

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 360.756	-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)

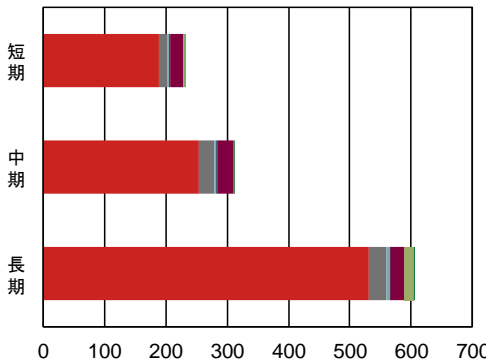
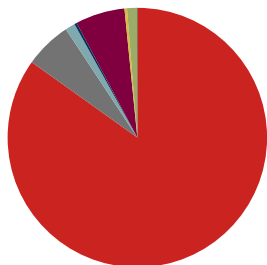
(注) 投資収益率は年率換算(%)

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]	1156.24	1146.37	9.87
デュレーション[年]	8.71	8.68	0.04
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。



出所: NFRC

	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%	6.2%	0.3%	1.2%	0.1%
全体	972.94	66.92	14.20	3.43	70.68	3.60	13.95	0.65
短期	189.46	12.77	3.37	1.99	21.13	1.87	-	0.17
中期	253.41	24.75	4.17	1.27	26.33	1.37	-	0.30
長期	530.08	29.41	6.66	0.17	23.22	0.36	13.95	0.18

出所: NFRC

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」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
事業債 業種別・ポートフォリオ指標	19
事業債 円建外債 格付別・ポートフォリオ指標	27
事業債 格付会社別・ポートフォリオ指標	29
円建外債 格付会社別・ポートフォリオ指標	41
NOMURA-BPI/Extended 総合・ポートフォリオ指標の推移	53
NOMURA-BPI/Extended の定義	54
レポートの表記等について	55
NOMURA-BPI/Extended のデータ提供について	56
ディスクレイマー	57

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	360.756	-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	383.739	-3.80	-4.57	0.77	-1.50	-1.11
円建外債	393.887	-1.70	-2.78	1.09	1.00	1.10
MBS	123.849	-4.69	-5.35	0.67	-2.01	-1.89
ABS	113.629	-2.46	-3.22	0.75	-0.36	-0.57

出所:NFRC

投資収益率は年率換算(%)

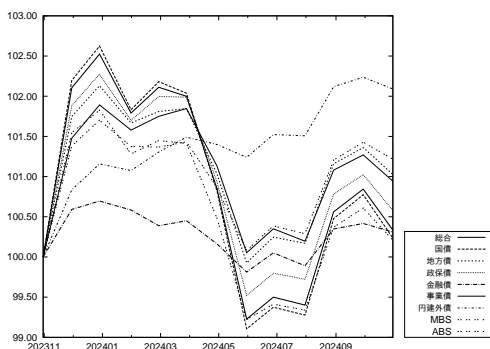
銘柄別・累積投資収益指数の推移

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	359.551	369.972	384.497	360.606	272.197	380.155	385.826	123.591	112.264
2023/11/30	367.118	378.104	391.217	367.399	273.808	385.772	389.052	125.500	113.814
2023/12/29	368.626	379.681	392.689	368.807	274.089	387.346	390.292	125.847	114.174
2024/01/31	365.991	376.748	390.907	366.730	273.788	386.157	389.975	125.176	113.808
2024/02/29	367.144	378.041	391.457	367.807	273.255	386.807	390.861	125.381	113.798
2024/03/29	366.739	377.512	391.595	367.776	273.423	387.176	391.578	125.336	113.872
2024/04/30	362.596	373.000	388.461	363.973	272.639	384.451	391.225	124.185	113.234
2024/05/31	356.774	366.662	384.217	358.882	271.686	380.353	390.609	122.629	112.355
2024/06/28	357.755	367.658	385.446	359.874	272.337	381.486	391.703	122.865	112.698
2024/07/31	357.399	367.297	385.149	359.607	271.899	380.900	391.643	122.774	112.589
2024/08/30	361.570	371.736	388.953	363.424	273.145	384.262	393.998	124.049	113.617
2024/09/30	362.589	372.840	389.729	364.301	273.331	384.980	394.456	124.344	113.867
2024/10/01	362.624	372.877	389.778	364.330	273.346	385.021	394.660	124.320	113.883
2024/10/02	363.348	373.646	390.482	365.025	273.535	385.583	395.010	124.537	114.047
2024/10/03	363.128	373.402	390.344	364.851	273.538	385.460	394.999	124.496	114.023
2024/10/04	362.816	373.079	389.945	364.552	273.447	385.195	394.760	124.375	113.927
2024/10/07	361.612	371.794	388.879	363.440	273.099	384.254	393.970	124.017	113.676
2024/10/08	361.602	371.782	388.866	363.411	273.110	384.247	394.294	124.011	113.675
2024/10/09	361.176	371.317	388.569	363.023	273.078	383.960	394.195	123.901	113.614
2024/10/10	360.427	370.503	388.007	362.354	272.969	383.445	393.892	123.717	113.497
2024/10/11	360.778	370.886	388.254	362.671	272.989	383.672	393.991	123.803	113.545
2024/10/15	360.401	370.487	387.870	362.310	272.913	383.393	393.816	123.667	113.462
2024/10/16	360.844	370.962	388.263	362.702	272.988	383.711	394.038	123.803	113.555
2024/10/17	360.797	370.933	388.045	362.614	272.894	383.603	393.727	123.738	113.490
2024/10/18	360.532	370.644	387.843	362.396	272.853	383.444	393.535	123.663	113.452
2024/10/21	360.670	370.775	388.119	362.544	272.942	383.606	393.885	123.740	113.529
2024/10/22	359.902	369.941	387.528	361.872	272.779	383.049	393.709	123.557	113.398
2024/10/23	359.887	369.924	387.531	361.841	272.795	383.028	393.735	123.562	113.403
2024/10/24	360.272	370.333	387.921	362.192	272.860	383.319	393.926	123.689	113.495
2024/10/25	360.693	370.797	388.182	362.568	272.897	383.597	394.077	123.763	113.547
2024/10/28	359.976	370.011	387.693	361.937	272.820	383.138	393.886	123.582	113.453
2024/10/29	359.999	370.038	387.687	361.963	272.852	383.160	393.796	123.568	113.454
2024/10/30	360.251	370.295	388.036	362.210	272.952	383.383	393.967	123.695	113.540
2024/10/31	360.756	370.841	388.443	362.695	273.039	383.739	393.887	123.849	113.629

出所:NFRC

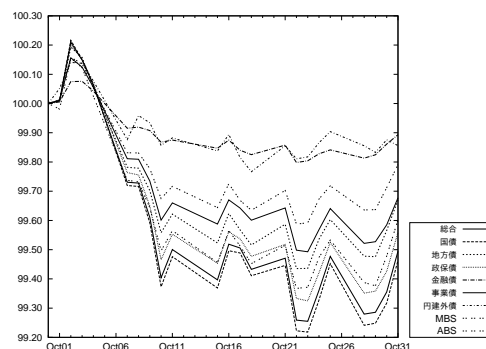
1983年12月末=100。MBSセクターは2003年3月末=100。ABSセクターは2008年3月末=100

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	360.756	-5.95	-6.79	0.84	-2.76	-2.54
短期 (1-3)	234.244	-0.67	-1.08	0.40	-0.29	-0.43
中期 (3-7)	336.293	-2.81	-3.46	0.65	-0.74	-1.03
長期 (7-)	528.115	-9.84	-10.96	1.12	-4.85	-4.21
長期 (7-11)	193.659	-4.03	-5.03	1.00	-0.89	-1.05
超長期 (11-)	232.291	-13.36	-14.56	1.20	-7.19	-6.06
(11-15)	224.162	-6.03	-7.03	1.00	-2.91	-2.41
(15-)	237.094	-15.99	-17.25	1.27	-8.71	-7.35

出所:NFRC

投資収益率は年率換算(%)

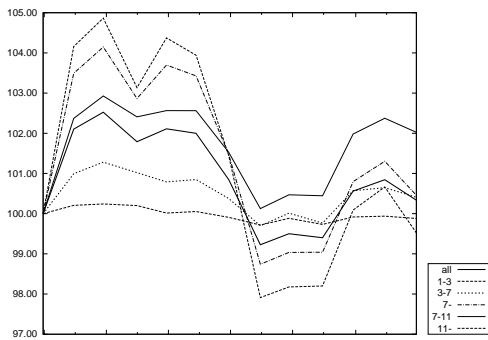
総合 残存別・投資収益指数の推移

総合 年/月/日	全体	短期 (1-3)	中期 (3-7)	長期 (7-)	長期*			
					長期* (7-11)	超長期* (11-)	(11-15)*	(15-)*
2023/10/31	359.551	234.523	334.930	525.707	189.819	233.407	220.021	240.245
2023/11/30	367.118	235.006	338.256	544.071	194.317	243.113	227.497	250.919
2023/12/29	368.626	235.090	339.221	547.500	195.377	244.765	228.791	252.723
2024/01/31	365.991	234.995	338.348	540.767	194.390	240.724	226.820	247.842
2024/02/29	367.144	234.558	337.577	545.152	194.686	243.614	228.280	251.309
2024/03/29	366.739	234.647	337.774	543.729	194.683	242.610	228.094	249.975
2024/04/30	362.596	234.310	336.192	533.463	192.717	236.775	224.313	243.291
2024/05/31	356.774	233.859	333.922	519.085	190.058	228.531	219.134	233.792
2024/06/28	357.755	234.252	334.973	520.633	190.709	229.152	219.682	234.445
2024/07/31	357.399	233.895	334.143	520.662	190.664	229.206	220.056	234.377
2024/08/30	361.570	234.330	336.843	529.900	193.579	233.616	224.041	238.981
2024/09/30	362.589	234.378	337.099	532.566	194.325	234.958	225.316	240.358
2024/10/01	362.624	234.387	337.138	532.625	194.362	234.973	225.337	240.370
2024/10/02	363.348	234.483	337.490	534.314	194.889	235.784	226.208	241.164
2024/10/03	363.128	234.501	337.450	533.700	194.781	235.428	226.022	240.741
2024/10/04	362.816	234.480	337.185	533.052	194.416	235.235	225.627	240.624
2024/10/07	361.612	234.307	336.473	530.366	193.780	233.798	224.572	239.031
2024/10/08	361.602	234.320	336.468	530.329	193.784	233.769	224.476	239.027
2024/10/09	361.176	234.322	336.348	529.204	193.617	233.094	224.112	238.228
2024/10/10	360.427	234.280	336.096	527.305	193.242	232.023	223.523	236.966
2024/10/11	360.778	234.267	336.167	528.266	193.405	232.585	223.795	237.642
2024/10/15	360.401	234.239	335.961	527.387	193.090	232.193	223.383	237.255
2024/10/16	360.844	234.243	336.191	528.458	193.394	232.728	223.872	237.812
2024/10/17	360.797	234.199	335.966	528.560	193.231	232.921	223.641	238.167
2024/10/18	360.532	234.182	335.884	527.883	193.093	232.542	223.399	237.734
2024/10/21	360.670	234.213	336.103	528.062	193.321	232.502	223.649	237.583
2024/10/22	359.902	234.127	335.780	526.210	192.931	231.475	223.084	236.372
2024/10/23	359.887	234.147	335.806	526.125	192.970	231.386	223.114	236.237
2024/10/24	360.272	234.155	336.006	527.054	193.302	231.802	223.555	236.646
2024/10/25	360.693	234.161	336.085	528.192	193.461	232.491	223.800	237.510
2024/10/28	359.976	234.131	335.903	526.313	193.145	231.391	223.227	236.201
2024/10/29	359.999	234.163	335.907	526.347	193.110	231.441	223.139	236.304
2024/10/30	360.251	234.205	336.123	526.846	193.413	231.572	223.571	236.321
2024/10/31	360.756	234.244	336.293	528.115	193.659	232.291	224.162	237.094

出所:NFRC

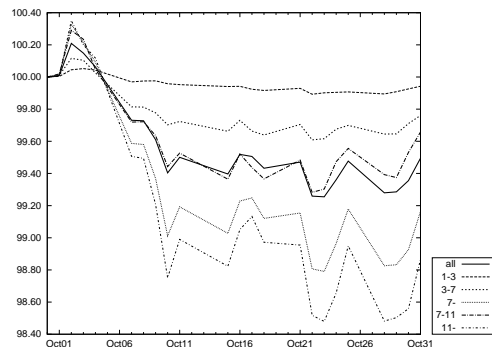
*は1995年12月末=100。それ以外は、1983年12月末=100。

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(%)

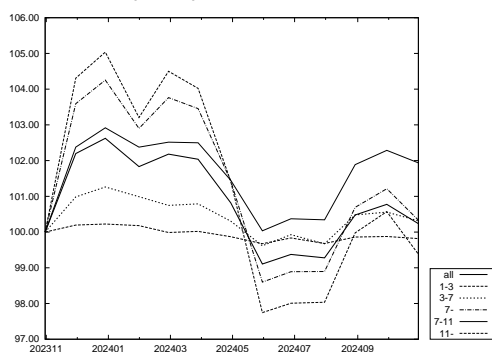
国債 残存別・投資収益指数の推移

国債 年/月/日	全体	短期 (1-3)	中期 (3-7)	長期 (7-)	長期*			
					長期* (7-11)	超長期* (11-)	(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

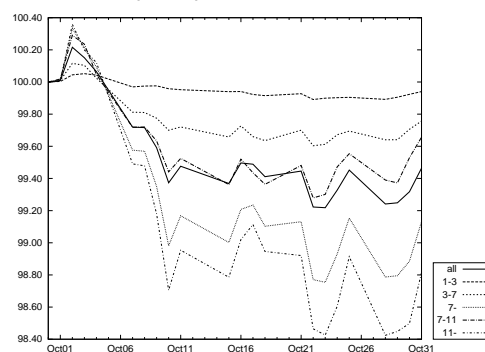
*は1995年12月末=100。それ以外は、1983年12月末=100。

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	360.636	-5.97	-6.81	0.84	-2.77	-2.55
短期(1-3)	234.244	-0.67	-1.08	0.40	-0.29	-0.43
中期(3-7)	336.293	-2.81	-3.46	0.65	-0.74	-1.03
長期(7-)	529.951	-9.97	-11.10	1.13	-4.92	-4.27
長期(7-11)	193.655	-4.04	-5.04	1.00	-0.89	-1.05
超長期(11-)	233.953	-13.70	-14.92	1.22	-7.39	-6.22
(11-15)	224.151	-6.03	-7.03	1.00	-2.91	-2.41
(15-)	238.959	-16.59	-17.89	1.30	-9.07	-7.64

出所:NFRC

NOMURA-BPI/Extended 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(%)

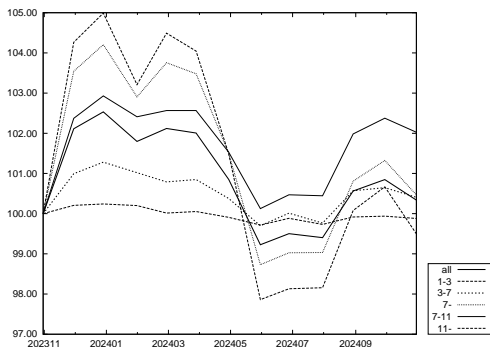
「除くMBS」残存別・投資収益指数の推移

除くMBS 年/月/日	全体	短期 (1-3)	中期 (3-7)	長期 (7-)	長期*			
					長期* (7-11)	超長期* (11-)	(11-15)*	(15-)*
2023/10/31	359.425	234.523	334.930	527.497	189.811	235.137	220.008	242.330
2023/11/30	367.015	235.006	338.256	546.187	194.313	245.165	227.485	253.494
2023/12/29	368.529	235.090	339.221	549.679	195.373	246.870	228.780	255.378
2024/01/31	365.886	234.995	338.348	542.823	194.386	242.685	226.809	250.252
2024/02/29	367.046	234.558	337.577	547.312	194.682	245.698	228.269	253.921
2024/03/29	366.638	234.647	337.774	545.852	194.679	244.650	228.083	252.505
2024/04/30	362.486	234.310	336.192	535.416	192.712	238.624	224.302	245.515
2024/05/31	356.649	233.859	333.922	520.795	190.051	230.108	219.123	235.578
2024/06/28	357.634	234.252	334.973	522.362	190.702	230.741	219.671	236.248
2024/07/31	357.277	233.895	334.143	522.402	190.657	230.804	220.046	236.185
2024/08/30	361.453	234.330	336.843	531.765	193.574	235.325	224.030	240.942
2024/09/30	362.473	234.378	337.099	534.475	194.321	236.708	225.304	242.375
2024/10/01	362.509	234.387	337.138	534.539	194.358	236.725	225.326	242.390
2024/10/02	363.234	234.483	337.490	536.252	194.885	237.557	226.197	243.211
2024/10/03	363.013	234.501	337.450	535.625	194.777	237.188	226.011	242.765
2024/10/04	362.701	234.480	337.185	534.971	194.412	236.995	225.616	242.654
2024/10/07	361.496	234.307	336.473	532.248	193.775	235.518	224.561	241.000
2024/10/08	361.486	234.320	336.468	532.211	193.780	235.488	224.465	240.995
2024/10/09	361.059	234.322	336.348	531.065	193.612	234.790	224.101	240.159
2024/10/10	360.308	234.280	336.096	529.133	193.237	233.683	223.512	238.837
2024/10/11	360.659	234.267	336.167	530.112	193.400	234.264	223.784	239.546
2024/10/15	360.283	234.239	335.961	529.222	193.085	233.864	223.372	239.149
2024/10/16	360.726	234.243	336.191	530.309	193.389	234.414	223.861	239.727
2024/10/17	360.681	234.199	335.966	530.421	193.226	234.620	223.630	240.111
2024/10/18	360.415	234.182	335.884	529.733	193.088	234.230	223.388	239.659
2024/10/21	360.553	234.213	336.103	529.908	193.316	234.182	223.638	239.490
2024/10/22	359.782	234.127	335.780	528.023	192.925	233.121	223.073	238.223
2024/10/23	359.766	234.147	335.806	527.936	192.965	233.028	223.103	238.079
2024/10/24	360.152	234.155	336.006	528.878	193.297	233.453	223.544	238.500
2024/10/25	360.575	234.161	336.085	530.040	193.457	234.169	223.789	239.410
2024/10/28	359.856	234.131	335.903	528.127	193.140	233.032	223.216	238.039
2024/10/29	359.880	234.163	335.907	528.163	193.105	233.084	223.128	238.149
2024/10/30	360.131	234.205	336.123	528.663	193.408	233.212	223.560	238.154
2024/10/31	360.636	234.244	336.293	529.951	193.655	233.953	224.151	238.959

出所:NFRC

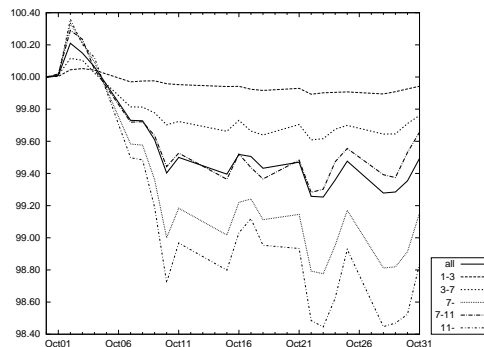
*は1995年12月末=100。それ以外は、1983年12月末=100。

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」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	360.780	-5.95	-6.79	0.84	-2.76	-2.54
短期(1-3)	234.203	-0.67	-1.08	0.40	-0.29	-0.43
中期(3-7)	336.289	-2.81	-3.46	0.65	-0.74	-1.03
長期(7-)	528.112	-9.84	-10.97	1.12	-4.85	-4.21
長期(7-11)	193.653	-4.03	-5.03	1.00	-0.89	-1.05
超長期(11-)	232.288	-13.37	-14.56	1.20	-7.19	-6.06
(11-15)	224.153	-6.03	-7.03	1.00	-2.91	-2.41
(15-)	237.096	-15.99	-17.25	1.27	-8.71	-7.35

出所:NFRC

NOMURA-BPI/Extended 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(%)

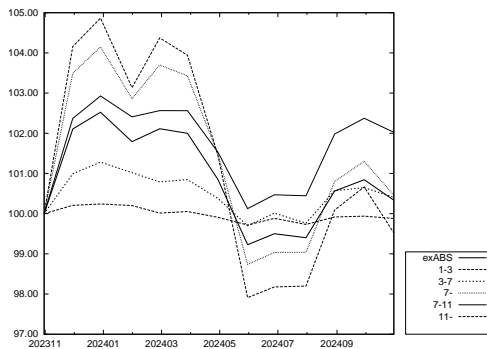
「除くABS」残存別 投資収益指数の推移

除くABS 年/月/日	全体	短期 (1-3)	中期 (3-7)	長期 (7-)	長期*			
					長期* (7-11)	超長期* (11-)	(11-15)*	(15-)*
2023/10/31	359.577	234.483	334.927	525.707	189.813	233.406	220.013	240.247
2023/11/30	367.146	234.966	338.253	544.073	194.311	243.112	227.488	250.921
2023/12/29	368.654	235.050	339.218	547.502	195.371	244.763	228.783	252.725
2024/01/31	366.018	234.955	338.345	540.768	194.384	240.722	226.812	247.844
2024/02/29	367.172	234.518	337.574	545.154	194.680	243.613	228.272	251.311
2024/03/29	366.767	234.607	337.771	543.730	194.677	242.609	228.086	249.977
2024/04/30	362.622	234.270	336.189	533.462	192.711	236.773	224.305	243.293
2024/05/31	356.797	233.819	333.919	519.083	190.052	228.529	219.126	233.794
2024/06/28	357.778	234.212	334.969	520.631	190.702	229.150	219.674	234.447
2024/07/31	357.423	233.855	334.140	520.660	190.657	229.203	220.048	234.379
2024/08/30	361.595	234.290	336.839	529.898	193.573	233.613	224.032	238.982
2024/09/30	362.614	234.337	337.095	532.564	194.318	234.955	225.307	240.360
2024/10/01	362.649	234.347	337.134	532.623	194.356	234.970	225.329	240.372
2024/10/02	363.373	234.443	337.485	534.312	194.882	235.781	226.200	241.166
2024/10/03	363.153	234.460	337.446	533.698	194.774	235.425	226.013	240.742
2024/10/04	362.841	234.439	337.180	533.049	194.410	235.232	225.619	240.626
2024/10/07	361.637	234.266	336.469	530.364	193.773	233.796	224.563	239.033
2024/10/08	361.627	234.279	336.463	530.327	193.778	233.766	224.467	239.028
2024/10/09	361.200	234.282	336.344	529.201	193.610	233.091	224.104	238.230
2024/10/10	360.451	234.240	336.091	527.303	193.236	232.021	223.515	236.968
2024/10/11	360.802	234.226	336.163	528.264	193.399	232.582	223.786	237.644
2024/10/15	360.425	234.199	335.957	527.385	193.084	232.190	223.374	237.257
2024/10/16	360.868	234.202	336.187	528.455	193.388	232.726	223.864	237.814
2024/10/17	360.821	234.159	335.962	528.558	193.225	232.918	223.633	238.169
2024/10/18	360.556	234.141	335.880	527.881	193.087	232.540	223.391	237.736
2024/10/21	360.694	234.172	336.099	528.059	193.314	232.499	223.641	237.584
2024/10/22	359.926	234.087	335.776	526.207	192.924	231.473	223.075	236.374
2024/10/23	359.911	234.107	335.802	526.122	192.964	231.384	223.106	236.239
2024/10/24	360.296	234.114	336.002	527.052	193.295	231.799	223.547	236.648
2024/10/25	360.717	234.120	336.080	528.189	193.455	232.488	223.792	237.511
2024/10/28	360.000	234.091	335.899	526.310	193.138	231.389	223.218	236.203
2024/10/29	360.023	234.123	335.902	526.344	193.103	231.438	223.130	236.305
2024/10/30	360.275	234.164	336.118	526.843	193.407	231.569	223.562	236.323
2024/10/31	360.780	234.203	336.289	528.112	193.653	232.288	224.153	237.096

出所:NFRC

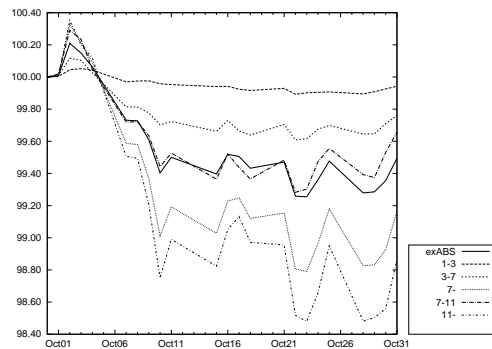
*は1995年12月末=100。それ以外は、1983年12月末=100。

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	170.189	-3.92	-4.62	0.70	-1.47	-1.25
短期(1-3)	134.246	-0.54	-0.96	0.43	-0.05	-0.16
中期(3-7)	166.891	-2.61	-3.22	0.61	-0.49	-0.65
長期(7-)	231.857	-7.01	-7.95	0.95	-3.09	-2.37
長期(7-11)	199.783	-3.93	-4.89	0.95	-0.61	-0.44
超長期(11-)	235.077	-8.99	-9.93	0.94	-4.64	-3.57

出所:NFRC

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

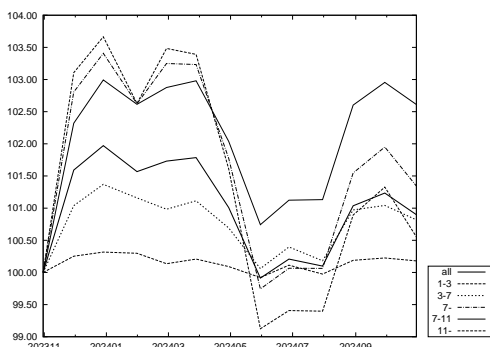
「除く国債」残存別・投資収益指数の推移

除く国債 年/月/日	全体	短期 (1-3)	中期 (3-7)	長期 (7-)	長期*	超長期*
					(7-11)	(11-)
2023/10/31	168.674	134.006	165.537	228.783	194.698	233.783
2023/11/30	171.359	134.345	167.257	235.203	199.217	241.047
2023/12/29	172.001	134.430	167.805	236.578	200.527	242.349
2024/01/31	171.319	134.406	167.456	234.785	199.789	239.928
2024/02/29	171.594	134.189	167.165	236.218	200.297	241.928
2024/03/29	171.686	134.285	167.381	236.179	200.502	241.710
2024/04/30	170.374	134.128	166.682	232.838	198.664	237.544
2024/05/31	168.527	133.899	165.636	228.198	196.144	231.736
2024/06/28	169.024	134.158	166.193	228.931	196.886	232.396
2024/07/31	168.841	133.972	165.837	228.926	196.902	232.375
2024/08/30	170.422	134.258	167.147	232.324	199.766	235.869
2024/09/30	170.757	134.308	167.261	233.245	200.452	236.885
2024/10/01	170.773	134.314	167.283	233.266	200.495	236.889
2024/10/02	171.051	134.370	167.455	233.929	201.029	237.589
2024/10/03	170.994	134.382	167.439	233.748	200.920	237.370
2024/10/04	170.850	134.369	167.313	233.429	200.560	237.112
2024/10/07	170.404	134.266	166.967	232.462	199.909	235.992
2024/10/08	170.402	134.278	166.968	232.442	199.918	235.951
2024/10/09	170.272	134.277	166.907	232.081	199.746	235.479
2024/10/10	170.033	134.253	166.783	231.458	199.357	234.736
2024/10/11	170.139	134.247	166.823	231.769	199.530	235.122
2024/10/15	169.992	134.235	166.727	231.405	199.215	234.755
2024/10/16	170.149	134.238	166.837	231.796	199.516	235.178
2024/10/17	170.077	134.212	166.727	231.712	199.349	235.166
2024/10/18	169.996	134.203	166.689	231.495	199.216	234.903
2024/10/21	170.091	134.224	166.798	231.661	199.449	235.003
2024/10/22	169.840	134.176	166.643	231.060	199.058	234.298
2024/10/23	169.836	134.187	166.649	231.029	199.081	234.229
2024/10/24	169.985	134.192	166.746	231.406	199.416	234.603
2024/10/25	170.104	134.198	166.790	231.743	199.585	235.038
2024/10/28	169.892	134.183	166.703	231.155	199.267	234.298
2024/10/29	169.894	134.202	166.707	231.137	199.233	234.293
2024/10/30	170.020	134.224	166.810	231.413	199.535	234.523
2024/10/31	170.189	134.246	166.891	231.857	199.783	235.077

出所:NFRC

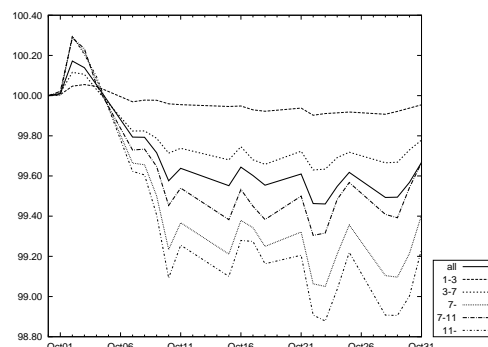
*は1995年12月末=100。それ以外は、1993年12月末=100。

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	-2.81	-9.84	-4.03	-13.36
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	-3.80	-0.43	-2.42	-8.87	-3.72	-13.30
円建外債	-1.70	-0.31	-1.96	-7.90	-5.72	-10.60
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	-3.92	-0.54	-2.61	-7.01	-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	-6.19	-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	-13.36
除く5年国債	-6.50	-0.63	-2.99	-9.84	-4.03	-13.36
除く中期国債	-6.12	-0.73	-2.81	-9.84	-4.03	-13.36
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	-0.67	-2.81	-9.85	-4.03	-13.37
除く五大都市債	-5.96	-0.67	-2.81	-9.85	-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	-13.36
除くその他政保債	-5.95	-0.67	-2.82	-9.85	-4.03	-13.38
除く金融債	-5.97	-0.67	-2.82	-9.84	-4.03	-13.36
除く特定金融債	-5.95	-0.67	-2.81	-9.84	-4.03	-13.36
除く事業債	-6.09	-0.70	-2.85	-9.88	-4.05	-13.37
除く円建外債	-5.96	-0.68	-2.82	-9.84	-4.03	-13.37
除くMBS	-5.97	-0.67	-2.81	-9.97	-4.04	-13.70
除くABS	-5.95	-0.67	-2.81	-9.84	-4.03	-13.37
除くMBS・ABS	-5.97	-0.67	-2.81	-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/Extended 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/Extended 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/Extended 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元に判断する。

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	-3.80	-0.43	-2.42	-8.87	-3.72	-13.30
水産・農林業	-1.53	-	-1.53	-	-	-
鉱業	-2.49	-0.14	-3.70	-	-	-
建設業	-1.96	-0.68	-2.29	-4.86	-3.61	-6.62
食料品	-1.99	-0.40	-2.24	-4.66	-3.57	-6.63
繊維製品	-1.96	-0.79	-1.93	-4.78	-3.49	-5.96
パルプ・紙	-2.58	-0.66	-3.22	-5.63	-3.67	-6.87
化学	-2.39	-0.51	-2.35	-5.19	-3.59	-7.21
医薬品	-2.75	-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	-2.28	-0.44	-1.95	-4.75	-3.82	-7.06
鉄鋼	-1.65	-0.42	-1.95	-3.99	-3.68	-5.53
非鉄金属	-1.72	-0.50	-2.27	-3.59	-3.59	-
金属製品	-1.60	-0.54	-2.18	-3.88	-3.88	-
機械	-1.90	-0.53	-2.42	-3.63	-3.63	-
電気機器	-1.77	-0.43	-2.28	-3.55	-3.55	-
輸送用機器	-1.73	-0.31	-2.25	-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	-3.23	-0.17	-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	-7.69	-0.44	-2.75	-12.22	-3.96	-16.56
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	-2.67	-5.10	-3.36	-6.76
情報・通信業	-1.80	0.26	-1.69	-7.65	-5.73	-12.77
卸売業	-2.78	-0.35	-2.23	-4.78	-3.73	-7.22
小売業	-1.42	-0.25	-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	-3.57	-0.53	-2.37	-6.81	-3.54	-11.23
サービス業	1.19	0.93	-2.21	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: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(%)。
- 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・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	-3.69	-0.42	-2.39	-8.86	-3.76	-13.26
AAA～A 格	-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
BBB 格	-1.82	-0.10	-2.05	-8.05	-4.88	-11.09
事業債 全体	-3.80	-0.43	-2.42	-8.87	-3.72	-13.30
AAA～A 格	-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
BBB 格	-1.00	0.06	-1.76	-5.46	-3.56	-6.53
円建外債 全体	-1.70	-0.31	-1.96	-7.90	-5.72	-10.60
AAA～A 格	-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
BBB 格	-2.70	-0.34	-2.35	-8.92	-5.18	-13.18

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、格付会社4社の最高格付をもとにNFRCで分類

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	-3.80	-0.43	-2.42	-8.87	-3.72	-13.30
AAA~BB格	-3.80	-0.43	-2.42	-8.87	-3.72	-13.30
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	-1.00	0.06	-1.76	-5.46	-3.56	-6.53
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	-1.70	-0.31	-1.96	-7.90	-5.72	-10.60
AAA~BB格	-1.70	-0.31	-1.96	-7.90	-5.72	-10.60
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	-2.70	-0.34	-2.35	-8.92	-5.18	-13.18
BB格	-	-	-	-	-	-
B格以下	-	-	-	-	-	-
格付なし	-	-	-	-	-	-

出所:NFRFC

- 月間投資収益率とは、前月末~今月末までの投資収益率を年率換算(%)
- 格付は、格付会社4社の最高格付をもとにNFRFCで分類
- 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	-3.81	-0.43	-2.43	-8.88	-3.72	-13.32
AAA~BB格	-3.80	-0.43	-2.42	-8.87	-3.72	-13.30
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	-2.82	-0.17	-2.20	-6.92	-3.60	-10.64
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	-1.70	-0.31	-1.96	-7.90	-5.72	-10.60
AAA~BB格	-1.70	-0.31	-1.96	-7.90	-5.72	-10.60
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	-1.85	-0.11	-1.75	-7.92	-5.29	-11.27
BB格	-	-	-	-	-	-
B格以下	-	-	-	-	-	-
格付なし	-	-	-	-	-	-

出所:NFRFC

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

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	-4.01	-0.48	-2.44	-9.23	-3.95	-13.59
AAA~BB 格	-4.01	-0.48	-2.44	-9.23	-3.95	-13.59
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	-0.96	0.23	-1.64	-4.17	-1.97	-6.53
BB 格	-	-	-	-	-	-
B 格以下	-	-	-	-	-	-
格付なし	-1.57	0.09	-2.22	-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	-0.99	0.02	-1.51	-7.16	-6.76	-8.26
AAA~BB 格	-0.99	0.02	-1.51	-7.16	-6.76	-8.26
AAA 格	-	-	-	-	-	-
AA 格	0.04	0.04	-	-	-	-
A 格	-0.93	0.02	-1.51	-6.76	-6.76	-
BBB 格	-8.26	-	-	-8.26	-	-8.26
BB 格	-	-	-	-	-	-
B 格以下	-	-	-	-	-	-
格付なし	-1.88	-0.40	-2.10	-7.99	-5.55	-10.76

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	-2.65	-0.37	-2.37	-6.34	-3.44	-10.23
AAA~BB 格	-2.65	-0.37	-2.37	-6.34	-3.44	-10.23
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	-1.10	0.14	-1.61	-5.46	-3.56	-6.53
BB 格	-	-	-	-	-	-
B 格以下	-	-	-	-	-	-
格付なし	-5.54	-0.55	-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	-1.33	-	-1.33	-	-	-
BB 格	-	-	-	-	-	-
B 格以下	-	-	-	-	-	-
格付なし	-1.58	-0.34	-2.06	-8.12	-6.58	-12.66

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	-3.23	-0.36	-2.37	-7.88	-3.51	-12.50
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	-1.83	-0.44	-1.98	-7.99	-5.80	-10.60
AAA~BB格	-1.83	-0.44	-1.98	-7.99	-5.80	-10.60
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	-2.12	-0.37	-1.80	-7.97	-4.76	-11.27
BB格	-	-	-	-	-	-
B格以下	-	-	-	-	-	-
格付なし	0.36	0.88	-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	-3.47	-0.41	-2.36	-8.42	-3.58	-12.60
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	-1.73	-0.34	-1.96	-7.92	-5.73	-10.60
AAA~BB格	-1.73	-0.34	-1.96	-7.92	-5.73	-10.60
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	-1.90	-0.12	-1.80	-7.92	-5.29	-11.27
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	1,146,370	96.27	96.45	10.19	0.81	0.98	0.95	8.68	8.62	8.63	4
短期 (1-3)	230,762	99.92	100.02	1.93	0.40	0.44	0.44	1.92	1.91	1.92	6
中期 (3-7)	311,595	100.37	100.53	4.78	0.65	0.58	0.58	4.70	4.69	4.70	5
長期 (7-)	604,013	92.75	92.98	16.13	1.05	1.43	1.37	13.67	13.56	13.58	4
長期 (7-11)	208,967	101.74	101.99	8.69	1.03	0.83	0.83	8.31	8.27	8.31	3
超長期 (11-)	395,047	88.00	88.21	20.07	1.07	1.79	1.69	16.95	16.80	16.80	4
(11-15)	95,797	96.28	96.47	12.92	0.97	1.29	1.27	12.10	12.02	12.08	4
(15-)	299,250	85.35	85.57	22.35	1.10	1.97	1.85	18.70	18.52	18.50	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	70,684	96.07	96.25	7.38	0.75	1.13	1.10	6.30	6.25	6.27	39
短期 (1-3)	21,132	99.49	99.60	1.97	0.47	0.74	0.74	1.96	1.95	1.96	35
中期 (3-7)	26,334	98.83	98.99	4.70	0.69	0.93	0.92	4.61	4.59	4.61	39
長期 (7-)	23,218	89.83	90.10	15.35	1.07	1.79	1.68	12.77	12.65	12.66	43
長期 (7-11)	9,848	98.37	98.64	8.67	1.06	1.29	1.27	8.27	8.22	8.27	47
超長期 (11-)	13,370	83.54	83.81	20.26	1.07	2.22	2.03	16.67	16.49	16.47	40
円建外債	3,596	99.17	99.49	3.80	1.09	1.32	1.32	3.61	3.58	3.61	81
短期 (1-3)	1,867	99.54	99.82	2.13	0.96	1.17	1.17	2.11	2.10	2.11	76
中期 (3-7)	1,370	98.89	99.17	4.14	1.05	1.33	1.32	4.04	4.01	4.04	81
長期 (7-)	359	98.37	98.99	11.20	1.92	2.13	2.11	9.84	9.73	9.81	109
長期 (7-11)	199	98.32	98.75	8.68	1.58	1.83	1.82	8.08	8.01	8.08	102
超長期 (11-)	160	98.43	99.29	14.35	2.35	2.50	2.47	12.03	11.88	11.96	117
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	1,132,419	96.28	96.47	10.22	0.82	0.98	0.95	8.70	8.64	8.65	4
短期 (1-3)	230,762	99.92	100.02	1.93	0.40	0.44	0.44	1.92	1.91	1.92	6
中期 (3-7)	311,595	100.37	100.53	4.78	0.65	0.58	0.58	4.70	4.69	4.70	5
長期 (7-)	590,062	92.70	92.93	16.34	1.06	1.44	1.37	13.83	13.73	13.73	3
長期 (7-11)	208,789	101.74	101.99	8.70	1.03	0.83	0.83	8.31	8.28	8.31	3
超長期 (11-)	381,273	87.75	87.97	20.52	1.08	1.83	1.71	17.34	17.18	17.18	3
(11-15)	95,797	96.28	96.47	12.92	0.97	1.29	1.27	12.10	12.02	12.08	4
(15-)	285,476	84.89	85.11	23.08	1.12	2.03	1.88	19.33	19.15	19.11	3
除く ABS	1,145,719	96.27	96.45	10.19	0.81	0.98	0.95	8.68	8.62	8.63	4
短期 (1-3)	230,588	99.93	100.02	1.93	0.40	0.44	0.44	1.92	1.91	1.92	5
中期 (3-7)	311,297	100.37	100.53	4.78	0.65	0.58	0.58	4.70	4.69	4.70	5
長期 (7-)	603,834	92.75	92.98	16.13	1.05	1.43	1.37	13.67	13.56	13.58	4
長期 (7-11)	208,865	101.74	101.99	8.69	1.03	0.83	0.83	8.31	8.27	8.31	3
超長期 (11-)	394,968	88.00	88.21	20.07	1.07	1.79	1.69	16.95	16.80	16.80	4
(11-15)	95,740	96.28	96.47	12.92	0.97	1.29	1.27	12.10	12.02	12.08	4
(15-)	299,229	85.35	85.57	22.35	1.10	1.97	1.85	18.70	18.52	18.50	4
除く MBS・ABS	1,131,768	96.28	96.47	10.22	0.82	0.98	0.95	8.70	8.64	8.65	4
短期 (1-3)	230,588	99.93	100.02	1.93	0.40	0.44	0.44	1.92	1.91	1.92	5
中期 (3-7)	311,297	100.37	100.53	4.78	0.65	0.58	0.58	4.70	4.69	4.70	5
長期 (7-)	589,882	92.70	92.93	16.34	1.06	1.44	1.37	13.84	13.73	13.73	3
長期 (7-11)	208,688	101.74	101.99	8.70	1.03	0.83	0.83	8.31	8.28	8.31	3
超長期 (11-)	381,194	87.75	87.97	20.53	1.08	1.83	1.71	17.34	17.19	17.18	3
(11-15)	95,740	96.28	96.47	12.92	0.97	1.29	1.27	12.10	12.02	12.08	4
(15-)	285,455	84.89	85.12	23.08	1.12	2.03	1.88	19.33	19.15	19.11	3
除く国債	173,428	96.61	96.77	7.34	0.68	0.98	1.00	6.53	6.49	6.53	25
短期 (1-3)	41,302	99.55	99.65	1.99	0.43	0.66	0.66	1.98	1.97	1.98	27
中期 (3-7)	58,188	99.08	99.22	4.75	0.61	0.79	0.79	4.68	4.66	4.68	25
長期 (7-)	73,938	93.03	93.23	12.37	0.89	1.33	1.38	10.80	10.72	10.79	24
長期 (7-11)	27,265	99.37	99.60	8.60	0.96	1.05	1.05	8.25	8.20	8.24	25
超長期 (11-)	46,673	89.33	89.51	14.57	0.85	1.52	1.60	12.46	12.35	12.45	23

出所:NFRC

- 「除く国債」とは、NOMURA-BPI/Extended 総合から国債を除いたポートフォリオ。
- 「除く MBS」とは、NOMURA-BPI/Extended 総合から MBS を除いたポートフォリオ。
- 「除く ABS」とは、NOMURA-BPI/Extended 総合から ABS を除いたポートフォリオ。
- 「除く MBS・ABS」とは、NOMURA-BPI/Extended 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	1,156,244	96.28	96.46	10.23	0.82	0.98	0.95	8.71	8.65	8.66	4
短期 (1-3)	230,591	99.92	100.02	1.95	0.41	0.44	0.44	1.94	1.94	1.94	6
中期 (3-7)	315,611	100.39	100.55	4.80	0.66	0.58	0.58	4.72	4.70	4.72	5
長期 (7-)	610,042	92.78	93.00	16.17	1.05	1.43	1.37	13.70	13.59	13.60	4
長期 (7-11)	211,567	101.67	101.92	8.72	1.02	0.83	0.84	8.34	8.30	8.34	3
超長期 (11-)	398,475	88.06	88.27	20.13	1.07	1.79	1.70	16.98	16.83	16.83	4
(11-15)	96,103	96.25	96.44	12.92	0.97	1.29	1.27	12.11	12.03	12.08	4
(15-)	302,372	85.46	85.67	22.41	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	71,165	96.09	96.27	7.41	0.75	1.14	1.10	6.33	6.28	6.30	39
短期 (1-3)	21,079	99.47	99.58	2.02	0.47	0.75	0.75	2.01	2.00	2.01	35
中期 (3-7)	26,893	98.82	98.98	4.74	0.69	0.93	0.93	4.66	4.63	4.66	39
長期 (7-)	23,193	89.86	90.13	15.40	1.08	1.79	1.68	12.81	12.69	12.70	43
長期 (7-11)	9,812	98.45	98.72	8.73	1.08	1.29	1.27	8.32	8.27	8.32	47
超長期 (11-)	13,381	83.56	83.84	20.28	1.08	2.23	2.03	16.68	16.51	16.49	40
円建外債	3,847	99.21	99.52	3.77	1.08	1.30	1.30	3.59	3.56	3.59	80
短期 (1-3)	2,071	99.58	99.85	2.21	0.96	1.15	1.15	2.18	2.17	2.18	75
中期 (3-7)	1,416	98.88	99.16	4.17	1.03	1.31	1.31	4.08	4.05	4.08	80
長期 (7-)	360	98.37	98.99	11.19	1.92	2.13	2.11	9.84	9.73	9.80	109
長期 (7-11)	204	98.38	98.82	8.72	1.60	1.84	1.83	8.11	8.04	8.10	103
超長期 (11-)	157	98.36	99.21	14.42	2.35	2.50	2.48	12.08	11.93	12.00	117
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	1,142,248	96.30	96.48	10.27	0.82	0.99	0.95	8.73	8.67	8.68	4
短期(1-3)	230,591	99.92	100.02	1.95	0.41	0.44	0.44	1.94	1.94	1.94	6
中期(3-7)	315,611	100.39	100.55	4.80	0.66	0.58	0.58	4.72	4.70	4.72	5
長期(7-)	596,046	92.73	92.96	16.38	1.06	1.44	1.37	13.86	13.75	13.76	3
長期(7-11)	211,389	101.68	101.92	8.73	1.02	0.83	0.84	8.34	8.31	8.34	3
超長期(11-)	384,657	87.81	88.03	20.58	1.09	1.83	1.71	17.37	17.21	17.20	3
(11-15)	96,103	96.25	96.44	12.92	0.97	1.29	1.27	12.11	12.03	12.08	4
(15-)	288,554	85.01	85.23	23.13	1.13	2.03	1.88	19.35	19.17	19.13	3
除く ABS	1,155,592	96.28	96.46	10.23	0.82	0.98	0.95	8.71	8.65	8.66	4
短期(1-3)	230,421	99.92	100.02	1.95	0.41	0.44	0.44	1.94	1.94	1.94	6
中期(3-7)	315,293	100.39	100.55	4.80	0.66	0.58	0.58	4.72	4.70	4.72	5
長期(7-)	609,877	92.78	93.01	16.17	1.05	1.43	1.37	13.70	13.59	13.60	4
長期(7-11)	211,481	101.68	101.92	8.72	1.02	0.83	0.84	8.34	8.30	8.34	3
超長期(11-)	398,396	88.06	88.27	20.13	1.07	1.79	1.70	16.98	16.83	16.83	4
(11-15)	96,045	96.26	96.45	12.92	0.97	1.29	1.27	12.11	12.03	12.08	4
(15-)	302,351	85.46	85.68	22.41	1.11	1.97	1.85	18.72	18.55	18.53	4
除く MBS・ABS	1,141,596	96.30	96.48	10.27	0.82	0.98	0.95	8.73	8.67	8.68	4
短期(1-3)	230,421	99.92	100.02	1.95	0.41	0.44	0.44	1.94	1.94	1.94	6
中期(3-7)	315,293	100.39	100.55	4.80	0.66	0.58	0.58	4.72	4.70	4.72	5
長期(7-)	595,881	92.73	92.96	16.38	1.06	1.44	1.37	13.86	13.75	13.76	3
長期(7-11)	211,303	101.68	101.93	8.73	1.02	0.83	0.84	8.34	8.31	8.34	3
超長期(11-)	384,578	87.82	88.03	20.58	1.09	1.83	1.71	17.37	17.21	17.20	3
(11-15)	96,045	96.26	96.45	12.92	0.97	1.29	1.27	12.11	12.03	12.08	4
(15-)	288,533	85.01	85.23	23.13	1.13	2.03	1.88	19.35	19.17	19.13	3
除く国債	174,247	96.63	96.78	7.39	0.69	0.99	1.00	6.57	6.53	6.57	25
短期(1-3)	41,293	99.53	99.63	2.05	0.43	0.67	0.67	2.04	2.03	2.04	27
中期(3-7)	59,021	99.06	99.20	4.81	0.61	0.80	0.79	4.73	4.71	4.73	26
長期(7-)	73,933	93.06	93.25	12.42	0.90	1.34	1.39	10.84	10.76	10.84	24
長期(7-11)	27,151	99.44	99.67	8.68	0.97	1.05	1.05	8.31	8.27	8.31	25
超長期(11-)	46,782	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/Extended 総合から国債を除いたポートフォリオ。
- 「除く MBS」とは、NOMURA-BPI/Extended 総合から MBS を除いたポートフォリオ。
- 「除く ABS」とは、NOMURA-BPI/Extended 総合から ABS を除いたポートフォリオ。
- 「除く MBS・ABS」とは、NOMURA-BPI/Extended 総合から MBS および ABS を除いたポートフォリオ。

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	70,684	96.07	96.25	7.38	0.75	1.13	1.10	6.30	6.25	6.27	39
短期 (1-3)	21,132	99.49	99.60	1.97	0.47	0.74	0.74	1.96	1.95	1.96	35
中期 (3-7)	26,334	98.83	98.99	4.70	0.69	0.93	0.92	4.61	4.59	4.61	39
長期 (7-)	23,218	89.83	90.10	15.35	1.07	1.79	1.68	12.77	12.65	12.66	43
長期 (7-11)	9,848	98.37	98.64	8.67	1.06	1.29	1.27	8.27	8.22	8.27	47
超長期 (11-)	13,370	83.54	83.81	20.26	1.07	2.22	2.03	16.67	16.49	16.47	40
水産・農林業	33	99.50	99.60	4.00	0.86	1.00	1.00	3.94	3.92	3.94	49
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	33	99.50	99.60	4.00	0.86	1.00	1.00	3.94	3.92	3.94	49
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	1,142	97.84	97.98	4.40	0.47	0.91	0.90	4.24	4.22	4.24	36
短期 (1-3)	456	99.14	99.24	2.29	0.33	0.74	0.74	2.28	2.27	2.28	33
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	1,429	97.93	98.03	4.75	0.49	0.92	0.90	4.52	4.50	4.52	34
短期 (1-3)	597	99.20	99.28	1.92	0.29	0.70	0.70	1.91	1.90	1.91	31
中期 (3-7)	512	98.24	98.33	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	329	96.60	96.73	4.95	0.44	1.09	1.07	4.66	4.63	4.66	49
短期 (1-3)	129	98.88	98.97	1.89	0.28	0.89	0.88	1.88	1.87	1.88	49
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	2,413	96.43	96.57	5.44	0.53	1.07	1.04	5.06	5.03	5.06	44
短期 (1-3)	752	99.20	99.28	2.07	0.34	0.74	0.74	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	728	96.25	96.34	5.93	0.50	1.05	1.02	5.57	5.53	5.56	40
短期 (1-3)	178	99.41	99.48	1.69	0.30	0.65	0.65	1.69	1.68	1.69	28
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	71,165	96.09	96.27	7.41	0.75	1.14	1.10	6.33	6.28	6.30	39
短期 (1-3)	21,079	99.47	99.58	2.02	0.47	0.75	0.75	2.01	2.00	2.01	35
中期 (3-7)	26,893	98.82	98.98	4.74	0.69	0.93	0.93	4.66	4.63	4.66	39
長期 (7-)	23,193	89.86	90.13	15.40	1.08	1.79	1.68	12.81	12.69	12.70	43
長期 (7-11)	9,812	98.45	98.72	8.73	1.08	1.29	1.27	8.32	8.27	8.32	47
超長期 (11-)	13,381	83.56	83.84	20.28	1.08	2.23	2.03	16.68	16.51	16.49	40
水産・農林業	33	99.50	99.60	4.00	0.86	1.00	1.00	3.94	3.92	3.94	49
短期 (1-3)	5	98.96	99.23	3.01	0.55	0.91	0.90	2.98	2.96	2.98	45
中期 (3-7)	28	99.59	99.67	4.18	0.91	1.01	1.01	4.11	4.09	4.11	50
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	1,260	98.02	98.16	4.44	0.52	0.92	0.91	4.28	4.26	4.28	38
短期 (1-3)	490	99.16	99.26	2.33	0.36	0.75	0.75	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	1,494	97.99	98.09	5.05	0.53	0.94	0.92	4.78	4.75	4.77	34
短期 (1-3)	592	99.21	99.28	1.95	0.29	0.70	0.70	1.95	1.94	1.95	31
中期 (3-7)	547	98.29	98.38	4.46	0.47	0.88	0.87	4.41	4.39	4.41	35
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	329	96.60	96.73	4.95	0.44	1.09	1.07	4.66	4.63	4.66	49
短期 (1-3)	129	98.88	98.97	1.89	0.28	0.89	0.88	1.88	1.87	1.88	49
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	2,403	96.42	96.56	5.45	0.53	1.07	1.04	5.08	5.04	5.07	44
短期 (1-3)	757	99.18	99.26	2.10	0.34	0.75	0.75	2.09	2.09	2.09	35
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	848	96.76	96.85	5.91	0.56	1.04	1.01	5.57	5.54	5.57	40
短期 (1-3)	178	99.41	99.48	1.69	0.30	0.65	0.65	1.69	1.68	1.69	28
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: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)

	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	262	96.58	96.73	5.41	0.51	1.06	1.03	5.08	5.04	5.07	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)	107	97.86	97.99	4.30	0.46	0.96	0.95	4.24	4.22	4.24	44
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	458	98.38	98.52	4.10	0.53	0.94	0.93	3.98	3.96	3.98	42
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)	245	98.35	98.50	4.30	0.57	0.95	0.95	4.24	4.22	4.24	43
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	380	98.29	98.42	4.19	0.47	0.92	0.92	4.10	4.08	4.10	40
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)	175	97.98	98.14	4.69	0.55	0.98	0.97	4.62	4.60	4.62	43
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	1,322	98.24	98.35	4.36	0.47	0.91	0.90	4.27	4.25	4.27	38
短期 (1-3)	505	99.07	99.15	2.12	0.30	0.75	0.74	2.11	2.11	2.11	35
中期 (3-7)	590	97.83	97.93	4.77	0.48	0.94	0.93	4.70	4.68	4.70	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	2,070	98.62	98.74	4.09	0.52	0.89	0.89	4.00	3.98	4.00	38
短期 (1-3)	755	99.27	99.35	1.94	0.34	0.72	0.71	1.93	1.92	1.93	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	1,150	97.61	97.72	4.34	0.43	0.94	0.93	4.16	4.14	4.16	40
短期 (1-3)	544	99.05	99.12	1.89	0.26	0.77	0.77	1.89	1.88	1.89	39
中期 (3-7)	397	97.91	98.02	4.57	0.48	0.93	0.92	4.51	4.49	4.51	39
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	282	96.81	96.96	5.55	0.54	1.05	1.03	5.22	5.19	5.22	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)	112	98.00	98.13	4.40	0.49	0.95	0.94	4.34	4.32	4.34	42
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	458	98.38	98.52	4.10	0.53	0.94	0.93	3.98	3.96	3.98	42
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)	245	98.35	98.50	4.30	0.57	0.95	0.95	4.24	4.22	4.24	43
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	380	98.29	98.42	4.19	0.47	0.92	0.92	4.10	4.08	4.10	40
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)	165	97.92	98.07	4.79	0.55	0.98	0.97	4.72	4.69	4.72	43
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	1,342	98.27	98.38	4.65	0.51	0.93	0.92	4.54	4.51	4.54	38
短期 (1-3)	460	99.02	99.10	2.23	0.31	0.76	0.76	2.22	2.21	2.22	35
中期 (3-7)	615	97.90	98.01	4.77	0.49	0.94	0.93	4.70	4.68	4.70	39
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	2,095	98.63	98.75	4.14	0.53	0.89	0.89	4.05	4.03	4.04	38
短期 (1-3)	810	99.23	99.32	2.06	0.35	0.73	0.73	2.05	2.05	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	1,165	97.64	97.75	4.41	0.44	0.95	0.93	4.22	4.20	4.22	40
短期 (1-3)	539	99.05	99.11	1.90	0.26	0.77	0.77	1.89	1.89	1.89	38
中期 (3-7)	407	97.95	98.06	4.58	0.48	0.92	0.91	4.52	4.50	4.52	39
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	195	95.44	95.57	6.71	0.53	1.11	1.08	6.28	6.24	6.28	38
短期 (1-3)	30	98.95	99.02	1.93	0.41	0.95	0.95	1.92	1.92	1.92	56
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	12,269	95.08	95.25	8.08	0.81	1.30	1.26	7.08	7.02	7.06	49
短期 (1-3)	2,686	99.47	99.58	2.10	0.48	0.74	0.74	2.08	2.08	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	6,080	90.63	90.81	13.19	1.02	1.48	1.37	10.02	9.93	9.90	36
短期 (1-3)	732	100.45	100.60	1.91	0.84	0.68	0.68	1.89	1.89	1.89	30
中期 (3-7)	1,728	100.62	100.80	4.96	1.06	0.87	0.88	4.83	4.81	4.83	34
長期 (7-)	3,620	83.88	84.07	19.40	1.03	2.02	1.81	14.97	14.81	14.74	38
長期 (7-11)	1,054	99.90	100.13	8.83	1.16	1.18	1.17	8.39	8.34	8.38	36
超長期 (11-)	2,566	77.29	77.47	23.75	0.98	2.46	2.16	18.46	18.25	18.12	40
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	159	95.76	95.88	6.37	0.61	1.24	1.21	6.06	6.02	6.05	56
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)	105	96.54	96.64	5.12	0.46	1.17	1.15	5.04	5.01	5.04	60
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	97.44	97.66	4.54	0.92	1.41	1.39	4.24	4.21	4.24	85
短期 (1-3)	963	99.35	99.50	1.98	0.72	1.08	1.08	1.97	1.96	1.97	69
中期 (3-7)	1,123	97.83	98.05	4.69	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	1,297	98.08	98.30	6.23	0.90	1.10	1.08	5.88	5.84	5.87	44
短期 (1-3)	203	100.21	100.48	1.91	0.93	0.82	0.82	1.89	1.89	1.89	44
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	195	95.44	95.57	6.71	0.53	1.11	1.08	6.28	6.24	6.28	38
短期 (1-3)	30	98.95	99.02	1.93	0.41	0.95	0.95	1.92	1.92	1.92	56
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	12,205	95.05	95.23	8.13	0.82	1.31	1.26	7.13	7.08	7.11	49
短期 (1-3)	2,670	99.44	99.55	2.16	0.48	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	6,692	89.90	90.09	13.77	1.02	1.51	1.39	10.35	10.26	10.22	35
短期 (1-3)	787	100.53	100.70	1.99	0.88	0.68	0.68	1.97	1.97	1.97	29
中期 (3-7)	1,848	100.55	100.72	4.99	1.04	0.87	0.88	4.86	4.84	4.86	33
長期 (7-)	4,057	82.99	83.19	20.06	1.04	2.06	1.84	15.35	15.19	15.11	38
長期 (7-11)	1,109	100.13	100.38	8.81	1.19	1.17	1.17	8.36	8.31	8.35	36
超長期 (11-)	2,948	76.54	76.73	24.29	0.98	2.50	2.17	18.79	18.58	18.43	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	159	95.76	95.88	6.37	0.61	1.24	1.21	6.06	6.02	6.05	56
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)	105	96.54	96.64	5.12	0.46	1.17	1.15	5.04	5.01	5.04	60
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	2,511	97.47	97.69	4.57	0.94	1.42	1.39	4.27	4.23	4.27	86
短期 (1-3)	970	99.36	99.51	2.05	0.75	1.10	1.10	2.03	2.02	2.03	70
中期 (3-7)	1,183	97.71	97.93	4.76	0.92	1.41	1.39	4.64	4.60	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	1,322	98.11	98.32	6.28	0.91	1.10	1.09	5.93	5.90	5.93	43
短期 (1-3)	193	100.22	100.49	2.01	0.96	0.83	0.83	1.99	1.98	1.99	44
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	1,279	98.75	98.96	3.89	0.61	0.94	0.93	3.75	3.73	3.75	43
短期 (1-3)	535	99.41	99.54	1.63	0.37	0.71	0.71	1.62	1.62	1.62	35
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	2,658	95.53	95.72	7.50	0.75	1.22	1.18	6.51	6.46	6.48	47
短期 (1-3)	570	99.60	99.70	2.23	0.58	0.81	0.81	2.22	2.21	2.22	40
中期 (3-7)	1,077	98.05	98.19	4.72	0.59	1.00	1.00	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	854	92.83	93.05	5.52	0.72	1.99	1.86	5.11	5.06	5.11	127
短期 (1-3)	242	97.69	97.80	2.09	0.38	1.53	1.51	2.08	2.06	2.08	111
中期 (3-7)	342	97.46	97.60	5.00	0.60	1.16	1.14	4.92	4.90	4.92	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	20,790	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	1,285	98.76	98.97	3.90	0.62	0.94	0.93	3.76	3.73	3.75	43
短期 (1-3)	535	99.41	99.54	1.63	0.37	0.71	0.71	1.62	1.62	1.62	35
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	2,658	95.53	95.72	7.50	0.75	1.22	1.18	6.51	6.46	6.48	47
短期 (1-3)	570	99.60	99.70	2.23	0.58	0.81	0.81	2.22	2.21	2.22	40
中期 (3-7)	1,092	97.99	98.13	4.75	0.59	1.01	1.00	4.67	4.65	4.67	47
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	864	92.91	93.13	5.51	0.73	1.99	1.86	5.11	5.05	5.10	127
短期 (1-3)	242	97.69	97.80	2.09	0.38	1.53	1.51	2.08	2.06	2.08	111
中期 (3-7)	352	97.53	97.66	5.00	0.63	1.17	1.15	4.92	4.89	4.92	60
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)
事業債・円建外債 全体	74,279	96.22	96.41	7.21	0.76	1.14	1.11	6.16	6.12	6.13	41
短期 (1-3)	22,999	99.49	99.62	1.98	0.51	0.78	0.78	1.97	1.96	1.97	39
中期 (3-7)	27,704	98.83	99.00	4.67	0.70	0.95	0.94	4.58	4.56	4.58	41
長期 (7-)	23,576	89.96	90.24	15.28	1.08	1.79	1.68	12.72	12.60	12.61	44
長期 (7-11)	10,047	98.37	98.64	8.67	1.07	1.30	1.28	8.27	8.21	8.26	48
超長期 (11-)	13,530	83.71	83.99	20.19	1.09	2.23	2.03	16.60	16.43	16.41	41
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 ~ 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 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	982	98.50	98.84	4.26	0.97	1.31	1.29	3.99	3.96	3.98	77
短期 (1-3)	443	99.45	99.72	1.87	0.80	1.13	1.12	1.85	1.84	1.85	74
中期 (3-7)	428	98.63	98.98	4.63	0.99	1.28	1.28	4.51	4.48	4.51	75
長期 (7-)	111	94.19	94.82	12.35	1.57	2.15	2.08	10.89	10.77	10.84	96
長期 (7-11)	52	98.50	99.14	8.87	1.56	1.77	1.76	8.25	8.18	8.24	94
超長期 (11-)	59	90.38	90.99	15.42	1.58	2.51	2.40	13.43	13.27	13.35	98

出所:NFRC

- 格付は、格付会社4社の最高格付をもとに NFRC で分類

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)
事業債・円建外債 全体	75,012	96.25	96.44	7.22	0.77	1.15	1.11	6.19	6.14	6.15	41
短期 (1-3)	23,150	99.48	99.61	2.03	0.51	0.78	0.78	2.02	2.01	2.02	39
中期 (3-7)	28,309	98.82	98.99	4.72	0.71	0.95	0.94	4.63	4.60	4.63	41
長期 (7-)	23,553	89.99	90.27	15.33	1.09	1.80	1.69	12.76	12.64	12.65	44
長期 (7-11)	10,015	98.45	98.72	8.73	1.09	1.30	1.29	8.32	8.26	8.31	48
超長期 (11-)	13,538	83.73	84.01	20.22	1.09	2.23	2.04	16.62	16.44	16.43	41
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~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 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	974	98.49	98.84	4.30	0.98	1.31	1.30	4.03	4.00	4.03	77
短期 (1-3)	435	99.44	99.72	1.91	0.81	1.13	1.13	1.89	1.88	1.89	74
中期 (3-7)	428	98.64	98.98	4.65	1.00	1.29	1.28	4.53	4.50	4.53	75
長期 (7-)	111	94.19	94.82	12.35	1.57	2.15	2.08	10.89	10.77	10.84	96
長期 (7-11)	52	98.50	99.14	8.87	1.56	1.77	1.76	8.25	8.18	8.24	94
超長期 (11-)	59	90.38	90.99	15.42	1.58	2.51	2.40	13.43	13.27	13.35	98

出所:NFRC

- 格付は、格付会社4社の最高格付をもとにNFRCで分類

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	70,684	96.07	96.25	7.38	0.75	1.13	1.10	6.30	6.25	6.27	39
短期(1-3)	21,132	99.49	99.60	1.97	0.47	0.74	0.74	1.96	1.95	1.96	35
中期(3-7)	26,334	98.83	98.99	4.70	0.69	0.93	0.92	4.61	4.59	4.61	39
長期(7-)	23,218	89.83	90.10	15.35	1.07	1.79	1.68	12.77	12.65	12.66	43
長期(7-11)	9,848	98.37	98.64	8.67	1.06	1.29	1.27	8.27	8.22	8.27	47
超長期(11-)	13,370	83.54	83.81	20.26	1.07	2.22	2.03	16.67	16.49	16.47	40
AAA~BB格	70,684	96.07	96.25	7.38	0.75	1.13	1.10	6.30	6.25	6.27	39
短期(1-3)	21,132	99.49	99.60	1.97	0.47	0.74	0.74	1.96	1.95	1.96	35
中期(3-7)	26,334	98.83	98.99	4.70	0.69	0.93	0.92	4.61	4.59	4.61	39
長期(7-)	23,218	89.83	90.10	15.35	1.07	1.79	1.68	12.77	12.65	12.66	43
長期(7-11)	9,848	98.37	98.64	8.67	1.06	1.29	1.27	8.27	8.22	8.27	47
超長期(11-)	13,370	83.54	83.81	20.26	1.07	2.22	2.03	16.67	16.49	16.47	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	512	97.98	98.17	3.53	0.74	1.23	1.21	3.37	3.35	3.37	74
短期(1-3)	265	99.25	99.46	1.82	0.73	1.15	1.15	1.80	1.79	1.80	77
中期(3-7)	217	97.82	98.00	4.42	0.73	1.22	1.20	4.34	4.31	4.34	68
長期(7-)	30	87.88	88.11	12.24	0.88	2.06	1.93	11.29	11.18	11.27	79
長期(7-11)	10	95.18	95.39	7.74	0.77	1.47	1.43	7.50	7.45	7.50	73
超長期(11-)	20	84.22	84.47	14.49	0.93	2.40	2.21	13.43	13.28	13.40	83
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NFRCで分類

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	71,165	96.09	96.27	7.41	0.75	1.14	1.10	6.33	6.28	6.30	39
短期 (1-3)	21,079	99.47	99.58	2.02	0.47	0.75	0.75	2.01	2.00	2.01	35
中期 (3-7)	26,893	98.82	98.98	4.74	0.69	0.93	0.93	4.66	4.63	4.66	39
長期 (7-)	23,193	89.86	90.13	15.40	1.08	1.79	1.68	12.81	12.69	12.70	43
長期 (7-11)	9,812	98.45	98.72	8.73	1.08	1.29	1.27	8.32	8.27	8.32	47
超長期 (11-)	13,381	83.56	83.84	20.28	1.08	2.23	2.03	16.68	16.51	16.49	40
AAA~BB 格	71,165	96.09	96.27	7.41	0.75	1.14	1.10	6.33	6.28	6.30	39
短期 (1-3)	21,079	99.47	99.58	2.02	0.47	0.75	0.75	2.01	2.00	2.01	35
中期 (3-7)	26,893	98.82	98.98	4.74	0.69	0.93	0.93	4.66	4.63	4.66	39
長期 (7-)	23,193	89.86	90.13	15.40	1.08	1.79	1.68	12.81	12.69	12.70	43
長期 (7-11)	9,812	98.45	98.72	8.73	1.08	1.29	1.27	8.32	8.27	8.32	47
超長期 (11-)	13,381	83.56	83.84	20.28	1.08	2.23	2.03	16.68	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	504	97.96	98.15	3.61	0.75	1.24	1.22	3.45	3.42	3.45	74
短期 (1-3)	257	99.23	99.44	1.88	0.74	1.16	1.16	1.86	1.85	1.86	77
中期 (3-7)	217	97.84	98.02	4.47	0.75	1.23	1.22	4.38	4.35	4.38	69
長期 (7-)	30	87.88	88.11	12.24	0.88	2.06	1.93	11.29	11.18	11.27	79
長期 (7-11)	10	95.18	95.39	7.74	0.77	1.47	1.43	7.50	7.45	7.50	73
超長期 (11-)	20	84.22	84.47	14.49	0.93	2.40	2.21	13.43	13.28	13.40	83
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NFRCで分類

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	70,444	96.05	96.24	7.39	0.74	1.13	1.09	6.30	6.26	6.27	39
短期(1-3)	21,132	99.49	99.60	1.97	0.47	0.74	0.74	1.96	1.95	1.96	35
中期(3-7)	26,119	98.81	98.96	4.70	0.67	0.92	0.91	4.61	4.59	4.61	38
長期(7-)	23,193	89.83	90.10	15.35	1.07	1.79	1.67	12.77	12.65	12.66	43
長期(7-11)	9,848	98.37	98.64	8.67	1.06	1.29	1.27	8.27	8.22	8.27	47
超長期(11-)	13,345	83.52	83.79	20.27	1.07	2.22	2.03	16.67	16.50	16.48	40
AAA~BB格	70,684	96.07	96.25	7.38	0.75	1.13	1.10	6.30	6.25	6.27	39
短期(1-3)	21,132	99.49	99.60	1.97	0.47	0.74	0.74	1.96	1.95	1.96	35
中期(3-7)	26,334	98.83	98.99	4.70	0.69	0.93	0.92	4.61	4.59	4.61	39
長期(7-)	23,218	89.83	90.10	15.35	1.07	1.79	1.68	12.77	12.65	12.66	43
長期(7-11)	9,848	98.37	98.64	8.67	1.06	1.29	1.27	8.27	8.22	8.27	47
超長期(11-)	13,370	83.54	83.81	20.26	1.07	2.22	2.03	16.67	16.49	16.47	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	2,519	96.33	96.52	6.29	0.73	1.23	1.19	5.65	5.61	5.64	54
短期(1-3)	668	99.05	99.19	1.96	0.52	1.00	1.00	1.95	1.94	1.95	61
中期(3-7)	1,181	98.57	98.74	4.60	0.70	1.03	1.02	4.52	4.49	4.52	50
長期(7-)	671	89.69	89.94	13.57	0.99	1.85	1.74	11.91	11.80	11.85	56
長期(7-11)	328	97.14	97.39	8.58	1.00	1.41	1.38	8.22	8.16	8.22	59
超長期(11-)	343	82.56	82.80	18.35	0.99	2.35	2.14	16.06	15.89	15.95	54
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NFRCで分類

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	70,925	96.08	96.26	7.41	0.75	1.13	1.10	6.34	6.29	6.30	39
短期 (1-3)	21,079	99.47	99.58	2.02	0.47	0.75	0.75	2.01	2.00	2.01	35
中期 (3-7)	26,678	98.80	98.95	4.75	0.68	0.92	0.92	4.66	4.64	4.66	38
長期 (7-)	23,168	89.86	90.13	15.40	1.08	1.79	1.68	12.81	12.69	12.70	43
長期 (7-11)	9,812	98.45	98.72	8.73	1.08	1.29	1.27	8.32	8.27	8.32	47
超長期 (11-)	13,356	83.55	83.82	20.29	1.08	2.22	2.03	16.69	16.51	16.50	40
AAA~BB 格	71,165	96.09	96.27	7.41	0.75	1.14	1.10	6.33	6.28	6.30	39
短期 (1-3)	21,079	99.47	99.58	2.02	0.47	0.75	0.75	2.01	2.00	2.01	35
中期 (3-7)	26,893	98.82	98.98	4.74	0.69	0.93	0.93	4.66	4.63	4.66	39
長期 (7-)	23,193	89.86	90.13	15.40	1.08	1.79	1.68	12.81	12.69	12.70	43
長期 (7-11)	9,812	98.45	98.72	8.73	1.08	1.29	1.27	8.32	8.27	8.32	47
超長期 (11-)	13,381	83.56	83.84	20.28	1.08	2.23	2.03	16.68	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	2,279	96.13	96.33	6.50	0.76	1.27	1.23	5.81	5.77	5.79	57
短期 (1-3)	590	99.03	99.18	2.01	0.56	1.05	1.04	2.00	1.99	2.00	65
中期 (3-7)	1,051	98.60	98.78	4.62	0.73	1.05	1.05	4.53	4.51	4.53	52
長期 (7-)	639	89.39	89.65	13.73	0.99	1.88	1.76	12.02	11.91	11.97	58
長期 (7-11)	306	96.81	97.08	8.59	0.98	1.43	1.40	8.23	8.17	8.22	61
超長期 (11-)	333	82.57	82.82	18.46	1.00	2.36	2.15	16.12	15.94	16.00	54
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 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)

	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	64,621	95.98	96.16	7.60	0.75	1.13	1.09	6.45	6.40	6.42	37
短期 (1-3)	19,117	99.51	99.63	1.98	0.46	0.72	0.72	1.97	1.96	1.97	33
中期 (3-7)	23,565	98.94	99.10	4.71	0.69	0.91	0.90	4.62	4.60	4.62	37
長期 (7-)	21,939	89.72	89.99	15.62	1.07	1.78	1.67	12.94	12.82	12.83	41
長期 (7-11)	9,081	98.56	98.81	8.70	1.05	1.24	1.23	8.30	8.25	8.30	43
超長期 (11-)	12,858	83.48	83.76	20.51	1.08	2.22	2.03	16.81	16.63	16.61	38
AAA~BB 格	64,621	95.98	96.16	7.60	0.75	1.13	1.09	6.45	6.40	6.42	37
短期 (1-3)	19,117	99.51	99.63	1.98	0.46	0.72	0.72	1.97	1.96	1.97	33
中期 (3-7)	23,565	98.94	99.10	4.71	0.69	0.91	0.90	4.62	4.60	4.62	37
長期 (7-)	21,939	89.72	89.99	15.62	1.07	1.78	1.67	12.94	12.82	12.83	41
長期 (7-11)	9,081	98.56	98.81	8.70	1.05	1.24	1.23	8.30	8.25	8.30	43
超長期 (11-)	12,858	83.48	83.76	20.51	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	570	97.35	97.57	3.75	0.82	1.45	1.43	3.58	3.55	3.58	94
短期 (1-3)	251	98.91	99.14	1.85	0.77	1.36	1.35	1.83	1.82	1.83	97
中期 (3-7)	277	97.72	97.91	4.42	0.84	1.36	1.35	4.33	4.30	4.32	83
長期 (7-)	41	85.35	85.62	10.87	0.93	2.84	2.60	10.18	10.06	10.17	159
長期 (7-11)	21	86.42	86.73	7.42	0.93	3.25	2.97	7.17	7.07	7.17	229
超長期 (11-)	20	84.22	84.47	14.49	0.93	2.40	2.21	13.43	13.28	13.40	83
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	6,063	97.03	97.20	4.98	0.70	1.22	1.19	4.69	4.66	4.69	62
短期 (1-3)	2,015	99.22	99.34	1.86	0.58	0.98	0.98	1.85	1.84	1.85	60
中期 (3-7)	2,770	97.90	98.04	4.62	0.62	1.08	1.07	4.54	4.52	4.54	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	64,940	96.00	96.18	7.64	0.76	1.13	1.09	6.49	6.44	6.45	37
短期 (1-3)	18,998	99.50	99.61	2.03	0.46	0.72	0.72	2.02	2.01	2.02	33
中期 (3-7)	24,031	98.92	99.09	4.75	0.70	0.91	0.91	4.66	4.64	4.66	37
長期 (7-)	21,912	89.75	90.02	15.67	1.08	1.78	1.67	12.98	12.86	12.87	40
長期 (7-11)	9,043	98.63	98.89	8.77	1.07	1.25	1.24	8.35	8.30	8.35	43
超長期 (11-)	12,869	83.51	83.78	20.53	1.09	2.22	2.03	16.82	16.64	16.62	38
AAA~BB 格	64,940	96.00	96.18	7.64	0.76	1.13	1.09	6.49	6.44	6.45	37
短期 (1-3)	18,998	99.50	99.61	2.03	0.46	0.72	0.72	2.02	2.01	2.02	33
中期 (3-7)	24,031	98.92	99.09	4.75	0.70	0.91	0.91	4.66	4.64	4.66	37
長期 (7-)	21,912	89.75	90.02	15.67	1.08	1.78	1.67	12.98	12.86	12.87	40
長期 (7-11)	9,043	98.63	98.89	8.77	1.07	1.25	1.24	8.35	8.30	8.35	43
超長期 (11-)	12,869	83.51	83.78	20.53	1.09	2.22	2.03	16.82	16.64	16.62	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	554	97.29	97.50	3.81	0.82	1.46	1.43	3.64	3.61	3.63	94
短期 (1-3)	241	98.87	99.09	1.89	0.76	1.36	1.35	1.87	1.86	1.87	97
中期 (3-7)	272	97.70	97.89	4.45	0.85	1.37	1.36	4.35	4.32	4.35	83
長期 (7-)	41	85.35	85.62	10.87	0.93	2.84	2.60	10.18	10.06	10.17	159
長期 (7-11)	21	86.42	86.73	7.42	0.93	3.25	2.97	7.17	7.07	7.17	229
超長期 (11-)	20	84.22	84.47	14.49	0.93	2.40	2.21	13.43	13.28	13.40	83
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	6,224	97.10	97.27	4.98	0.71	1.22	1.19	4.70	4.67	4.70	62
短期 (1-3)	2,081	99.25	99.37	1.90	0.59	0.98	0.98	1.88	1.87	1.88	60
中期 (3-7)	2,862	97.94	98.07	4.67	0.63	1.08	1.07	4.59	4.57	4.59	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	42,365	96.73	96.89	5.85	0.64	1.09	1.06	5.27	5.24	5.26	44
短期 (1-3)	13,992	99.35	99.45	1.95	0.41	0.76	0.75	1.94	1.93	1.94	37
中期 (3-7)	17,558	98.32	98.47	4.69	0.61	0.96	0.96	4.61	4.59	4.61	42
長期 (7-)	10,815	90.77	91.01	12.80	0.99	1.78	1.68	11.15	11.05	11.10	58
長期 (7-11)	5,825	96.95	97.20	8.60	0.99	1.40	1.37	8.22	8.17	8.22	58
超長期 (11-)	4,990	83.56	83.79	17.70	1.00	2.29	2.09	15.12	14.96	15.00	59
AAA～BB 格	42,365	96.73	96.89	5.85	0.64	1.09	1.06	5.27	5.24	5.26	44
短期 (1-3)	13,992	99.35	99.45	1.95	0.41	0.76	0.75	1.94	1.93	1.94	37
中期 (3-7)	17,558	98.32	98.47	4.69	0.61	0.96	0.96	4.61	4.59	4.61	42
長期 (7-)	10,815	90.77	91.01	12.80	0.99	1.78	1.68	11.15	11.05	11.10	58
長期 (7-11)	5,825	96.95	97.20	8.60	0.99	1.40	1.37	8.22	8.17	8.22	58
超長期 (11-)	4,990	83.56	83.79	17.70	1.00	2.29	2.09	15.12	14.96	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	276	97.60	97.81	3.84	0.76	1.26	1.24	3.59	3.57	3.59	74
短期 (1-3)	138	99.25	99.46	1.70	0.74	1.16	1.16	1.68	1.67	1.68	80
中期 (3-7)	108	98.19	98.41	4.24	0.75	1.18	1.17	4.16	4.14	4.16	66
長期 (7-)	30	87.88	88.11	12.24	0.88	2.06	1.93	11.29	11.18	11.27	79
長期 (7-11)	10	95.18	95.39	7.74	0.77	1.47	1.43	7.50	7.45	7.50	73
超長期 (11-)	20	84.22	84.47	14.49	0.93	2.40	2.21	13.43	13.28	13.40	83
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	28,318	95.08	95.30	9.66	0.90	1.21	1.16	7.86	7.79	7.79	31
短期 (1-3)	7,140	99.76	99.90	2.02	0.58	0.72	0.72	2.01	2.00	2.01	33
中期 (3-7)	8,776	99.85	100.04	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	42,537	96.74	96.89	5.89	0.65	1.09	1.06	5.31	5.27	5.30	44
短期 (1-3)	13,976	99.33	99.43	2.00	0.41	0.76	0.76	1.99	1.98	1.99	37
中期 (3-7)	17,799	98.30	98.45	4.74	0.62	0.97	0.96	4.66	4.63	4.66	43
長期 (7-)	10,763	90.80	91.04	12.84	1.00	1.78	1.68	11.19	11.09	11.13	58
長期 (7-11)	5,773	97.06	97.31	8.65	1.01	1.40	1.38	8.26	8.21	8.26	58
超長期 (11-)	4,990	83.56	83.79	17.70	1.00	2.29	2.09	15.12	14.96	15.00	59
AAA~BB 格	42,537	96.74	96.89	5.89	0.65	1.09	1.06	5.31	5.27	5.30	44
短期 (1-3)	13,976	99.33	99.43	2.00	0.41	0.76	0.76	1.99	1.98	1.99	37
中期 (3-7)	17,799	98.30	98.45	4.74	0.62	0.97	0.96	4.66	4.63	4.66	43
長期 (7-)	10,763	90.80	91.04	12.84	1.00	1.78	1.68	11.19	11.09	11.13	58
長期 (7-11)	5,773	97.06	97.31	8.65	1.01	1.40	1.38	8.26	8.21	8.26	58
超長期 (11-)	4,990	83.56	83.79	17.70	1.00	2.29	2.09	15.12	14.96	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	273	97.58	97.79	3.94	0.78	1.27	1.25	3.69	3.66	3.69	75
短期 (1-3)	130	99.23	99.43	1.74	0.75	1.17	1.17	1.72	1.71	1.72	80
中期 (3-7)	113	98.26	98.48	4.27	0.78	1.19	1.18	4.19	4.16	4.19	67
長期 (7-)	30	87.88	88.11	12.24	0.88	2.06	1.93	11.29	11.18	11.27	79
長期 (7-11)	10	95.18	95.39	7.74	0.77	1.47	1.43	7.50	7.45	7.50	73
超長期 (11-)	20	84.22	84.47	14.49	0.93	2.40	2.21	13.43	13.28	13.40	83
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	28,627	95.13	95.35	9.66	0.91	1.21	1.16	7.87	7.81	7.81	31
短期 (1-3)	7,104	99.75	99.90	2.06	0.59	0.73	0.72	2.04	2.04	2.04	33
中期 (3-7)	9,094	99.82	100.01	4.75	0.83	0.86	0.86	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	44,382	95.99	96.16	6.73	0.71	1.16	1.12	5.80	5.75	5.77	46
短期 (1-3)	13,930	99.41	99.53	1.96	0.49	0.81	0.80	1.94	1.94	1.94	42
中期 (3-7)	17,383	98.47	98.62	4.72	0.66	0.99	0.98	4.64	4.61	4.64	45
長期 (7-)	13,068	89.06	89.29	14.48	1.00	1.83	1.70	12.08	11.97	11.99	53
長期 (7-11)	6,162	97.44	97.68	8.59	1.04	1.38	1.36	8.20	8.15	8.20	57
超長期 (11-)	6,906	81.59	81.79	19.74	0.97	2.30	2.07	16.22	16.04	16.02	49

出所:NFRFC

- 格付は、Moody's の格付をもとに NFRFC で分類

事業債 Moody's 格付別・ポートフォリオ指標 (2024年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											
短期 (1-3)	24,274	96.18	96.39	8.63	0.81	1.08	1.05	7.24	7.19	7.20	26
中期 (3-7)	6,846	99.64	99.74	2.04	0.44	0.62	0.62	2.03	2.02	2.03	23
長期 (7-)	7,949	99.53	99.69	4.69	0.70	0.77	0.77	4.61	4.59	4.61	24
長期 (7-11)	9,479	90.88	91.21	16.69	1.17	1.74	1.64	13.77	13.65	13.65	29
超長期 (11-)	3,344	100.20	100.51	8.85	1.13	1.12	1.12	8.41	8.36	8.41	30
	6,135	85.80	86.14	20.96	1.20	2.13	1.97	17.18	17.01	16.99	29
AAA~BBB 格											
短期 (1-3)	26,127	96.19	96.40	8.54	0.82	1.10	1.06	7.19	7.14	7.15	28
中期 (3-7)	7,116	99.62	99.72	2.04	0.43	0.63	0.63	2.03	2.03	2.03	23
長期 (7-)	8,910	99.54	99.70	4.69	0.73	0.81	0.81	4.60	4.58	4.60	28
長期 (7-11)	10,102	90.81	91.14	16.52	1.16	1.74	1.64	13.67	13.55	13.56	31
超長期 (11-)	3,629	99.99	100.30	8.84	1.12	1.13	1.13	8.40	8.35	8.40	31
	6,473	85.67	86.01	20.83	1.19	2.15	1.98	17.12	16.95	16.93	30
AAA~BB 格											
短期 (1-3)	26,127	96.19	96.40	8.54	0.82	1.10	1.06	7.19	7.14	7.15	28
中期 (3-7)	7,116	99.62	99.72	2.04	0.43	0.63	0.63	2.03	2.03	2.03	23
長期 (7-)	8,910	99.54	99.70	4.69	0.73	0.81	0.81	4.60	4.58	4.60	28
長期 (7-11)	10,102	90.81	91.14	16.52	1.16	1.74	1.64	13.67	13.55	13.56	31
超長期 (11-)	3,629	99.99	100.30	8.84	1.12	1.13	1.13	8.40	8.35	8.40	31
	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											
短期 (1-3)	24,274	96.18	96.39	8.63	0.81	1.08	1.05	7.24	7.19	7.20	26
中期 (3-7)	6,846	99.64	99.74	2.04	0.44	0.62	0.62	2.03	2.02	2.03	23
長期 (7-)	7,949	99.53	99.69	4.69	0.70	0.77	0.77	4.61	4.59	4.61	24
長期 (7-11)	9,479	90.88	91.21	16.69	1.17	1.74	1.64	13.77	13.65	13.65	29
超長期 (11-)	3,344	100.20	100.51	8.85	1.13	1.12	1.12	8.41	8.36	8.41	30
	6,135	85.80	86.14	20.96	1.20	2.13	1.97	17.18	17.01	16.99	29
BBB 格											
短期 (1-3)	1,854	96.23	96.48	7.41	0.94	1.30	1.26	6.56	6.51	6.54	54
中期 (3-7)	270	99.17	99.25	2.13	0.33	0.72	0.71	2.12	2.11	2.12	31
長期 (7-)	961	99.56	99.83	4.63	1.03	1.13	1.13	4.52	4.49	4.52	60
長期 (7-11)	623	89.82	90.11	13.99	1.05	1.86	1.75	12.17	12.06	12.11	55
超長期 (11-)	285	97.57	97.85	8.67	0.98	1.31	1.30	8.30	8.24	8.29	50
	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											
短期 (1-3)	45,038	96.04	96.20	6.75	0.71	1.16	1.12	5.83	5.79	5.80	46
中期 (3-7)	13,964	99.40	99.51	2.00	0.49	0.81	0.81	1.99	1.98	1.99	41
長期 (7-)	17,983	98.46	98.62	4.77	0.67	0.99	0.99	4.68	4.66	4.68	45
長期 (7-11)	13,091	89.12	89.35	14.53	1.01	1.83	1.71	12.12	12.01	12.03	53
超長期 (11-)	6,183	97.54	97.79	8.67	1.06	1.38	1.36	8.27	8.21	8.27	56
	6,908	81.59	81.80	19.78	0.97	2.30	2.08	16.25	16.07	16.05	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	53,908	96.43	96.61	6.93	0.74	1.14	1.11	6.01	5.97	5.98	42
短期 (1-3)	17,049	99.41	99.52	1.97	0.47	0.77	0.77	1.96	1.96	1.96	38
中期 (3-7)	20,392	98.69	98.84	4.65	0.68	0.95	0.94	4.57	4.54	4.57	41
長期 (7-)	16,467	90.55	90.84	14.87	1.10	1.82	1.71	12.55	12.43	12.46	48
長期 (7-11)	7,097	97.81	98.08	8.70	1.06	1.36	1.34	8.29	8.24	8.29	54
超長期 (11-)	9,369	85.05	85.35	19.54	1.13	2.21	2.04	16.26	16.09	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	54,349	96.45	96.64	6.96	0.75	1.14	1.11	6.05	6.00	6.02	42
短期 (1-3)	16,992	99.39	99.50	2.03	0.47	0.78	0.78	2.01	2.01	2.01	38
中期 (3-7)	20,913	98.68	98.83	4.70	0.68	0.95	0.95	4.62	4.59	4.62	42
長期 (7-)	16,444	90.59	90.88	14.92	1.11	1.82	1.72	12.59	12.47	12.50	48
長期 (7-11)	7,053	97.93	98.20	8.76	1.08	1.37	1.35	8.34	8.29	8.34	54
超長期 (11-)	9,390	85.08	85.38	19.55	1.13	2.21	2.04	16.26	16.09	16.09	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	3,596	99.17	99.49	3.80	1.09	1.32	1.32	3.61	3.58	3.61	81
短期 (1-3)	1,867	99.54	99.82	2.13	0.96	1.17	1.17	2.11	2.10	2.11	76
中期 (3-7)	1,370	98.89	99.17	4.14	1.05	1.33	1.32	4.04	4.01	4.04	81
長期 (7-)	359	98.37	98.99	11.20	1.92	2.13	2.11	9.84	9.73	9.81	109
長期 (7-11)	199	98.32	98.75	8.68	1.58	1.83	1.82	8.08	8.01	8.08	102
超長期 (11-)	160	98.43	99.29	14.35	2.35	2.50	2.47	12.03	11.88	11.96	117
AAA～BB格	3,596	99.17	99.49	3.80	1.09	1.32	1.32	3.61	3.58	3.61	81
短期 (1-3)	1,867	99.54	99.82	2.13	0.96	1.17	1.17	2.11	2.10	2.11	76
中期 (3-7)	1,370	98.89	99.17	4.14	1.05	1.33	1.32	4.04	4.01	4.04	81
長期 (7-)	359	98.37	98.99	11.20	1.92	2.13	2.11	9.84	9.73	9.81	109
長期 (7-11)	199	98.32	98.75	8.68	1.58	1.83	1.82	8.08	8.01	8.08	102
超長期 (11-)	160	98.43	99.29	14.35	2.35	2.50	2.47	12.03	11.88	11.96	117
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	471	99.06	99.57	5.04	1.22	1.39	1.38	4.65	4.61	4.64	80
短期 (1-3)	178	99.74	100.12	1.95	0.91	1.08	1.08	1.92	1.91	1.92	69
中期 (3-7)	211	99.46	99.98	4.85	1.25	1.35	1.35	4.68	4.65	4.68	81
長期 (7-)	81	96.53	97.30	12.39	1.82	2.18	2.14	10.75	10.64	10.70	101
長期 (7-11)	42	99.29	100.04	9.14	1.74	1.84	1.83	8.42	8.34	8.41	99
超長期 (11-)	39	93.55	94.35	15.90	1.91	2.56	2.49	13.43	13.27	13.33	104
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、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	3,847	99.21	99.52	3.77	1.08	1.30	1.30	3.59	3.56	3.59	80
短期 (1-3)	2,071	99.58	99.85	2.21	0.96	1.15	1.15	2.18	2.17	2.18	75
中期 (3-7)	1,416	98.88	99.16	4.17	1.03	1.31	1.31	4.08	4.05	4.08	80
長期 (7-)	360	98.37	98.99	11.19	1.92	2.13	2.11	9.84	9.73	9.80	109
長期 (7-11)	204	98.38	98.82	8.72	1.60	1.84	1.83	8.11	8.04	8.10	103
超長期 (11-)	157	98.36	99.21	14.42	2.35	2.50	2.48	12.08	11.93	12.00	117
AAA~BB 格	3,847	99.21	99.52	3.77	1.08	1.30	1.30	3.59	3.56	3.59	80
短期 (1-3)	2,071	99.58	99.85	2.21	0.96	1.15	1.15	2.18	2.17	2.18	75
中期 (3-7)	1,416	98.88	99.16	4.17	1.03	1.31	1.31	4.08	4.05	4.08	80
長期 (7-)	360	98.37	98.99	11.19	1.92	2.13	2.11	9.84	9.73	9.80	109
長期 (7-11)	204	98.38	98.82	8.72	1.60	1.84	1.83	8.11	8.04	8.10	103
超長期 (11-)	157	98.36	99.21	14.42	2.35	2.50	2.48	12.08	11.93	12.00	117
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	471	99.06	99.57	5.04	1.22	1.39	1.38	4.65	4.61	4.64	80
短期 (1-3)	178	99.74	100.12	1.95	0.91	1.08	1.08	1.92	1.91	1.92	69
中期 (3-7)	211	99.46	99.98	4.85	1.25	1.35	1.35	4.68	4.65	4.68	81
長期 (7-)	81	96.53	97.30	12.39	1.82	2.18	2.14	10.75	10.64	10.70	101
長期 (7-11)	42	99.29	100.04	9.14	1.74	1.84	1.83	8.42	8.34	8.41	99
超長期 (11-)	39	93.55	94.35	15.90	1.91	2.56	2.49	13.43	13.27	13.33	104
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NFRCで分類

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	3,596	99.17	99.49	3.80	1.09	1.32	1.32	3.61	3.58	3.61	81
短期(1-3)	1,867	99.54	99.82	2.13	0.96	1.17	1.17	2.11	2.10	2.11	76
中期(3-7)	1,370	98.89	99.17	4.14	1.05	1.33	1.32	4.04	4.01	4.04	81
長期(7-)	359	98.37	98.99	11.20	1.92	2.13	2.11	9.84	9.73	9.81	109
長期(7-11)	199	98.32	98.75	8.68	1.58	1.83	1.82	8.08	8.01	8.08	102
超長期(11-)	160	98.43	99.29	14.35	2.35	2.50	2.47	12.03	11.88	11.96	117
AAA~BB格	3,596	99.17	99.49	3.80	1.09	1.32	1.32	3.61	3.58	3.61	81
短期(1-3)	1,867	99.54	99.82	2.13	0.96	1.17	1.17	2.11	2.10	2.11	76
中期(3-7)	1,370	98.89	99.17	4.14	1.05	1.33	1.32	4.04	4.01	4.04	81
長期(7-)	359	98.37	98.99	11.20	1.92	2.13	2.11	9.84	9.73	9.81	109
長期(7-11)	199	98.32	98.75	8.68	1.58	1.83	1.82	8.08	8.01	8.08	102
超長期(11-)	160	98.43	99.29	14.35	2.35	2.50	2.47	12.03	11.88	11.96	117
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	1,586	98.64	98.99	4.35	1.22	1.55	1.54	4.07	4.03	4.06	101
短期(1-3)	708	99.41	99.71	2.22	1.08	1.34	1.34	2.19	2.17	2.19	94
中期(3-7)	661	98.52	98.86	4.28	1.14	1.52	1.51	4.17	4.14	4.17	100
長期(7-)	218	96.51	97.06	11.48	1.96	2.34	2.31	10.03	9.91	9.99	126
長期(7-11)	120	98.42	98.92	8.86	1.83	2.07	2.06	8.15	8.07	8.14	124
超長期(11-)	98	94.17	94.77	14.70	2.11	2.70	2.62	12.44	12.28	12.36	128
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NFRCで分類

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	3,847	99.21	99.52	3.77	1.08	1.30	1.30	3.59	3.56	3.59	80
短期(1-3)	2,071	99.58	99.85	2.21	0.96	1.15	1.15	2.18	2.17	2.18	75
中期(3-7)	1,416	98.88	99.16	4.17	1.03	1.31	1.31	4.08	4.05	4.08	80
長期(7-)	360	98.37	98.99	11.19	1.92	2.13	2.11	9.84	9.73	9.80	109
長期(7-11)	204	98.38	98.82	8.72	1.60	1.84	1.83	8.11	8.04	8.10	103
超長期(11-)	157	98.36	99.21	14.42	2.35	2.50	2.48	12.08	11.93	12.00	117
AAA~BB格	3,847	99.21	99.52	3.77	1.08	1.30	1.30	3.59	3.56	3.59	80
短期(1-3)	2,071	99.58	99.85	2.21	0.96	1.15	1.15	2.18	2.17	2.18	75
中期(3-7)	1,416	98.88	99.16	4.17	1.03	1.31	1.31	4.08	4.05	4.08	80
長期(7-)	360	98.37	98.99	11.19	1.92	2.13	2.11	9.84	9.73	9.80	109
長期(7-11)	204	98.38	98.82	8.72	1.60	1.84	1.83	8.11	8.04	8.10	103
超長期(11-)	157	98.36	99.21	14.42	2.35	2.50	2.48	12.08	11.93	12.00	117
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	1,626	98.67	99.02	4.32	1.23	1.56	1.55	4.04	4.01	4.04	101
短期(1-3)	746	99.42	99.73	2.25	1.11	1.36	1.36	2.22	2.20	2.22	95
中期(3-7)	661	98.52	98.86	4.28	1.14	1.52	1.51	4.17	4.14	4.17	100
長期(7-)	219	96.53	97.08	11.47	1.96	2.35	2.31	10.02	9.90	9.98	126
長期(7-11)	122	98.43	98.93	8.87	1.84	2.08	2.06	8.16	8.07	8.15	125
超長期(11-)	98	94.17	94.77	14.70	2.11	2.70	2.62	12.44	12.28	12.36	128
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)

	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	751	98.79	99.12	3.14	0.99	1.31	1.30	3.05	3.02	3.05	85
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-)	41	93.46	93.84	9.16	1.06	1.87	1.81	8.59	8.51	8.59	96
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-)	11	88.01	88.53	12.11	1.32	2.62	2.47	11.09	10.95	11.07	132
AAA~BB 格	751	98.79	99.12	3.14	0.99	1.31	1.30	3.05	3.02	3.05	85
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-)	41	93.46	93.84	9.16	1.06	1.87	1.81	8.59	8.51	8.59	96
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-)	11	88.01	88.53	12.11	1.32	2.62	2.47	11.09	10.95	11.07	132
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	11	88.01	88.53	12.11	1.32	2.62	2.47	11.09	10.95	11.07	132
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	11	88.01	88.53	12.11	1.32	2.62	2.47	11.09	10.95	11.07	132
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	11	88.01	88.53	12.11	1.32	2.62	2.47	11.09	10.95	11.07	132
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	2,845	99.27	99.59	3.97	1.11	1.33	1.32	3.76	3.73	3.75	81
短期 (1-3)	1,473	99.56	99.83	2.17	0.96	1.16	1.16	2.15	2.14	2.15	76
中期 (3-7)	1,053	98.96	99.24	4.23	1.06	1.31	1.30	4.13	4.10	4.13	79
長期 (7-)	318	98.99	99.65	11.46	2.03	2.16	2.15	9.99	9.88	9.95	110
長期 (7-11)	170	98.79	99.24	8.79	1.68	1.87	1.86	8.15	8.07	8.14	105
超長期 (11-)	148	99.23	100.11	14.52	2.43	2.49	2.47	12.09	11.94	12.02	116

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	751	98.79	99.12	3.14	0.99	1.31	1.30	3.05	3.02	3.05	85
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-)	41	93.46	93.84	9.16	1.06	1.87	1.81	8.59	8.51	8.59	96
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-)	11	88.01	88.53	12.11	1.32	2.62	2.47	11.09	10.95	11.07	132
AAA~BB 格	751	98.79	99.12	3.14	0.99	1.31	1.30	3.05	3.02	3.05	85
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-)	41	93.46	93.84	9.16	1.06	1.87	1.81	8.59	8.51	8.59	96
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-)	11	88.01	88.53	12.11	1.32	2.62	2.47	11.09	10.95	11.07	132
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	11	88.01	88.53	12.11	1.32	2.62	2.47	11.09	10.95	11.07	132
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	11	88.01	88.53	12.11	1.32	2.62	2.47	11.09	10.95	11.07	132
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	11	88.01	88.53	12.11	1.32	2.62	2.47	11.09	10.95	11.07	132
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	3,096	99.31	99.61	3.92	1.10	1.30	1.30	3.72	3.69	3.72	79
短期 (1-3)	1,677	99.61	99.87	2.26	0.96	1.15	1.14	2.23	2.22	2.23	74
中期 (3-7)	1,100	98.95	99.22	4.28	1.04	1.29	1.28	4.17	4.15	4.17	77
長期 (7-)	320	98.99	99.64	11.45	2.03	2.16	2.15	9.99	9.88	9.95	110
長期 (7-11)	175	98.84	99.31	8.84	1.70	1.88	1.87	8.18	8.10	8.17	106
超長期 (11-)	145	99.17	100.05	14.60	2.43	2.49	2.48	12.14	11.99	12.07	116

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	1,086	99.21	99.61	4.48	1.39	1.60	1.60	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)	285	98.34	98.63	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	1,086	99.21	99.61	4.48	1.39	1.60	1.60	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)	285	98.34	98.63	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	1	93.58	93.70	4.89	1.05	2.52	2.45	4.77	4.71	4.77	191
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	1	93.58	93.70	4.89	1.05	2.52	2.45	4.77	4.71	4.77	191
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	2,510	99.15	99.44	3.51	0.96	1.20	1.20	3.38	3.35	3.37	72
短期 (1-3)	1,264	99.46	99.72	2.08	0.82	1.07	1.07	2.05	2.04	2.05	67
中期 (3-7)	1,085	99.03	99.32	4.12	1.01	1.26	1.25	4.02	4.00	4.02	74
長期 (7-)	160	97.56	98.11	10.64	1.62	1.90	1.88	9.53	9.43	9.50	91
長期 (7-11)	119	98.76	99.21	8.91	1.51	1.69	1.68	8.30	8.23	8.30	86
超長期 (11-)	42	94.16	94.99	15.55	1.94	2.53	2.46	13.14	12.98	13.04	105

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	1,176	99.25	99.63	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)	280	98.18	98.44	4.27	1.13	1.60	1.59	4.16	4.12	4.16	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	1,176	99.25	99.63	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)	280	98.18	98.44	4.27	1.13	1.60	1.59	4.16	4.12	4.16	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	1	93.58	93.70	4.89	1.05	2.52	2.45	4.77	4.71	4.77	191
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	1	93.58	93.70	4.89	1.05	2.52	2.45	4.77	4.71	4.77	191
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	2,672	99.19	99.46	3.51	0.95	1.19	1.18	3.38	3.36	3.38	70
短期 (1-3)	1,375	99.49	99.73	2.14	0.82	1.05	1.05	2.12	2.11	2.12	65
中期 (3-7)	1,136	99.06	99.34	4.15	1.01	1.24	1.24	4.06	4.03	4.06	73
長期 (7-)	160	97.56	98.11	10.64	1.62	1.90	1.88	9.53	9.43	9.50	91
長期 (7-11)	122	98.84	99.32	8.96	1.53	1.70	1.69	8.34	8.27	8.33	87
超長期 (11-)	39	93.55	94.35	15.90	1.91	2.56	2.49	13.43	13.27	13.33	104

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	3,370	99.23	99.54	3.88	1.07	1.29	1.28	3.68	3.65	3.67	78
短期 (1-3)	1,689	99.60	99.87	2.14	0.91	1.10	1.10	2.12	2.10	2.12	70
中期 (3-7)	1,330	98.95	99.24	4.13	1.05	1.31	1.30	4.04	4.01	4.04	80
長期 (7-)	351	98.47	99.11	11.28	1.94	2.13	2.11	9.90	9.79	9.86	108
長期 (7-11)	192	98.51	98.96	8.73	1.60	1.82	1.81	8.12	8.05	8.12	101
超長期 (11-)	160	98.43	99.29	14.35	2.35	2.50	2.47	12.03	11.88	11.96	117
AAA~BB 格	3,370	99.23	99.54	3.88	1.07	1.29	1.28	3.68	3.65	3.67	78
短期 (1-3)	1,689	99.60	99.87	2.14	0.91	1.10	1.10	2.12	2.10	2.12	70
中期 (3-7)	1,330	98.95	99.24	4.13	1.05	1.31	1.30	4.04	4.01	4.04	80
長期 (7-)	351	98.47	99.11	11.28	1.94	2.13	2.11	9.90	9.79	9.86	108
長期 (7-11)	192	98.51	98.96	8.73	1.60	1.82	1.81	8.12	8.05	8.12	101
超長期 (11-)	160	98.43	99.29	14.35	2.35	2.50	2.47	12.03	11.88	11.96	117
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	1,306	98.71	99.06	4.60	1.23	1.52	1.51	4.28	4.24	4.27	96
短期 (1-3)	529	99.57	99.84	2.25	1.04	1.25	1.25	2.22	2.21	2.22	84
中期 (3-7)	582	98.68	99.03	4.34	1.15	1.49	1.49	4.22	4.19	4.22	97
長期 (7-)	194	96.45	97.02	11.77	1.98	2.36	2.31	10.23	10.11	10.19	125
長期 (7-11)	97	98.76	99.30	8.80	1.84	2.03	2.02	8.10	8.02	8.09	121
超長期 (11-)	98	94.17	94.77	14.70	2.11	2.70	2.62	12.44	12.28	12.36	128
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	225	98.34	98.74	2.63	1.32	1.84	1.83	2.56	2.54	2.56	141
短期 (1-3)	178	98.89	99.37	2.08	1.38	1.81	1.80	2.04	2.02	2.04	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	3,701	99.23	99.53	3.83	1.06	1.28	1.27	3.64	3.62	3.64	77
短期 (1-3)	1,955	99.60	99.85	2.23	0.92	1.11	1.11	2.20	2.19	2.20	70
中期 (3-7)	1,386	98.92	99.20	4.18	1.03	1.30	1.29	4.08	4.06	4.08	78
長期 (7-)	360	98.37	98.99	11.19	1.92	2.13	2.11	9.84	9.73	9.80	109
長期 (7-11)	204	98.38	98.82	8.72	1.60	1.84	1.83	8.11	8.04	8.10	103
超長期 (11-)	157	98.36	99.21	14.42	2.35	2.50	2.48	12.08	11.93	12.00	117
AAA~BB 格	3,701	99.23	99.53	3.83	1.06	1.28	1.27	3.64	3.62	3.64	77
短期 (1-3)	1,955	99.60	99.85	2.23	0.92	1.11	1.11	2.20	2.19	2.20	70
中期 (3-7)	1,386	98.92	99.20	4.18	1.03	1.30	1.29	4.08	4.06	4.08	78
長期 (7-)	360	98.37	98.99	11.19	1.92	2.13	2.11	9.84	9.73	9.80	109
長期 (7-11)	204	98.38	98.82	8.72	1.60	1.84	1.83	8.11	8.04	8.10	103
超長期 (11-)	157	98.36	99.21	14.42	2.35	2.50	2.48	12.08	11.93	12.00	117
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	1,424	98.67	99.01	4.48	1.22	1.53	1.52	4.18	4.15	4.18	98
短期 (1-3)	629	99.45	99.70	2.31	1.05	1.31	1.30	2.28	2.26	2.28	89
中期 (3-7)	592	98.64	98.99	4.35	1.15	1.50	1.49	4.23	4.20	4.23	98
長期 (7-)	204	96.35	96.91	11.59	1.95	2.35	2.31	10.10	9.98	10.06	126
長期 (7-11)	106	98.38	98.90	8.70	1.80	2.04	2.03	8.03	7.95	8.02	123
超長期 (11-)	98	94.17	94.77	14.70	2.11	2.70	2.62	12.44	12.28	12.36	128
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	146	98.75	99.30	2.30	1.57	1.95	1.94	2.24	2.22	2.24	154
短期 (1-3)	116	99.21	99.88	1.87	1.68	1.95	1.95	1.83	1.81	1.83	157
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	3,532	99.17	99.49	3.83	1.08	1.31	1.31	3.63	3.61	3.63	80
短期 (1-3)	1,812	99.54	99.82	2.14	0.94	1.14	1.14	2.12	2.11	2.12	74
中期 (3-7)	1,364	98.90	99.18	4.14	1.05	1.33	1.32	4.04	4.01	4.04	81
長期 (7-)	357	98.40	99.02	11.22	1.93	2.13	2.11	9.86	9.75	9.82	109
長期 (7-11)	197	98.37	98.81	8.69	1.59	1.83	1.82	8.09	8.02	8.09	102
超長期 (11-)	160	98.43	99.29	14.35	2.35	2.50	2.47	12.03	11.88	11.96	117
AAA~BB 格	3,532	99.17	99.49	3.83	1.08	1.31	1.31	3.63	3.61	3.63	80
短期 (1-3)	1,812	99.54	99.82	2.14	0.94	1.14	1.14	2.12	2.11	2.12	74
中期 (3-7)	1,364	98.90	99.18	4.14	1.05	1.33	1.32	4.04	4.01	4.04	81
長期 (7-)	357	98.40	99.02	11.22	1.93	2.13	2.11	9.86	9.75	9.82	109
長期 (7-11)	197	98.37	98.81	8.69	1.59	1.83	1.82	8.09	8.02	8.09	102
超長期 (11-)	160	98.43	99.29	14.35	2.35	2.50	2.47	12.03	11.88	11.96	117
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	1,526	98.65	99.01	4.41	1.23	1.55	1.54	4.12	4.08	4.11	100
短期 (1-3)	685	99.40	99.71	2.22	1.07	1.34	1.33	2.19	2.17	2.19	93
中期 (3-7)	624	98.57	98.92	4.34	1.16	1.52	1.51	4.22	4.19	4.22	100
長期 (7-)	218	96.51	97.06	11.48	1.96	2.34	2.31	10.03	9.91	9.99	126
長期 (7-11)	120	98.42	98.92	8.86	1.83	2.07	2.06	8.15	8.07	8.14	124
超長期 (11-)	98	94.17	94.77	14.70	2.11	2.70	2.62	12.44	12.28	12.36	128
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	3,784	99.21	99.52	3.80	1.07	1.29	1.29	3.61	3.59	3.61	79
短期 (1-3)	2,015	99.58	99.85	2.22	0.94	1.13	1.13	2.19	2.18	2.19	73
中期 (3-7)	1,410	98.89	99.17	4.17	1.04	1.31	1.31	4.08	4.05	4.08	80
長期 (7-)	358	98.40	99.02	11.22	1.93	2.13	2.12	9.85	9.75	9.82	109
長期 (7-11)	201	98.43	98.88	8.73	1.61	1.84	1.83	8.12	8.05	8.11	103
超長期 (11-)	157	98.36	99.21	14.42	2.35	2.50	2.48	12.08	11.93	12.00	117
AAA~BB 格	3,784	99.21	99.52	3.80	1.07	1.29	1.29	3.61	3.59	3.61	79
短期 (1-3)	2,015	99.58	99.85	2.22	0.94	1.13	1.13	2.19	2.18	2.19	73
中期 (3-7)	1,410	98.89	99.17	4.17	1.04	1.31	1.31	4.08	4.05	4.08	80
長期 (7-)	358	98.40	99.02	11.22	1.93	2.13	2.12	9.85	9.75	9.82	109
長期 (7-11)	201	98.43	98.88	8.73	1.61	1.84	1.83	8.12	8.05	8.11	103
超長期 (11-)	157	98.36	99.21	14.42	2.35	2.50	2.48	12.08	11.93	12.00	117
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	1,566	98.68	99.03	4.38	1.24	1.56	1.55	4.09	4.05	4.08	101
短期 (1-3)	723	99.42	99.72	2.25	1.10	1.35	1.35	2.22	2.21	2.22	94
中期 (3-7)	624	98.57	98.92	4.34	1.16	1.52	1.51	4.22	4.19	4.22	100
長期 (7-)	219	96.53	97.08	11.47	1.96	2.35	2.31	10.02	9.90	9.98	126
長期 (7-11)	122	98.43	98.93	8.87	1.84	2.08	2.06	8.16	8.07	8.15	125
超長期 (11-)	98	94.17	94.77	14.70	2.11	2.70	2.62	12.44	12.28	12.36	128
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/Extended 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	14,003	14,825	15,436	15,639	16,113	16,230
額面(10億円)	972,326	1,018,210	1,056,757	1,085,263	1,124,834	1,146,370
時価単価(円)	108.39	106.48	104.19	101.51	98.40	96.27
利含単価(円)	108.52	106.59	104.30	101.61	98.50	96.45
残存年数(年)	9.84	9.89	10.01	10.16	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	9.31	9.18	8.93	8.68
M-Dur	9.46	9.34	9.29	9.15	8.88	8.62
E-Dur	9.45	9.33	9.29	9.15	8.89	8.63
Tspd(bp)	5	4	3	6	4	4

出所:NFRC

NOMURA-BPI/Extended の定義

NOMURA-BPI/Extended 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 BBB 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 ヶ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。

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

$BPIE_{today}$: 当日累積投資収益指数

$BPIE_{e.l.m.}$: 前月末累積投資収益指数

$MVLt_{today}$: 当日経過利子込み時価総額

$MVLt_{e.l.m.}$: 前月末経過利子込み時価総額

$CF_{e.l.m.,today}$: 前月末から当日までのインカム収入と償還金の合計

各ポートフォリオの累積投資収益指数は以下の基準日を 100 としている。

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

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)。
- 1995 年 12 月以前の指数は、NOMURA-BPI の指数と同じ。
- 「除く MBS」の 2003 年 3 月以前の指数は、NOMURA-BPI/Extended の指数と同じ。
- 「除く ABS」の 2008 年 3 月以前の指数は、NOMURA-BPI/Extended 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 $RETURN_{s,t}$ は以下の計算式から算出される。

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

ただし、 $BPIE_t$ 、 $BPIE_s$ 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/Extended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/Extended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/Extended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/Extended のデータ提供について

NOMURA-BPI/Extended のデータは以下の情報端末でもご覧いただけます。

Quick-IS

NRIJ108, NRIJ109, NRIJ110, NRIJ111
NRIJ112, NRIJ113, NRIJ114, NRIJ115

REUTERS

NMSBPI メニュー

Bloomberg

NBPI(GO) メニュー

時事通信社

BPIXG/12400

NFRC Web ページ

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

ディスクレイマー

NOMURA-BPI/Extended 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