.34	1.60	1.59	8.15	8.08	8.14	80
超長期 (11-)	62	105.18	106.44	13.79	2.73	2.21	2.26	11.45	11.32	11.39	101
AAA~BBB 格	2,915	99.26	99.54	3.68	1.05	1.27	1.27	3.51	3.49	3.51	77
短期 (1-3)	1,525	99.59	99.85	2.16	0.92	1.11	1.11	2.13	2.12	2.13	70
中期 (3-7)	1,119	98.85	99.10	4.00	1.01	1.30	1.29	3.91	3.89	3.91	79
長期 (7-)	270	99.06	99.65	10.95	1.98	2.11	2.10	9.65	9.55	9.62	110
長期 (7-11)	149	98.29	98.65	8.61	1.55	1.81	1.80	8.04	7.97	8.03	101
超長期 (11-)	121	100.00	100.88	13.85	2.50	2.48	2.47	11.60	11.46	11.54	121
AAA~BB 格	2,915	99.26	99.54	3.68	1.05	1.27	1.27	3.51	3.49	3.51	77
短期 (1-3)	1,525	99.59	99.85	2.16	0.92	1.11	1.11	2.13	2.12	2.13	70
中期 (3-7)	1,119	98.85	99.10	4.00	1.01	1.30	1.29	3.91	3.89	3.91	79
長期 (7-)	270	99.06	99.65	10.95	1.98	2.11	2.10	9.65	9.55	9.62	110
長期 (7-11)	149	98.29	98.65	8.61	1.55	1.81	1.80	8.04	7.97	8.03	101
超長期 (11-)	121	100.00	100.88	13.85	2.50	2.48	2.47	11.60	11.46	11.54	121
AAA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA 格	1,164	99.35	99.52	3.20	0.81	1.03	1.02	3.13	3.12	3.13	57
短期 (1-3)	607	99.43	99.59	2.09	0.67	0.94	0.94	2.07	2.06	2.07	55
中期 (3-7)	512	99.26	99.45	4.04	0.93	1.10	1.09	3.96	3.94	3.96	59
長期 (7-)	45	99.18	99.43	8.56	1.24	1.36	1.36	8.13	8.07	8.12	57
長期 (7-11)	45	99.18	99.43	8.56	1.24	1.36	1.36	8.13	8.07	8.12	57
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
A 格	901	99.83	100.27	3.72	1.19	1.29	1.29	3.52	3.49	3.51	79
短期 (1-3)	553	99.83	100.21	2.09	1.06	1.13	1.13	2.06	2.05	2.06	73
中期 (3-7)	236	98.92	99.32	3.83	1.04	1.32	1.31	3.74	3.72	3.74	82
長期 (7-)	112	101.71	102.59	11.53	2.15	2.04	2.06	10.04	9.94	10.00	100
長期 (7-11)	50	97.46	97.87	8.75	1.43	1.82	1.80	8.17	8.09	8.16	100
超長期 (11-)	62	105.18	106.44	13.79	2.73	2.21	2.26	11.45	11.32	11.39	101
BBB 格	850	98.54	98.81	4.30	1.24	1.60	1.59	4.03	3.99	4.02	105
短期 (1-3)	365	99.51	99.74	2.37	1.13	1.35	1.35	2.34	2.32	2.34	94
中期 (3-7)	371	98.24	98.49	4.05	1.10	1.58	1.56	3.95	3.92	3.95	106
長期 (7-)	113	96.39	96.83	11.33	2.09	2.48	2.44	9.85	9.73	9.82	141
長期 (7-11)	55	98.34	98.74	8.53	1.92	2.18	2.16	7.84	7.76	7.84	138
超長期 (11-)	59	94.58	95.05	13.92	2.25	2.78	2.71	11.78	11.63	11.72	144
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	210	98.21	98.59	2.70	1.29	1.85	1.84	2.63	2.61	2.63	141
短期 (1-3)	163	98.77	99.23	2.12	1.34	1.82	1.81	2.08	2.06	2.08	141
中期 (3-7)	39	96.79	96.87	4.21	1.11	1.94	1.91	4.12	4.08	4.12	140
長期 (7-)	8	93.54	93.76	7.32	1.15	2.17	2.11	7.02	6.94	7.01	144
長期 (7-11)	8	93.54	93.76	7.32	1.15	2.17	2.11	7.02	6.94	7.01	144
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10月末、11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	1,326	99.39	99.56	3.23	0.81	1.01	1.01	3.17	3.16	3.17	55
短期 (1-3)	717	99.49	99.63	2.21	0.69	0.93	0.93	2.19	2.18	2.19	53
中期 (3-7)	564	99.30	99.47	4.12	0.93	1.09	1.09	4.04	4.02	4.04	58
長期 (7-)	45	99.18	99.43	8.56	1.24	1.36	1.36	8.13	8.07	8.12	57
長期 (7-11)	45	99.18	99.43	8.56	1.24	1.36	1.36	8.13	8.07	8.12	57
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AAA~A 格	2,277	99.57	99.85	3.42	0.96	1.12	1.12	3.31	3.29	3.30	64
短期 (1-3)	1,326	99.67	99.92	2.19	0.86	1.01	1.01	2.16	2.15	2.16	61
中期 (3-7)	795	99.14	99.36	4.05	0.94	1.15	1.15	3.97	3.95	3.97	64
長期 (7-)	157	100.99	101.69	10.68	1.89	1.85	1.87	9.51	9.42	9.48	88
長期 (7-11)	98	98.38	98.75	8.74	1.37	1.62	1.61	8.20	8.13	8.19	81
超長期 (11-)	59	105.34	106.60	13.93	2.75	2.22	2.27	11.54	11.41	11.48	100
AAA~BBB 格	3,246	99.26	99.52	3.64	1.04	1.26	1.26	3.49	3.46	3.48	77
短期 (1-3)	1,792	99.59	99.83	2.25	0.93	1.11	1.11	2.22	2.21	2.22	71
中期 (3-7)	1,175	98.83	99.07	4.06	0.99	1.29	1.28	3.97	3.95	3.97	78
長期 (7-)	279	98.90	99.48	10.85	1.95	2.12	2.10	9.58	9.47	9.55	111
長期 (7-11)	162	98.14	98.51	8.61	1.56	1.84	1.83	8.03	7.96	8.02	104
超長期 (11-)	118	99.95	100.82	13.93	2.50	2.48	2.48	11.66	11.51	11.59	121
AAA~BB 格	3,246	99.26	99.52	3.64	1.04	1.26	1.26	3.49	3.46	3.48	77
短期 (1-3)	1,792	99.59	99.83	2.25	0.93	1.11	1.11	2.22	2.21	2.22	71
中期 (3-7)	1,175	98.83	99.07	4.06	0.99	1.29	1.28	3.97	3.95	3.97	78
長期 (7-)	279	98.90	99.48	10.85	1.95	2.12	2.10	9.58	9.47	9.55	111
長期 (7-11)	162	98.14	98.51	8.61	1.56	1.84	1.83	8.03	7.96	8.02	104
超長期 (11-)	118	99.95	100.82	13.93	2.50	2.48	2.48	11.66	11.51	11.59	121
AAA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA 格	1,326	99.39	99.56	3.23	0.81	1.01	1.01	3.17	3.16	3.17	55
短期 (1-3)	717	99.49	99.63	2.21	0.69	0.93	0.93	2.19	2.18	2.19	53
中期 (3-7)	564	99.30	99.47	4.12	0.93	1.09	1.09	4.04	4.02	4.04	58
長期 (7-)	45	99.18	99.43	8.56	1.24	1.36	1.36	8.13	8.07	8.12	57
長期 (7-11)	45	99.18	99.43	8.56	1.24	1.36	1.36	8.13	8.07	8.12	57
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
A 格	951	99.82	100.26	3.68	1.17	1.27	1.27	3.49	3.46	3.48	76
短期 (1-3)	608	99.89	100.26	2.16	1.06	1.11	1.11	2.13	2.12	2.13	70
中期 (3-7)	231	98.75	99.10	3.89	0.97	1.31	1.30	3.81	3.78	3.80	80
長期 (7-)	112	101.71	102.59	11.53	2.15	2.04	2.06	10.04	9.94	10.00	100
長期 (7-11)	53	97.72	98.17	8.88	1.49	1.84	1.83	8.25	8.18	8.25	101
超長期 (11-)	59	105.34	106.60	13.93	2.75	2.22	2.27	11.54	11.41	11.48	100
BBB 格	969	98.51	98.76	4.16	1.23	1.61	1.59	3.91	3.88	3.91	107
短期 (1-3)	466	99.36	99.58	2.42	1.12	1.40	1.40	2.39	2.37	2.39	98
中期 (3-7)	380	98.19	98.44	4.08	1.10	1.58	1.57	3.98	3.95	3.98	107
長期 (7-)	123	96.23	96.66	11.06	2.04	2.47	2.42	9.67	9.55	9.63	142
長期 (7-11)	64	97.77	98.14	8.41	1.84	2.18	2.16	7.77	7.68	7.76	139
超長期 (11-)	59	94.58	95.05	13.92	2.25	2.78	2.71	11.78	11.63	11.72	144
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	131	98.60	99.12	2.38	1.54	1.98	1.97	2.32	2.30	2.32	156
短期 (1-3)	101	99.07	99.74	1.91	1.67	1.99	1.98	1.87	1.85	1.87	160
中期 (3-7)	30	96.99	97.05	3.95	1.12	1.94	1.91	3.87	3.83	3.87	141
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
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10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	279	99.26	99.47	3.13	0.75	0.98	0.98	3.07	3.06	3.07	52
短期 (1-3)	168	99.60	99.81	2.17	0.73	0.92	0.92	2.15	2.14	2.15	52
中期 (3-7)	98	98.88	99.07	4.08	0.74	1.05	1.04	4.02	4.00	4.02	53
長期 (7-)	14	97.96	98.11	8.03	0.94	1.27	1.25	7.75	7.70	7.75	51
長期 (7-11)	14	97.96	98.11	8.03	0.94	1.27	1.25	7.75	7.70	7.75	51
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AAA~A 格	2,006	99.57	99.86	3.39	0.96	1.13	1.13	3.27	3.25	3.27	65
短期 (1-3)	1,127	99.62	99.88	2.10	0.85	1.03	1.03	2.08	2.07	2.08	63
中期 (3-7)	740	99.17	99.41	3.96	0.96	1.16	1.16	3.88	3.86	3.88	66
長期 (7-)	139	101.37	102.11	10.81	1.89	1.81	1.83	9.60	9.51	9.57	83
長期 (7-11)	77	98.30	98.63	8.42	1.21	1.46	1.45	8.00	7.94	8.00	68
超長期 (11-)	62	105.18	106.44	13.79	2.73	2.21	2.26	11.45	11.32	11.39	101
AAA~BBB 格	3,061	99.19	99.48	3.64	1.06	1.30	1.30	3.48	3.45	3.48	80
短期 (1-3)	1,633	99.51	99.78	2.16	0.94	1.15	1.15	2.14	2.13	2.14	75
中期 (3-7)	1,153	98.79	99.04	4.00	1.01	1.32	1.31	3.92	3.89	3.92	81
長期 (7-)	276	98.95	99.53	10.88	1.96	2.12	2.11	9.60	9.50	9.57	111
長期 (7-11)	155	98.12	98.48	8.57	1.55	1.83	1.82	8.00	7.93	8.00	103
超長期 (11-)	121	100.00	100.88	13.85	2.50	2.48	2.47	11.60	11.46	11.54	121
AAA~BB 格	3,061	99.19	99.48	3.64	1.06	1.30	1.30	3.48	3.45	3.48	80
短期 (1-3)	1,633	99.51	99.78	2.16	0.94	1.15	1.15	2.14	2.13	2.14	75
中期 (3-7)	1,153	98.79	99.04	4.00	1.01	1.32	1.31	3.92	3.89	3.92	81
長期 (7-)	276	98.95	99.53	10.88	1.96	2.12	2.11	9.60	9.50	9.57	111
長期 (7-11)	155	98.12	98.48	8.57	1.55	1.83	1.82	8.00	7.93	8.00	103
超長期 (11-)	121	100.00	100.88	13.85	2.50	2.48	2.47	11.60	11.46	11.54	121
AAA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA 格	279	99.26	99.47	3.13	0.75	0.98	0.98	3.07	3.06	3.07	52
短期 (1-3)	168	99.60	99.81	2.17	0.73	0.92	0.92	2.15	2.14	2.15	52
中期 (3-7)	98	98.88	99.07	4.08	0.74	1.05	1.04	4.02	4.00	4.02	53
長期 (7-)	14	97.96	98.11	8.03	0.94	1.27	1.25	7.75	7.70	7.75	51
長期 (7-11)	14	97.96	98.11	8.03	0.94	1.27	1.25	7.75	7.70	7.75	51
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
A 格	1,727	99.62	99.93	3.43	1.00	1.16	1.16	3.30	3.28	3.30	68
短期 (1-3)	960	99.62	99.89	2.08	0.87	1.05	1.05	2.06	2.05	2.06	65
中期 (3-7)	642	99.21	99.46	3.94	0.99	1.18	1.18	3.86	3.84	3.86	68
長期 (7-)	125	101.74	102.55	11.12	1.99	1.87	1.89	9.79	9.70	9.76	86
長期 (7-11)	63	98.38	98.75	8.51	1.27	1.51	1.50	8.05	7.99	8.05	71
超長期 (11-)	62	105.18	106.44	13.79	2.73	2.21	2.26	11.45	11.32	11.39	101
BBB 格	1,056	98.47	98.75	4.13	1.24	1.63	1.61	3.88	3.84	3.87	109
短期 (1-3)	506	99.28	99.56	2.31	1.13	1.42	1.42	2.28	2.26	2.28	101
中期 (3-7)	413	98.12	98.37	4.09	1.11	1.61	1.60	3.99	3.95	3.99	109
長期 (7-)	137	96.50	96.92	10.95	2.04	2.45	2.40	9.60	9.48	9.57	141
長期 (7-11)	78	97.95	98.32	8.71	1.88	2.20	2.18	8.00	7.92	8.00	138
超長期 (11-)	59	94.58	95.05	13.92	2.25	2.78	2.71	11.78	11.63	11.72	144
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	64	99.00	99.49	2.25	1.48	1.86	1.85	2.19	2.17	2.19	145
短期 (1-3)	56	99.47	99.99	1.80	1.62	1.93	1.92	1.77	1.75	1.77	154
中期 (3-7)	6	96.74	97.00	4.55	0.58	1.34	1.32	4.49	4.46	4.49	79
長期 (7-)	2	93.40	93.53	7.26	0.51	1.52	1.47	7.12	7.07	7.12	81
長期 (7-11)	2	93.40	93.53	7.26	0.51	1.52	1.47	7.12	7.07	7.12	81
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10月末、11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	491	99.48	99.63	3.25	0.78	0.94	0.94	3.20	3.18	3.20	48
短期 (1-3)	323	99.70	99.85	2.51	0.76	0.89	0.89	2.48	2.47	2.48	46
中期 (3-7)	154	99.15	99.31	4.37	0.81	1.03	1.03	4.30	4.27	4.30	51
長期 (7-)	14	97.96	98.11	8.03	0.94	1.27	1.25	7.75	7.70	7.75	51
長期 (7-11)	14	97.96	98.11	8.03	0.94	1.27	1.25	7.75	7.70	7.75	51
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AAA~A 格	2,218	99.59	99.86	3.39	0.95	1.11	1.11	3.28	3.26	3.28	63
短期 (1-3)	1,293	99.67	99.92	2.20	0.86	1.01	1.01	2.18	2.16	2.18	60
中期 (3-7)	787	99.15	99.37	4.04	0.94	1.15	1.15	3.96	3.94	3.96	64
長期 (7-)	139	101.37	102.11	10.81	1.89	1.81	1.83	9.60	9.51	9.57	83
長期 (7-11)	80	98.45	98.81	8.52	1.25	1.49	1.48	8.06	8.00	8.06	70
超長期 (11-)	59	105.34	106.60	13.93	2.75	2.22	2.27	11.54	11.41	11.48	100
AAA~BBB 格	3,313	99.23	99.51	3.62	1.05	1.28	1.28	3.46	3.44	3.46	78
短期 (1-3)	1,837	99.56	99.82	2.24	0.95	1.14	1.14	2.22	2.20	2.22	73
中期 (3-7)	1,199	98.79	99.03	4.05	1.00	1.31	1.30	3.97	3.94	3.97	79
長期 (7-)	277	98.95	99.53	10.88	1.97	2.12	2.11	9.60	9.49	9.56	111
長期 (7-11)	159	98.21	98.58	8.62	1.57	1.85	1.83	8.04	7.97	8.03	104
超長期 (11-)	118	99.95	100.82	13.93	2.50	2.48	2.48	11.66	11.51	11.59	121
AAA~BB 格	3,313	99.23	99.51	3.62	1.05	1.28	1.28	3.46	3.44	3.46	78
短期 (1-3)	1,837	99.56	99.82	2.24	0.95	1.14	1.14	2.22	2.20	2.22	73
中期 (3-7)	1,199	98.79	99.03	4.05	1.00	1.31	1.30	3.97	3.94	3.97	79
長期 (7-)	277	98.95	99.53	10.88	1.97	2.12	2.11	9.60	9.49	9.56	111
長期 (7-11)	159	98.21	98.58	8.62	1.57	1.85	1.83	8.04	7.97	8.03	104
超長期 (11-)	118	99.95	100.82	13.93	2.50	2.48	2.48	11.66	11.51	11.59	121
AAA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA 格	491	99.48	99.63	3.25	0.78	0.94	0.94	3.20	3.18	3.20	48
短期 (1-3)	323	99.70	99.85	2.51	0.76	0.89	0.89	2.48	2.47	2.48	46
中期 (3-7)	154	99.15	99.31	4.37	0.81	1.03	1.03	4.30	4.27	4.30	51
長期 (7-)	14	97.96	98.11	8.03	0.94	1.27	1.25	7.75	7.70	7.75	51
長期 (7-11)	14	97.96	98.11	8.03	0.94	1.27	1.25	7.75	7.70	7.75	51
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
A 格	1,727	99.62	99.93	3.43	1.00	1.16	1.16	3.30	3.28	3.30	68
短期 (1-3)	970	99.66	99.94	2.09	0.89	1.05	1.05	2.07	2.06	2.07	65
中期 (3-7)	632	99.15	99.38	3.96	0.97	1.18	1.17	3.88	3.85	3.88	67
長期 (7-)	125	101.74	102.55	11.12	1.99	1.87	1.89	9.79	9.70	9.76	86
長期 (7-11)	66	98.55	98.96	8.62	1.32	1.54	1.53	8.13	8.07	8.12	74
超長期 (11-)	59	105.34	106.60	13.93	2.75	2.22	2.27	11.54	11.41	11.48	100
BBB 格	1,095	98.51	98.80	4.09	1.25	1.63	1.62	3.84	3.81	3.84	110
短期 (1-3)	545	99.31	99.59	2.35	1.16	1.44	1.44	2.32	2.30	2.32	103
中期 (3-7)	413	98.12	98.37	4.09	1.11	1.61	1.60	3.99	3.95	3.99	109
長期 (7-)	138	96.52	96.94	10.94	2.05	2.45	2.41	9.59	9.47	9.56	141
長期 (7-11)	79	97.97	98.34	8.73	1.89	2.20	2.19	8.02	7.93	8.01	139
超長期 (11-)	59	94.58	95.05	13.92	2.25	2.78	2.71	11.78	11.63	11.72	144
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	64	99.00	99.49	2.25	1.48	1.86	1.85	2.19	2.17	2.19	145
短期 (1-3)	56	99.47	99.99	1.80	1.62	1.93	1.92	1.77	1.75	1.77	154
中期 (3-7)	6	96.74	97.00	4.55	0.58	1.34	1.32	4.49	4.46	4.49	79
長期 (7-)	2	93.40	93.53	7.26	0.51	1.52	1.47	7.12	7.07	7.12	81
長期 (7-11)	2	93.40	93.53	7.26	0.51	1.52	1.47	7.12	7.07	7.12	81
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10月末
銘柄数	13,875	14,702	15,303	15,524	16,009	16,127
額面(10億円)	970,751	1,016,799	1,055,162	1,084,026	1,123,852	1,145,388
時価単価(円)	108.41	106.49	104.20	101.51	98.40	96.27
利含単価(円)	108.53	106.60	104.31	101.62	98.50	96.45
残存年数(年)	9.85	9.89	10.02	10.17	10.21	10.19
利率(%)	0.89	0.83	0.79	0.77	0.78	0.81
単利(%)	0.08	0.14	0.27	0.43	0.73	0.98
複利(%)	0.08	0.14	0.27	0.43	0.72	0.95
Dur(年)	9.47	9.36	9.32	9.19	8.93	8.68
M-Dur	9.46	9.35	9.30	9.16	8.88	8.62
E-Dur	9.46	9.34	9.29	9.16	8.90	8.63
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。

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

BPI_{today}	: 当日累積投資収益指数
$BPI_{\text{e.l.m.}}$: 前月末累積投資収益指数
$MVLt_{\text{today}}$: 当日経過利子込み時価総額
$MVLt_{\text{e.l.m.}}$: 前月末経過利子込み時価総額
$CF_{\text{e.l.m.,today}}$: 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9月の月末営業日から2024年10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10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10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9月の月末営業日から2024年10月の月末営業日までの投資収益率(年率換算,%)
- 2024年9月の月末営業日において、10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10月ポートフォリオの、右ページには11月ポートフォリオの、2024年10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10月末(暦上)における残存年数(至最終償還日)で区分。ただし11月ポートフォリオでは、2024年11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