

月間投資収益率 (2024年11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 358.235	-8.80	-9.64	0.85	-3.45
			-3.45	-3.06

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(%)

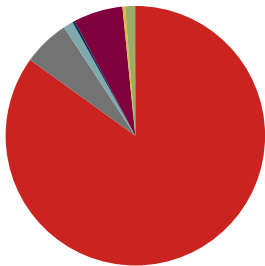
ポートフォリオ指標 (2024年11月末)

	翌月ポート (2024年12月)	当月ポート (2024年11月)	差
額面[兆円]	1144.33	1156.14	-11.81
デュレーション[年]	8.77	8.61	0.16
修正デュレーション	8.71	8.55	0.16
時価単価[円]	95.49	95.54	-0.05
利含単価[円]	95.73	95.78	-0.05
残存年数[年]	10.34	10.15	0.18
利率[%]	0.83	0.82	0.01
単利[%]	1.12	1.11	0.01
複利[%]	1.09	1.07	0.01
Tスプレッド[bp]	4	4	0

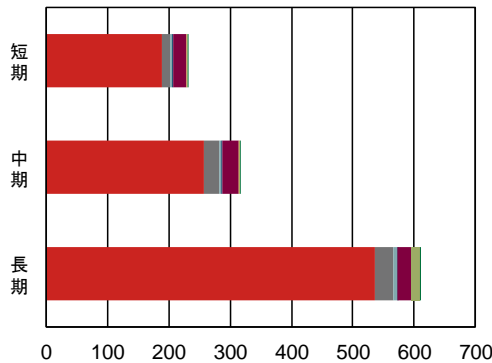
出所: NFRC

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

銘柄別額面構成 (2024年11月末)



残存別額面構成 (2024年11月末)



出所: NFRC

出所: NFRC

(兆円)

	国債	地方債	政保債	金融債	事業債	円建外債	MBS	ABS
構成比	84.9%	5.8%	1.2%	0.3%	6.2%	0.3%	1.2%	0.1%
全体	982.00	66.95	14.23	3.39	71.16	3.85	13.91	0.65
短期	189.30	12.69	3.31	1.98	21.08	2.07	-	0.17
中期	256.59	24.97	4.17	1.25	26.89	1.42	-	0.32
長期	536.11	29.29	6.75	0.17	23.19	0.36	13.91	0.16

出所: NFRC

(兆円)

目次

銘柄別・投資収益率 投資収益指数	2
総合 残存別・投資収益率 投資収益指数	3
国債 残存別・投資収益率 投資収益指数	4
「除く MBS」残存別・投資収益率 投資収益指数	6
「除く ABS」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11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	358.235	-8.80	-9.64	0.85	-3.45	-3.06
国債	368.199	-8.96	-9.83	0.87	-3.68	-3.29
地方債	385.771	-8.66	-9.29	0.63	-2.22	-1.91
政保債	360.281	-8.37	-9.13	0.76	-3.04	-2.51
金融債	271.924	-5.14	-5.46	0.32	-0.82	-0.86
事業債	381.536	-7.22	-8.00	0.78	-2.17	-1.63
円建外債	392.771	-3.57	-4.64	1.07	0.45	0.69
MBS	122.988	-8.75	-9.40	0.65	-2.79	-2.47
ABS	112.997	-7.00	-7.76	0.76	-1.14	-1.12

出所:NFRC

投資収益率は年率換算(%)

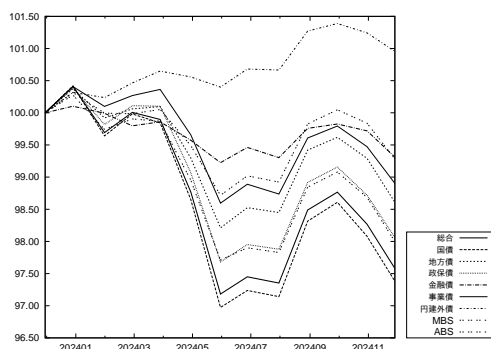
銘柄別・累積投資収益指数の推移

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
2023/11/30	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
2024/10/31	360.756	370.841	388.443	362.695	273.039	383.739	393.887	123.849	113.629
2024/11/01	360.589	370.671	388.245	362.523	272.868	383.534	393.936	123.794	113.565
2024/11/05	360.791	370.880	388.502	362.733	272.976	383.746	394.198	123.764	113.643
2024/11/06	359.797	369.834	387.467	361.748	272.681	382.925	393.627	123.460	113.395
2024/11/07	359.086	369.076	386.828	361.073	272.463	382.355	393.388	123.257	113.239
2024/11/08	359.245	369.244	386.951	361.219	272.488	382.522	393.323	123.315	113.269
2024/11/11	359.323	369.321	387.064	361.309	272.541	382.621	393.371	123.345	113.304
2024/11/12	359.001	368.974	386.795	361.011	272.467	382.388	393.196	123.249	113.247
2024/11/13	358.160	368.087	385.944	360.216	272.225	381.694	392.883	122.980	113.044
2024/11/14	357.703	367.589	385.607	359.805	272.156	381.380	392.778	122.855	112.976
2024/11/15	357.546	367.437	385.341	359.658	272.038	381.193	392.600	122.776	112.900
2024/11/18	357.507	367.389	385.356	359.612	272.065	381.195	392.681	122.773	112.914
2024/11/19	357.701	367.602	385.479	359.783	272.044	381.311	392.783	122.825	112.937
2024/11/20	357.677	367.581	385.422	359.749	272.017	381.266	392.684	122.809	112.925
2024/11/21	357.164	367.054	384.809	359.233	271.782	380.765	392.462	122.621	112.765
2024/11/22	357.397	367.301	385.049	359.465	271.784	380.929	392.531	122.710	112.815
2024/11/25	357.608	367.523	385.273	359.679	271.831	381.112	392.622	122.772	112.878
2024/11/26	357.883	367.821	385.471	359.945	271.880	381.310	392.599	122.866	112.929
2024/11/27	357.448	367.345	385.174	359.566	271.829	381.023	392.463	122.761	112.872
2024/11/28	357.906	367.833	385.597	359.986	271.943	381.366	392.696	122.901	112.971
2024/11/29	358.235	368.199	385.771	360.281	271.924	381.536	392.771	122.988	112.997

出所:NFRC

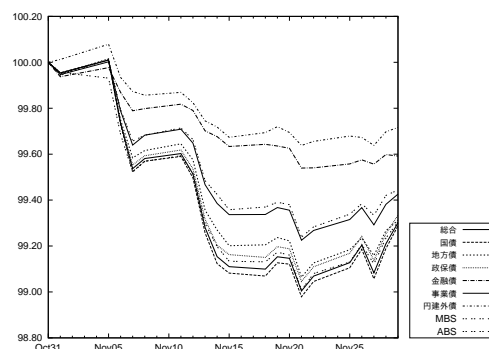
1983年12月末=100。MBSセクターは2003年3月末=100。ABSセクターは2008年3月末=100

指数の推移(月次) 2023年11月末=100に補正。



出所:NFRC

指数の推移(日次) 2024年10月末=100に補正。



出所:NFRC

総合 残存別・投資収益率(2024年11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	358.235	-8.80	-9.64	0.85	-3.45	-3.06
短期 (1-3)	233.617	-3.37	-3.77	0.41	-0.65	-0.68
中期 (3-7)	334.175	-7.93	-8.58	0.65	-1.59	-1.62
長期 (7-)	523.293	-11.49	-12.62	1.13	-5.60	-4.80
長期 (7-11)	191.996	-10.81	-11.81	1.00	-2.06	-1.88
超長期 (11-)	230.093	-11.91	-13.12	1.21	-7.69	-6.51
(11-15)	222.113	-11.50	-12.50	1.00	-3.91	-3.17
(15-)	234.823	-12.06	-13.34	1.29	-9.03	-7.69

出所:NFRC

投資収益率は年率換算(%)

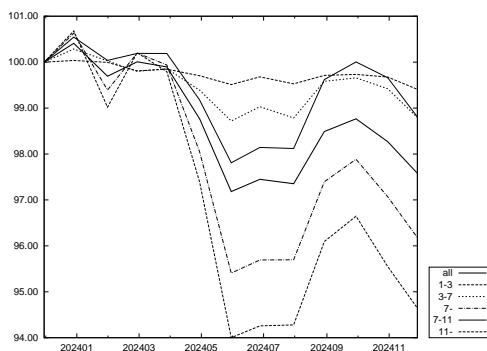
総合 残存別・投資収益指数の推移

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-)*
2023/11/30	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
2024/10/31	360.756	234.244	336.293	528.115	193.659	232.291	224.162	237.094
2024/11/01	360.589	234.117	336.040	527.972	193.582	232.247	224.039	237.079
2024/11/05	360.791	234.174	336.230	528.333	193.758	232.373	224.304	237.154
2024/11/06	359.797	234.067	335.603	526.123	193.009	231.356	223.238	236.148
2024/11/07	359.086	233.968	335.158	524.558	192.625	230.528	222.656	235.221
2024/11/08	359.245	233.969	335.222	524.960	192.712	230.749	222.786	235.478
2024/11/11	359.323	233.994	335.299	525.092	192.802	230.777	222.868	235.485
2024/11/12	359.001	233.968	335.144	524.327	192.649	230.346	222.529	235.017
2024/11/13	358.160	233.868	334.627	522.452	192.026	229.474	221.705	234.120
2024/11/14	357.703	233.827	334.510	521.277	191.806	228.802	221.198	233.381
2024/11/15	357.546	233.763	334.259	521.105	191.574	228.851	221.017	233.517
2024/11/18	357.507	233.775	334.295	520.950	191.599	228.723	221.023	233.337
2024/11/19	357.701	233.746	334.308	521.523	191.693	229.060	221.282	233.707
2024/11/20	357.677	233.751	334.242	521.506	191.658	229.074	221.288	233.723
2024/11/21	357.164	233.642	333.738	520.573	191.255	228.708	220.842	233.385
2024/11/22	357.397	233.600	333.836	521.196	191.430	229.021	221.172	233.694
2024/11/25	357.608	233.600	333.982	521.676	191.617	229.225	221.429	233.878
2024/11/26	357.883	233.617	334.058	522.386	191.780	229.608	221.807	234.267
2024/11/27	357.448	233.598	333.961	521.236	191.605	228.921	221.442	233.453
2024/11/28	357.906	233.644	334.207	522.294	191.904	229.452	221.807	234.051
2024/11/29	358.235	233.617	334.175	523.293	191.996	230.093	222.113	234.823

出所:NFRC

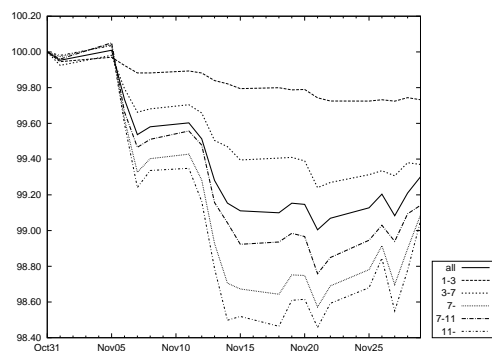
* は 1995年12月末=100。それ以外は、1983年12月末=100。

指数の推移(月次) 2023年11月末=100に補正。



出所:NFRC

指数の推移(日次) 2024年10月末=100に補正。



出所:NFRC

国債 残存別・投資収益率 (2024 年 11 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	368.199	-8.96	-9.83	0.87	-3.68	-3.29
短期 (1-3)	220.225	-3.35	-3.76	0.40	-0.70	-0.73
中期 (3-7)	332.626	-7.96	-8.62	0.66	-1.64	-1.70
長期 (7-)	532.596	-11.62	-12.78	1.16	-5.83	-5.05
長期 (7-11)	190.309	-10.88	-11.88	1.00	-2.10	-1.97
超長期 (11-)	228.499	-12.07	-13.32	1.25	-8.01	-6.84
(11-15)	219.924	-11.55	-12.57	1.02	-3.96	-3.27
(15-)	233.596	-12.25	-13.58	1.33	-9.46	-8.10

出所:NFRC

投資収益率は年率換算 (%)

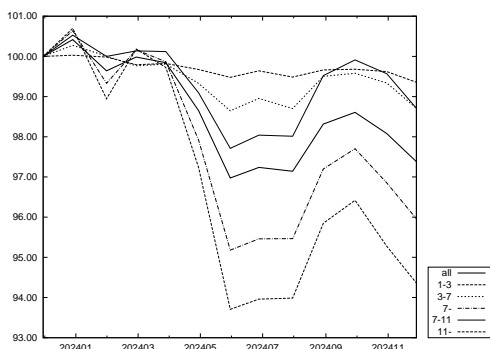
国債 残存別・投資収益指数の推移

国債 年/月/日	全体	短期 (1-3)	中期 (3-7)	長期 (7-)	長期*	超長期*		
					(7-11)	(11-)	(11-15)*	(15-)*
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
2024/10/31	370.841	220.814	334.742	537.559	191.969	230.711	221.962	235.892
2024/11/01	370.671	220.694	334.486	537.415	191.890	230.670	221.838	235.882
2024/11/05	370.880	220.746	334.675	537.786	192.064	230.798	222.099	235.961
2024/11/06	369.834	220.648	334.052	535.516	191.321	229.774	221.041	234.942
2024/11/07	369.076	220.555	333.608	533.884	190.940	228.927	220.463	233.985
2024/11/08	369.244	220.555	333.667	534.298	191.021	229.153	220.591	234.250
2024/11/11	369.321	220.578	333.744	534.424	191.110	229.175	220.672	234.250
2024/11/12	368.974	220.553	333.589	533.623	190.958	228.733	220.333	233.766
2024/11/13	368.087	220.460	333.075	531.693	190.340	227.853	219.517	232.854
2024/11/14	367.589	220.421	332.957	530.457	190.122	227.159	219.010	232.084
2024/11/15	367.437	220.361	332.706	530.305	189.890	227.223	218.831	232.241
2024/11/18	367.389	220.371	332.740	530.133	189.915	227.087	218.835	232.050
2024/11/19	367.602	220.345	332.753	530.736	190.007	227.435	219.093	232.435
2024/11/20	367.581	220.351	332.690	530.725	189.974	227.452	219.101	232.456
2024/11/21	367.054	220.249	332.189	529.784	189.575	227.094	218.662	232.125
2024/11/22	367.301	220.209	332.284	530.422	189.748	227.408	218.989	232.438
2024/11/25	367.523	220.208	332.429	530.914	189.934	227.612	219.243	232.624
2024/11/26	367.821	220.225	332.509	531.651	190.095	228.003	219.621	233.023
2024/11/27	367.345	220.209	332.415	530.434	189.922	227.289	219.257	232.171
2024/11/28	367.833	220.251	332.660	531.536	190.218	227.833	219.620	232.788
2024/11/29	368.199	220.225	332.626	532.596	190.309	228.499	219.924	233.596

出所:NFRC

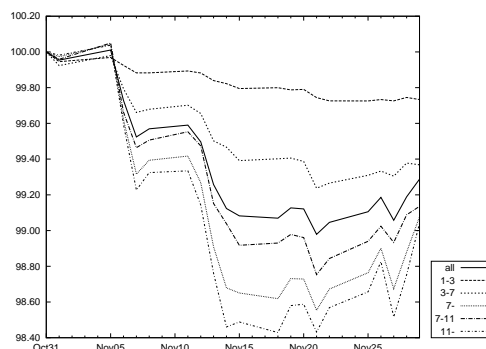
* は 1995 年 12 月末=100。それ以外は、1983 年 12 月末=100。

指数の推移 (月次) 2023 年 11 月末=100 に補正。



出所:NFRC

指数の推移 (日次) 2024 年 10 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11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	358.115	-8.80	-9.65	0.85	-3.46	-3.07
短期(1-3)	233.617	-3.37	-3.77	0.41	-0.65	-0.68
中期(3-7)	334.175	-7.93	-8.58	0.65	-1.59	-1.62
長期(7-)	525.085	-11.56	-12.70	1.14	-5.67	-4.86
長期(7-11)	191.991	-10.81	-11.81	1.00	-2.06	-1.88
超長期(11-)	231.717	-12.03	-13.27	1.24	-7.88	-6.67
(11-15)	222.102	-11.50	-12.50	1.00	-3.91	-3.17
(15-)	236.637	-12.23	-13.55	1.32	-9.36	-7.97

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(%)

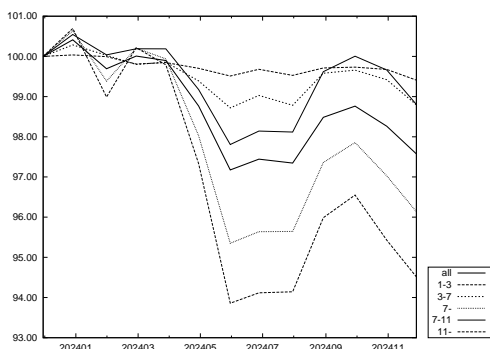
「除くMBS」残存別・投資収益指数の推移

除くMBS 年/月/日	全体	短期 (1-3)	中期 (3-7)	長期 (7-)	長期*			
					(7-11)	超長期* (11-)	(11-15)*	(15-)*
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
2024/10/31	360.636	234.244	336.293	529.951	193.655	233.953	224.151	238.959
2024/11/01	360.468	234.117	336.040	529.810	193.577	233.911	224.028	238.949
2024/11/05	360.674	234.174	336.230	530.184	193.754	234.045	224.293	239.031
2024/11/06	359.679	234.067	335.603	527.944	193.004	233.003	223.227	237.994
2024/11/07	358.967	233.968	335.158	526.357	192.620	232.153	222.645	237.032
2024/11/08	359.126	233.969	335.222	526.764	192.707	232.379	222.775	237.299
2024/11/11	359.204	233.994	335.299	526.897	192.797	232.406	222.857	237.303
2024/11/12	358.881	233.968	335.144	526.120	192.644	231.963	222.518	236.816
2024/11/13	358.040	233.868	334.627	524.222	192.020	231.071	221.694	235.892
2024/11/14	357.582	233.827	334.510	523.027	191.801	230.377	221.187	235.120
2024/11/15	357.426	233.763	334.259	522.859	191.568	230.434	221.006	235.273
2024/11/18	357.387	233.775	334.295	522.699	191.593	230.299	221.012	235.082
2024/11/19	357.581	233.746	334.308	523.283	191.687	230.649	221.271	235.469
2024/11/20	357.557	233.751	334.242	523.267	191.652	230.664	221.277	235.488
2024/11/21	357.045	233.642	333.738	522.328	191.249	230.295	220.831	235.149
2024/11/22	357.277	233.600	333.836	522.959	191.424	230.617	221.161	235.468
2024/11/25	357.489	233.600	333.982	523.446	191.612	230.825	221.419	235.657
2024/11/26	357.764	233.617	334.058	524.166	191.775	231.219	221.796	236.060
2024/11/27	357.327	233.598	333.961	522.994	191.599	230.508	221.431	235.206
2024/11/28	357.785	233.644	334.207	524.067	191.898	231.053	221.796	235.827
2024/11/29	358.115	233.617	334.175	525.085	191.991	231.717	222.102	236.637

出所:NFRC

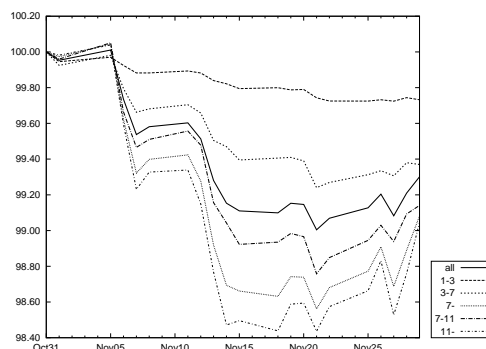
* は1995年12月末=100。それ以外は、1983年12月末=100。

指数の推移(月次) 2023年11月末=100に補正。



出所:NFRC

指数の推移(日次) 2024年10月末=100に補正。



出所:NFRC

「除く ABS」残存別・投資収益率 (2024 年 11 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	358.258	-8.80	-9.64	0.85	-3.46	-3.06
短期 (1-3)	233.576	-3.37	-3.77	0.41	-0.65	-0.68
中期 (3-7)	334.170	-7.93	-8.58	0.65	-1.59	-1.62
長期 (7-)	523.290	-11.49	-12.62	1.13	-5.60	-4.80
長期 (7-11)	191.990	-10.81	-11.81	1.00	-2.06	-1.88
超長期 (11-)	230.090	-11.91	-13.12	1.21	-7.69	-6.51
(11-15)	222.105	-11.50	-12.50	1.00	-3.91	-3.17
(15-)	234.825	-12.06	-13.34	1.29	-9.03	-7.69

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 (%)

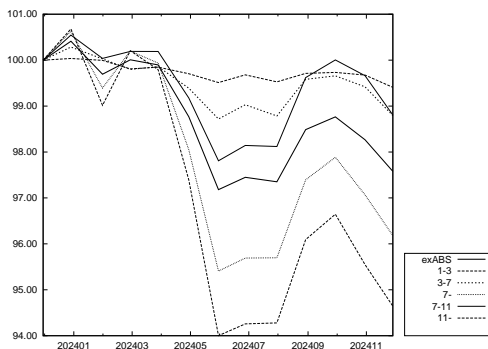
「除く ABS」残存別 投資収益指数の推移

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-)*
2023/11/30	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
2024/10/31	360.780	234.203	336.289	528.112	193.653	232.288	224.153	237.096
2024/11/01	360.613	234.076	336.035	527.969	193.575	232.244	224.031	237.081
2024/11/05	360.815	234.133	336.226	528.330	193.752	232.370	224.296	237.156
2024/11/06	359.821	234.026	335.599	526.120	193.003	231.353	223.230	236.149
2024/11/07	359.110	233.928	335.154	524.555	192.619	230.525	222.647	235.223
2024/11/08	359.269	233.928	335.217	524.957	192.705	230.746	222.778	235.480
2024/11/11	359.347	233.953	335.295	525.089	192.796	230.774	222.860	235.487
2024/11/12	359.025	233.927	335.139	524.324	192.643	230.343	222.520	235.018
2024/11/13	358.184	233.827	334.623	522.449	192.020	229.472	221.697	234.122
2024/11/14	357.726	233.786	334.505	521.274	191.800	228.800	221.189	233.382
2024/11/15	357.570	233.722	334.255	521.102	191.568	228.848	221.009	233.519
2024/11/18	357.530	233.734	334.291	520.947	191.592	228.720	221.014	233.338
2024/11/19	357.725	233.706	334.304	521.520	191.686	229.057	221.273	233.708
2024/11/20	357.700	233.711	334.237	521.503	191.651	229.071	221.279	233.725
2024/11/21	357.187	233.602	333.734	520.570	191.249	228.705	220.834	233.386
2024/11/22	357.420	233.560	333.831	521.193	191.424	229.019	221.164	233.696
2024/11/25	357.632	233.559	333.977	521.673	191.611	229.222	221.421	233.880
2024/11/26	357.907	233.576	334.053	522.383	191.774	229.606	221.799	234.269
2024/11/27	357.472	233.558	333.956	521.233	191.599	228.918	221.434	233.454
2024/11/28	357.929	233.603	334.203	522.291	191.897	229.449	221.799	234.053
2024/11/29	358.258	233.576	334.170	523.290	191.990	230.090	222.105	234.825

出所:NFRC

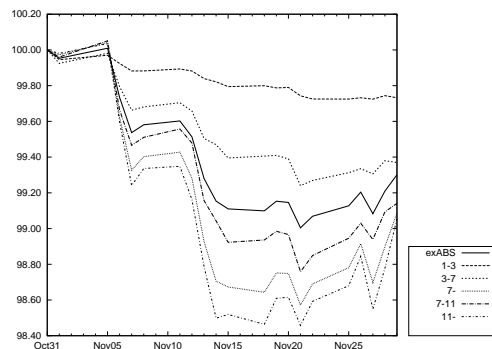
* は 1995 年 12 月末=100。それ以外は、1983 年 12 月末=100。

指数の推移 (月次) 2023 年 11 月末=100 に補正。



出所:NFRC

指数の推移 (日次) 2024 年 10 月末=100 に補正。



出所:NFRC

「除く国債」残存別・投資収益率(2024年11月末)

	累積投資 収益指数	前月末からの投資収益率			過去からの投資収益率	
		トータル	キャピタル	インカム	前年度末	前年末
除く国債	169.125	-7.87	-8.57	0.71	-2.22	-1.82
短期(1-3)	133.880	-3.43	-3.86	0.43	-0.45	-0.44
中期(3-7)	165.856	-7.81	-8.42	0.61	-1.36	-1.26
長期(7-)	229.910	-10.57	-11.52	0.95	-3.95	-3.06
長期(7-11)	198.146	-10.31	-11.28	0.97	-1.75	-1.29
超長期(11-)	233.072	-10.73	-11.68	0.94	-5.32	-4.16

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(%)

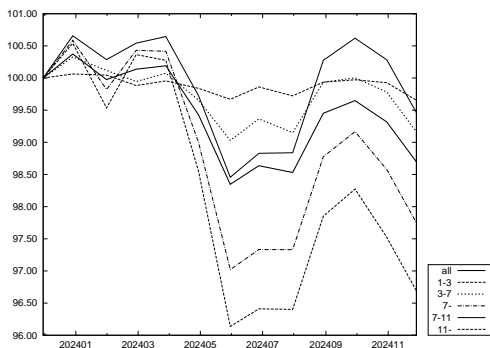
「除く国債」残存別・投資収益指数の推移

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-)
2023/11/30	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
2024/10/31	170.189	134.246	166.891	231.857	199.783	235.077
2024/11/01	170.104	134.174	166.773	231.788	199.715	235.013
2024/11/05	170.195	134.212	166.870	231.937	199.901	235.120
2024/11/06	169.790	134.144	166.556	231.029	199.132	234.190
2024/11/07	169.525	134.085	166.336	230.466	198.741	233.547
2024/11/08	169.588	134.086	166.377	230.626	198.864	233.721
2024/11/11	169.633	134.103	166.418	230.710	198.959	233.788
2024/11/12	169.521	134.089	166.340	230.442	198.808	233.457
2024/11/13	169.185	134.029	166.082	229.687	198.166	232.685
2024/11/14	169.039	134.004	166.026	229.296	197.940	232.204
2024/11/15	168.943	133.969	165.907	229.151	197.712	232.135
2024/11/18	168.945	133.978	165.927	229.125	197.737	232.072
2024/11/19	169.000	133.960	165.934	229.317	197.839	232.315
2024/11/20	168.977	133.960	165.895	229.289	197.797	232.301
2024/11/21	168.737	133.894	165.645	228.852	197.375	231.891
2024/11/22	168.827	133.872	165.697	229.113	197.561	232.185
2024/11/25	168.914	133.874	165.770	229.316	197.754	232.378
2024/11/26	169.005	133.879	165.798	229.580	197.923	232.690
2024/11/27	168.875	133.865	165.746	229.220	197.741	232.228
2024/11/28	169.043	133.895	165.869	229.608	198.047	232.644
2024/11/29	169.125	133.880	165.856	229.910	198.146	233.072

出所:NFRC

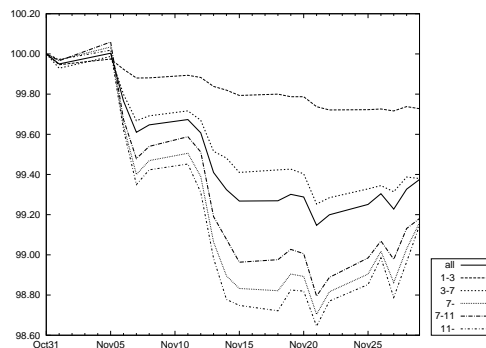
*は1995年12月末=100。それ以外は、1993年12月末=100。

指数の推移(月次) 2023年11月末=100に補正。



出所:NFRC

指数の推移(日次) 2024年10月末=100に補正。



出所:NFRC

銘柄 残存別・月間投資収益率(2024年11月末)

	全体	短期 (1-3)	中期 (3-7)	長期 (7-)		
					(7-11)	(11-)
総合	-8.80	-3.37	-7.93	-11.49	-10.81	-11.91
国債	-8.96	-3.35	-7.96	-11.62	-10.88	-12.07
30年国債	-11.14	-	-8.63	-11.20	-10.53	-11.26
20年国債	-9.86	-3.51	-7.95	-11.41	-10.70	-11.86
10年国債	-8.11	-3.51	-8.31	-11.08	-11.08	-
5年国債	-5.29	-3.55	-7.17	-	-	-
中期国債	-2.49	-2.49	-	-	-	-
地方債	-8.66	-3.73	-8.34	-11.18	-10.77	-11.63
東京都債	-8.20	-3.48	-8.29	-10.83	-10.70	-11.04
五大都市債	-8.78	-3.98	-8.29	-11.42	-10.63	-11.82
その他地方債	-8.67	-3.79	-8.40	-11.19	-10.81	-11.65
政保債	-8.37	-3.67	-7.68	-11.33	-10.75	-11.62
公営企業債券	-5.30	-3.84	-6.98	-	-	-
その他政保債	-8.75	-3.62	-7.81	-11.33	-10.75	-11.62
金融債	-5.14	-3.34	-7.30	-10.49	-10.49	-
特定金融債	-	-	-	-	-	-
事業債	-7.22	-3.34	-7.52	-10.75	-9.71	-11.65
円建外債	-3.57	-2.29	-4.64	-6.75	-6.43	-7.17
MBS	-8.75	-	-	-8.75	-4.03	-8.81
ABS	-7.00	-3.12	-7.59	-10.17	-10.01	-10.38

出所:NFRC

「除く(銘柄)」残存別・月間投資収益率(2024年11月末)

	全体	短期 (1-3)	中期 (3-7)	長期 (7-)		
					(7-11)	(11-)
除く国債	-7.87	-3.43	-7.81	-10.57	-10.31	-10.73
除く30年国債	-8.37	-3.37	-7.92	-11.61	-10.83	-12.40
除く20年国債	-8.42	-3.35	-7.92	-11.54	-10.87	-11.94
除く10年国債	-9.04	-3.31	-7.68	-11.57	-10.59	-11.91
除く5年国債	-9.22	-3.30	-8.10	-11.49	-10.81	-11.91
除く中期国債	-8.98	-3.51	-7.93	-11.49	-10.81	-11.91
除く地方債	-8.81	-3.35	-7.89	-11.51	-10.81	-11.92
除く東京都債	-8.80	-3.37	-7.93	-11.49	-10.81	-11.91
除く五大都市債	-8.80	-3.36	-7.93	-11.49	-10.81	-11.91
除くその他地方債	-8.80	-3.35	-7.90	-11.50	-10.81	-11.92
除く政保債	-8.80	-3.36	-7.93	-11.49	-10.81	-11.91
除く公営企業債券	-8.80	-3.37	-7.93	-11.49	-10.81	-11.91
除くその他政保債	-8.80	-3.37	-7.93	-11.49	-10.81	-11.91
除く金融債	-8.81	-3.37	-7.93	-11.49	-10.81	-11.91
除く特定金融債	-8.80	-3.37	-7.93	-11.49	-10.81	-11.91
除く事業債	-8.90	-3.37	-7.97	-11.52	-10.86	-11.92
除く円建外債	-8.82	-3.38	-7.94	-11.49	-10.81	-11.91
除くMBS	-8.80	-3.37	-7.93	-11.56	-10.81	-12.03
除くABS	-8.80	-3.37	-7.93	-11.49	-10.81	-11.91
除くMBS・ABS	-8.80	-3.37	-7.93	-11.56	-10.81	-12.03

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11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	-7.22	-3.34	-7.52	-10.75	-9.71	-11.65
水産・農林業	-6.79	-4.98	-7.11	-	-	-
鉱業	-6.67	-2.03	-9.08	-	-	-
建設業	-6.42	-3.79	-7.52	-10.73	-10.51	-11.03
食料品	-6.44	-3.03	-7.37	-10.85	-10.85	-10.86
繊維製品	-6.60	-4.19	-6.94	-11.21	-10.71	-11.65
パルプ・紙	-6.03	-2.76	-7.48	-10.31	-9.66	-10.72
化学	-7.28	-3.36	-7.53	-12.55	-10.07	-15.68
医薬品	-7.26	-2.66	-8.09	-10.54	-10.34	-10.59
石油・石炭製品	-8.06	-3.44	-8.10	-10.04	-9.95	-10.40
ゴム製品	-6.00	-3.39	-8.11	-10.34	-10.34	-
ガラス・土石製品	-7.07	-3.03	-7.35	-10.77	-10.76	-10.81
鉄鋼	-6.13	-3.05	-7.24	-10.43	-10.30	-11.05
非鉄金属	-6.32	-3.50	-7.73	-11.10	-11.10	-
金属製品	-6.28	-3.69	-7.70	-10.22	-10.22	-
機械	-6.82	-3.59	-7.63	-10.59	-10.59	-
電気機器	-6.31	-3.30	-7.62	-10.45	-10.45	-
輸送用機器	-6.40	-3.70	-7.85	-10.62	-10.52	-10.78
精密機器	-6.64	-3.35	-7.81	-10.16	-10.16	-
その他製品	-8.02	-2.82	-8.28	-11.20	-	-11.20
電気・ガス業	-6.84	-3.40	-6.48	-9.05	-7.34	-10.79
陸運業	-9.53	-3.18	-7.82	-11.96	-10.40	-12.72
海運業	-7.27	-2.34	-7.30	-10.58	-10.58	-
空運業	-7.38	-2.32	-7.23	-10.07	-9.96	-10.17
倉庫・運輸関連業	-7.85	-3.32	-7.63	-10.82	-10.37	-11.24
情報・通信業	-6.23	-3.81	-7.36	-9.33	-9.73	-8.34
卸売業	-7.91	-3.08	-7.58	-10.57	-10.38	-11.04
小売業	-9.18	-3.57	-9.87	-25.67	-29.81	-11.74
銀行業	-5.28	-2.81	-7.42	-10.37	-10.37	-
証券・商品先物取引業	-2.83	-2.01	-5.45	-7.45	-7.45	-
保険業	-5.16	-3.62	-6.19	-10.34	-10.34	-
その他金融業	-6.28	-3.68	-7.92	-10.27	-10.54	-8.06
不動産業	-7.81	-3.53	-7.52	-10.83	-10.42	-11.40
サービス業	-3.47	-2.02	-7.16	0.64	1.04	-1.59
財投機関債	-7.81	-3.29	-7.72	-11.38	-10.66	-11.73

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11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	-7.03	-3.24	-7.37	-10.68	-9.64	-11.59
AAA～A格	-7.04	-3.22	-7.38	-10.69	-9.65	-11.60
AAA～AA格	-7.36	-3.23	-7.49	-11.16	-10.25	-11.84
AAA格	-6.51	-3.18	-7.65	-11.97	-10.82	-13.96
AA格	-7.60	-3.25	-7.43	-11.07	-10.15	-11.69
A格	-6.27	-3.20	-7.13	-9.16	-8.23	-10.50
BBB格	-5.93	-4.33	-6.81	-8.95	-7.46	-10.38
事業債全体	-7.22	-3.34	-7.52	-10.75	-9.71	-11.65
AAA～A格	-7.22	-3.30	-7.51	-10.75	-9.71	-11.66
AAA～AA格	-7.47	-3.27	-7.58	-11.17	-10.28	-11.84
AAA格	-6.51	-3.18	-7.65	-11.97	-10.82	-13.96
AA格	-7.75	-3.31	-7.55	-11.08	-10.18	-11.69
A格	-6.56	-3.38	-7.35	-9.31	-8.31	-10.76
BBB格	-7.26	-6.04	-8.36	-10.21	-10.17	-10.23
円建外債全体	-3.57	-2.29	-4.64	-6.75	-6.43	-7.17
AAA～A格	-3.44	-2.33	-4.53	-6.25	-6.32	-6.16
AAA～AA格	-3.66	-2.55	-4.90	-7.16	-7.03	-8.95
AAA格	-	-	-	-	-	-
AA格	-3.66	-2.55	-4.90	-7.16	-7.03	-8.95
A格	-3.25	-2.14	-4.14	-6.01	-5.94	-6.06
BBB格	-4.52	-1.89	-5.26	-8.52	-6.85	-10.45

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11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	-7.47	-3.27	-7.58	-11.17	-10.28	-11.84
AAA~A格	-7.22	-3.30	-7.51	-10.75	-9.71	-11.66
AAA~BBB格	-7.22	-3.34	-7.52	-10.75	-9.71	-11.65
AAA~BB格	-7.22	-3.34	-7.52	-10.75	-9.71	-11.65
AAA格	-6.51	-3.18	-7.65	-11.97	-10.82	-13.96
AA格	-7.75	-3.31	-7.55	-11.08	-10.18	-11.69
A格	-6.56	-3.38	-7.35	-9.31	-8.31	-10.76
BBB格	-7.26	-6.04	-8.36	-10.21	-10.17	-10.23
BB格	-	-	-	-	-	-
B格以下	-	-	-	-	-	-
格付なし	-	-	-	-	-	-
円建外債						
AAA~AA格	-3.66	-2.55	-4.90	-7.16	-7.03	-8.95
AAA~A格	-3.44	-2.33	-4.53	-6.25	-6.32	-6.16
AAA~BBB格	-3.57	-2.29	-4.64	-6.75	-6.43	-7.17
AAA~BB格	-3.57	-2.29	-4.64	-6.75	-6.43	-7.17
AAA格	-	-	-	-	-	-
AA格	-3.66	-2.55	-4.90	-7.16	-7.03	-8.95
A格	-3.25	-2.14	-4.14	-6.01	-5.94	-6.06
BBB格	-4.52	-1.89	-5.26	-8.52	-6.85	-10.45
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11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	-7.46	-3.38	-7.78	-12.37	-12.12	-12.62
AAA~A格	-7.23	-3.31	-7.54	-10.80	-9.78	-11.68
AAA~BBB格	-7.23	-3.34	-7.53	-10.76	-9.71	-11.66
AAA~BB格	-7.22	-3.34	-7.52	-10.75	-9.71	-11.65
AAA格	-	-	-	-	-	-
AA格	-7.46	-3.38	-7.78	-12.37	-12.12	-12.62
A格	-7.18	-3.29	-7.48	-10.54	-9.35	-11.54
BBB格	-7.01	-4.40	-7.32	-9.13	-7.55	-10.84
BB格	-6.43	-	-6.29	-7.79	-	-7.79
B格以下	-	-	-	-	-	-
格付なし	-	-	-	-	-	-
円建外債						
AAA~AA格	-3.70	-2.81	-5.22	-7.16	-7.16	-
AAA~A格	-3.37	-2.27	-4.85	-5.69	-7.04	-3.94
AAA~BBB格	-3.57	-2.29	-4.64	-6.75	-6.43	-7.17
AAA~BB格	-3.57	-2.29	-4.64	-6.75	-6.43	-7.17
AAA格	-	-	-	-	-	-
AA格	-3.70	-2.81	-5.22	-7.16	-7.16	-
A格	-3.28	-2.11	-4.76	-5.53	-7.02	-3.94
BBB格	-3.85	-2.32	-4.41	-7.47	-6.02	-9.36
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11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	-7.72	-3.36	-7.67	-11.43	-10.68	-11.96
AAA~A 格	-7.35	-3.38	-7.54	-10.90	-9.91	-11.71
AAA~BBB 格	-7.35	-3.41	-7.54	-10.89	-9.91	-11.71
AAA~BB 格	-7.35	-3.41	-7.54	-10.89	-9.91	-11.71
AAA 格	-5.62	-3.37	-7.34	-10.87	-10.88	-10.84
AA 格	-7.77	-3.36	-7.68	-11.44	-10.67	-11.97
A 格	-6.67	-3.41	-7.34	-9.59	-8.52	-10.90
BBB 格	-7.16	-6.09	-7.89	-8.96	-7.78	-10.23
BB 格	-	-	-	-	-	-
B 格以下	-	-	-	-	-	-
格付なし	-5.92	-2.65	-7.29	-8.39	-7.28	-10.26
円建外債						
AAA~AA 格	-1.19	-1.19	-	-	-	-
AAA~A 格	-2.72	-1.50	-3.88	-6.88	-6.88	-
AAA~BBB 格	-2.79	-1.50	-3.88	-7.09	-6.88	-7.68
AAA~BB 格	-2.79	-1.50	-3.88	-7.09	-6.88	-7.68
AAA 格	-	-	-	-	-	-
AA 格	-1.19	-1.19	-	-	-	-
A 格	-2.79	-1.53	-3.88	-6.88	-6.88	-
BBB 格	-7.68	-	-	-7.68	-	-7.68
BB 格	-	-	-	-	-	-
B 格以下	-	-	-	-	-	-
格付なし	-3.76	-2.48	-4.86	-6.71	-6.36	-7.14

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11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	-6.71	-3.22	-7.49	-10.68	-10.02	-11.56
AAA~A 格	-6.61	-3.13	-7.36	-10.20	-9.38	-11.30
AAA~BBB 格	-6.60	-3.12	-7.36	-10.20	-9.38	-11.29
AAA~BB 格	-6.60	-3.12	-7.36	-10.20	-9.38	-11.29
AAA 格	-6.58	-3.16	-7.68	-11.97	-10.82	-13.96
AA 格	-6.79	-3.26	-7.36	-10.25	-9.71	-10.90
A 格	-6.37	-2.87	-7.05	-9.20	-8.07	-10.74
BBB 格	-4.89	-2.18	-6.79	-10.21	-10.17	-10.23
BB 格	-	-	-	-	-	-
B 格以下	-	-	-	-	-	-
格付なし	-8.16	-3.77	-7.82	-11.24	-10.16	-11.87
円建外債						
AAA~AA 格	-3.38	-2.51	-4.72	-7.06	-6.62	-8.95
AAA~A 格	-3.66	-2.55	-4.57	-6.27	-6.44	-6.16
AAA~BBB 格	-3.66	-2.55	-4.57	-6.27	-6.44	-6.16
AAA~BB 格	-3.66	-2.55	-4.57	-6.27	-6.44	-6.16
AAA 格	-	-	-	-	-	-
AA 格	-3.38	-2.51	-4.72	-7.06	-6.62	-8.95
A 格	-3.75	-2.57	-4.51	-6.18	-6.39	-6.06
BBB 格	-4.38	-	-4.38	-	-	-
BB 格	-	-	-	-	-	-
B 格以下	-	-	-	-	-	-
格付なし	-3.53	-2.16	-4.66	-7.36	-6.42	-10.45

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11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	-7.50	-3.33	-7.47	-10.82	-9.78	-11.48
AAA~BBB格	-7.47	-3.34	-7.41	-10.71	-9.61	-11.43
AAA~BB格	-7.47	-3.34	-7.41	-10.71	-9.61	-11.43
AAA格	-	-	-	-	-	-
AA格	-	-	-	-	-	-
A格	-7.50	-3.33	-7.47	-10.82	-9.78	-11.48
BBB格	-7.09	-3.44	-6.94	-9.08	-7.53	-10.62
BB格	-	-	-	-	-	-
B格以下	-	-	-	-	-	-
格付なし	-7.08	-3.33	-7.57	-10.78	-9.77	-11.87
円建外債						
AAA~AA格	-3.69	-2.50	-4.93	-7.16	-7.16	-
AAA~A格	-3.39	-2.31	-4.80	-5.38	-6.32	-3.94
AAA~BBB格	-3.73	-2.44	-4.76	-6.75	-6.43	-7.17
AAA~BB格	-3.73	-2.44	-4.76	-6.75	-6.43	-7.17
AAA格	-	-	-	-	-	-
AA格	-3.69	-2.50	-4.93	-7.16	-7.16	-
A格	-2.98	-2.08	-4.49	-4.70	-5.60	-3.94
BBB格	-4.27	-2.73	-4.71	-7.86	-6.53	-9.36
BB格	-	-	-	-	-	-
B格以下	-	-	-	-	-	-
格付なし	0.42	0.29	0.95	-	-	-

出所:NFRC

- 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NFRCで分類

事業債 円建外債 S&P 格付別・月間投資収益率(2024年11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	-10.69	-3.43	-8.28	-11.68	-10.37	-12.46
AAA~A格	-7.97	-3.24	-7.75	-11.40	-10.26	-12.39
AAA~BBB格	-7.95	-3.24	-7.73	-11.40	-10.26	-12.39
AAA~BB格	-7.92	-3.24	-7.67	-11.38	-10.26	-12.35
AAA格	-	-	-	-	-	-
AA格	-10.69	-3.43	-8.28	-11.68	-10.37	-12.46
A格	-7.83	-3.24	-7.74	-11.37	-10.25	-12.38
BBB格	-6.43	-2.82	-6.87	-10.66	-10.49	-11.05
BB格	-6.43	-	-6.29	-7.79	-	-7.79
B格以下	-	-	-	-	-	-
格付なし	-7.01	-3.36	-7.47	-10.50	-9.49	-11.37
円建外債						
AAA~AA格	-3.85	-3.06	-5.24	-7.16	-7.16	-
AAA~A格	-3.41	-2.33	-4.79	-5.67	-7.05	-3.94
AAA~BBB格	-3.61	-2.33	-4.64	-6.75	-6.43	-7.17
AAA~BB格	-3.61	-2.33	-4.64	-6.75	-6.43	-7.17
AAA格	-	-	-	-	-	-
AA格	-3.85	-3.06	-5.24	-7.16	-7.16	-
A格	-3.28	-2.09	-4.68	-5.51	-7.02	-3.94
BBB格	-3.89	-2.34	-4.45	-7.47	-6.02	-9.36
BB格	-	-	-	-	-	-
B格以下	-	-	-	-	-	-
格付なし	-1.35	-0.75	-5.20	-6.82	-6.82	-

出所:NFRC

- 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NFRC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11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	1,156,141	95.54	95.78	10.15	0.82	1.11	1.07	8.61	8.55	8.57	4
短期 (1-3)	230,590	99.62	99.75	1.87	0.41	0.61	0.61	1.86	1.85	1.86	6
中期 (3-7)	315,609	99.71	99.90	4.72	0.66	0.73	0.73	4.64	4.62	4.64	5
長期 (7-)	609,942	91.85	92.14	16.10	1.05	1.52	1.46	13.60	13.49	13.52	4
長期 (7-11)	211,563	100.72	101.03	8.64	1.02	0.95	0.95	8.26	8.22	8.26	3
超長期 (11-)	398,378	87.14	87.42	20.05	1.07	1.87	1.77	16.88	16.73	16.74	4
(11-15)	96,096	95.29	95.55	12.85	0.97	1.39	1.36	12.02	11.94	12.00	4
(15-)	302,282	84.55	84.84	22.35	1.11	2.05	1.91	18.62	18.44	18.44	4
国債	981,997	95.47	95.72	10.65	0.84	1.10	1.06	8.99	8.92	8.94	1
短期 (1-3)	189,298	99.71	99.84	1.85	0.40	0.56	0.56	1.84	1.83	1.84	1
中期 (3-7)	256,590	100.01	100.21	4.71	0.67	0.69	0.69	4.63	4.62	4.63	0
長期 (7-)	536,109	91.80	92.11	16.61	1.08	1.53	1.45	13.99	13.88	13.89	1
長期 (7-11)	184,416	101.04	101.36	8.65	1.03	0.91	0.92	8.26	8.22	8.26	0
超長期 (11-)	351,693	86.96	87.26	20.78	1.10	1.91	1.78	17.48	17.32	17.32	1
(11-15)	83,973	95.83	96.10	12.91	0.99	1.36	1.33	12.07	11.99	12.06	1
(15-)	267,720	84.17	84.49	23.25	1.14	2.11	1.93	19.41	19.22	19.20	1
地方債	66,945	96.65	96.80	7.30	0.62	0.98	0.99	6.73	6.68	6.70	12
短期 (1-3)	12,686	99.40	99.51	1.99	0.36	0.68	0.67	1.98	1.97	1.98	12
中期 (3-7)	24,974	98.43	98.55	4.91	0.50	0.81	0.80	4.84	4.82	4.84	11
長期 (7-)	29,286	93.94	94.13	11.65	0.83	1.28	1.31	10.58	10.51	10.53	12
政保債	14,230	95.52	95.68	9.31	0.75	1.10	1.06	8.00	7.94	7.97	7
短期 (1-3)	3,311	99.14	99.19	2.04	0.20	0.63	0.63	2.04	2.03	2.04	7
中期 (3-7)	4,172	99.88	100.05	4.44	0.66	0.74	0.74	4.37	4.35	4.37	6
長期 (7-)	6,747	91.04	91.26	15.90	1.07	1.59	1.50	13.65	13.53	13.58	8
金融債	3,391	98.36	98.43	3.10	0.32	0.89	0.88	3.06	3.04	3.06	27
短期 (1-3)	1,976	98.78	98.82	1.98	0.18	0.81	0.81	1.97	1.96	1.97	25
中期 (3-7)	1,247	98.02	98.13	4.21	0.48	0.96	0.95	4.16	4.14	4.16	28
長期 (7-)	168	95.89	96.13	8.10	0.71	1.30	1.28	7.85	7.80	7.85	41
事業債	71,165	95.48	95.68	7.33	0.75	1.28	1.24	6.24	6.19	6.21	39
短期 (1-3)	21,079	99.17	99.30	1.94	0.47	0.92	0.92	1.93	1.92	1.93	36
中期 (3-7)	26,893	98.17	98.36	4.66	0.69	1.09	1.08	4.58	4.55	4.58	39
長期 (7-)	23,193	89.01	89.28	15.32	1.08	1.89	1.77	12.72	12.60	12.62	43
長期 (7-11)	9,812	97.60	97.89	8.65	1.08	1.40	1.38	8.24	8.19	8.24	46
超長期 (11-)	13,381	82.70	82.97	20.20	1.08	2.31	2.10	16.59	16.41	16.41	40
円建外債	3,847	98.84	99.11	3.69	1.08	1.43	1.42	3.51	3.48	3.51	77
短期 (1-3)	2,071	99.32	99.57	2.13	0.96	1.29	1.28	2.10	2.09	2.10	72
中期 (3-7)	1,416	98.44	98.71	4.10	1.03	1.44	1.43	4.00	3.97	4.00	76
長期 (7-)	360	97.69	98.03	11.11	1.92	2.21	2.19	9.79	9.68	9.76	106
長期 (7-11)	204	97.75	98.10	8.64	1.60	1.93	1.91	8.05	7.97	8.04	100
超長期 (11-)	157	97.61	97.95	14.34	2.35	2.57	2.54	12.06	11.91	11.99	115
MBS	13,914	94.25	94.28	7.39	0.63	0.88	1.38	6.86	6.81	7.20	22
ABS	652	95.31	95.50	5.88	0.74	1.48	1.44	5.46	5.41	5.45	68
短期 (1-3)	170	98.86	99.05	2.07	0.66	1.21	1.21	2.05	2.04	2.05	64
中期 (3-7)	318	96.47	96.63	5.10	0.67	1.38	1.36	5.00	4.96	5.00	66
長期 (7-)	165	89.44	89.69	11.32	0.94	2.00	1.88	10.29	10.19	10.28	75

出所:NFRIC

「除く」銘柄 残存別・ポートフォリオ指標 (2024年11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	1,142,227	95.56	95.80	10.19	0.82	1.11	1.07	8.63	8.57	8.58	4
短期 (1-3)	230,590	99.62	99.75	1.87	0.41	0.61	0.61	1.86	1.85	1.86	6
中期 (3-7)	315,609	99.71	99.90	4.72	0.66	0.73	0.73	4.64	4.62	4.64	5
長期 (7-)	596,027	91.79	92.09	16.30	1.06	1.54	1.46	13.76	13.65	13.67	3
長期 (7-11)	211,388	100.72	101.03	8.65	1.02	0.95	0.95	8.26	8.22	8.26	3
超長期 (11-)	384,639	86.89	87.18	20.50	1.09	1.91	1.78	17.27	17.11	17.11	3
(11-15)	96,096	95.29	95.55	12.85	0.97	1.39	1.36	12.02	11.94	12.00	4
(15-)	288,543	84.09	84.39	23.05	1.13	2.11	1.94	19.25	19.06	19.03	3
除く ABS	1,155,489	95.54	95.78	10.15	0.82	1.11	1.07	8.61	8.55	8.57	4
短期 (1-3)	230,420	99.62	99.75	1.87	0.41	0.61	0.61	1.86	1.85	1.86	6
中期 (3-7)	315,292	99.71	99.91	4.72	0.66	0.73	0.73	4.64	4.62	4.64	5
長期 (7-)	609,777	91.85	92.14	16.10	1.05	1.52	1.46	13.60	13.49	13.52	4
長期 (7-11)	211,477	100.72	101.03	8.64	1.02	0.95	0.95	8.26	8.22	8.26	3
超長期 (11-)	398,300	87.14	87.42	20.05	1.07	1.87	1.77	16.88	16.73	16.74	4
(11-15)	96,038	95.30	95.56	12.85	0.97	1.39	1.36	12.02	11.94	12.00	4
(15-)	302,261	84.55	84.84	22.35	1.11	2.05	1.91	18.62	18.44	18.44	4
除く MBS・ABS	1,141,575	95.56	95.80	10.19	0.82	1.11	1.07	8.63	8.57	8.58	4
短期 (1-3)	230,420	99.62	99.75	1.87	0.41	0.61	0.61	1.86	1.85	1.86	6
中期 (3-7)	315,292	99.71	99.91	4.72	0.66	0.73	0.73	4.64	4.62	4.64	5
長期 (7-)	595,863	91.79	92.09	16.30	1.06	1.54	1.46	13.76	13.65	13.67	3
長期 (7-11)	211,302	100.72	101.04	8.65	1.02	0.95	0.95	8.26	8.22	8.26	3
超長期 (11-)	384,560	86.89	87.18	20.50	1.09	1.91	1.78	17.27	17.11	17.11	3
(11-15)	96,038	95.30	95.56	12.85	0.97	1.39	1.36	12.02	11.94	12.00	4
(15-)	288,522	84.09	84.39	23.05	1.13	2.11	1.94	19.25	19.06	19.03	3
除く 国債	174,144	95.96	96.13	7.32	0.69	1.12	1.14	6.49	6.45	6.49	26
短期 (1-3)	41,292	99.23	99.34	1.97	0.43	0.84	0.83	1.96	1.95	1.96	28
中期 (3-7)	59,019	98.39	98.55	4.73	0.61	0.95	0.94	4.65	4.63	4.65	26
長期 (7-)	73,833	92.19	92.39	12.37	0.90	1.42	1.49	10.78	10.69	10.79	24
長期 (7-11)	27,148	98.55	98.80	8.60	0.97	1.17	1.16	8.23	8.19	8.23	25
超長期 (11-)	46,685	88.50	88.66	14.57	0.85	1.59	1.69	12.43	12.32	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11月末、12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	1,144,331	95.49	95.73	10.34	0.83	1.12	1.09	8.77	8.71	8.73	4
短期 (1-3)	231,067	99.59	99.71	2.07	0.41	0.62	0.62	2.06	2.06	2.06	6
中期 (3-7)	311,265	99.68	99.88	4.94	0.67	0.75	0.75	4.85	4.84	4.85	5
長期 (7-)	602,000	91.75	92.05	16.30	1.07	1.54	1.47	13.76	13.65	13.67	4
長期 (7-11)	207,080	100.80	101.12	8.84	1.05	0.96	0.97	8.42	8.38	8.42	3
超長期 (11-)	394,920	87.00	87.29	20.21	1.08	1.89	1.78	17.01	16.85	16.86	4
(11-15)	93,886	94.53	94.76	13.04	0.93	1.41	1.38	12.23	12.14	12.21	4
(15-)	301,034	84.66	84.95	22.44	1.12	2.05	1.92	18.67	18.49	18.48	4
国債	970,600	95.41	95.66	10.86	0.85	1.12	1.08	9.17	9.10	9.11	1
短期 (1-3)	189,830	99.68	99.80	2.07	0.41	0.57	0.57	2.06	2.05	2.06	1
中期 (3-7)	252,456	100.00	100.21	4.97	0.68	0.70	0.70	4.87	4.86	4.87	0
長期 (7-)	528,313	91.69	91.99	16.83	1.09	1.55	1.47	14.17	14.06	14.07	1
長期 (7-11)	180,067	101.12	101.45	8.85	1.06	0.93	0.94	8.44	8.40	8.43	0
超長期 (11-)	348,246	86.80	87.10	20.96	1.10	1.93	1.79	17.63	17.46	17.46	1
(11-15)	81,733	94.99	95.23	13.13	0.94	1.39	1.35	12.30	12.22	12.28	1
(15-)	266,514	84.29	84.61	23.36	1.15	2.11	1.94	19.47	19.27	19.25	1
地方債	66,825	96.63	96.78	7.41	0.62	0.99	1.00	6.82	6.78	6.80	12
短期 (1-3)	12,884	99.38	99.48	2.13	0.37	0.68	0.68	2.12	2.11	2.12	12
中期 (3-7)	24,731	98.36	98.48	5.04	0.50	0.82	0.81	4.97	4.95	4.97	11
長期 (7-)	29,210	93.95	94.15	11.74	0.84	1.29	1.32	10.66	10.58	10.61	12
政保債	14,373	95.55	95.71	9.33	0.75	1.10	1.06	8.02	7.97	7.99	7
短期 (1-3)	3,441	99.12	99.18	2.14	0.21	0.64	0.64	2.13	2.13	2.13	7
中期 (3-7)	4,157	99.95	100.11	4.54	0.68	0.75	0.75	4.46	4.45	4.46	7
長期 (7-)	6,775	91.03	91.25	15.92	1.07	1.60	1.50	13.67	13.56	13.60	8
金融債	3,376	98.34	98.42	3.20	0.33	0.90	0.89	3.15	3.14	3.15	27
短期 (1-3)	1,968	98.74	98.78	2.06	0.19	0.82	0.81	2.05	2.04	2.05	25
中期 (3-7)	1,249	97.96	98.08	4.34	0.50	0.97	0.96	4.28	4.26	4.28	28
長期 (7-)	159	96.40	96.66	8.39	0.82	1.33	1.30	8.09	8.03	8.08	41
事業債	70,594	95.44	95.64	7.48	0.77	1.29	1.25	6.38	6.33	6.35	40
短期 (1-3)	20,594	99.13	99.26	2.09	0.49	0.93	0.93	2.07	2.07	2.07	36
中期 (3-7)	26,948	98.07	98.26	4.79	0.70	1.11	1.10	4.70	4.67	4.70	41
長期 (7-)	23,052	89.06	89.34	15.43	1.09	1.89	1.76	12.81	12.68	12.71	42
長期 (7-11)	9,682	97.89	98.17	8.78	1.11	1.38	1.37	8.35	8.29	8.35	44
超長期 (11-)	13,370	82.67	82.94	20.25	1.08	2.32	2.11	16.63	16.45	16.44	40
円建外債	3,950	98.83	99.08	3.78	1.09	1.44	1.43	3.59	3.57	3.59	77
短期 (1-3)	2,174	99.28	99.52	2.26	0.97	1.30	1.29	2.23	2.21	2.23	72
中期 (3-7)	1,411	98.39	98.64	4.21	1.05	1.46	1.45	4.11	4.08	4.11	78
長期 (7-)	365	97.83	98.17	11.17	1.95	2.21	2.18	9.83	9.72	9.80	106
長期 (7-11)	208	97.99	98.34	8.78	1.64	1.93	1.92	8.16	8.08	8.16	99
超長期 (11-)	157	97.61	97.95	14.34	2.35	2.57	2.54	12.06	11.91	11.99	115
MBS	13,960	94.27	94.30	7.43	0.63	0.88	1.38	6.90	6.85	7.23	22
ABS	655	95.33	95.52	5.94	0.74	1.48	1.44	5.51	5.47	5.51	68
短期 (1-3)	176	98.76	98.95	2.16	0.64	1.22	1.21	2.14	2.13	2.14	64
中期 (3-7)	313	96.43	96.59	5.19	0.68	1.38	1.36	5.08	5.05	5.08	66
長期 (7-)	166	89.59	89.84	11.37	0.96	2.00	1.88	10.33	10.23	10.31	75

出所:NFRIC

「除く」銘柄残存別・ポートフォリオ指標(2024年11月末、12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	1,130,372	95.51	95.74	10.37	0.83	1.12	1.08	8.80	8.73	8.75	4
短期(1-3)	231,067	99.59	99.71	2.07	0.41	0.62	0.62	2.06	2.06	2.06	6
中期(3-7)	311,265	99.68	99.88	4.94	0.67	0.75	0.75	4.85	4.84	4.85	5
長期(7-)	588,040	91.69	91.99	16.51	1.08	1.55	1.47	13.93	13.82	13.83	3
長期(7-11)	206,905	100.81	101.13	8.84	1.05	0.96	0.97	8.43	8.39	8.43	3
超長期(11-)	381,135	86.74	87.03	20.67	1.09	1.92	1.79	17.40	17.24	17.24	3
(11-15)	93,886	94.53	94.76	13.04	0.93	1.41	1.38	12.23	12.14	12.21	4
(15-)	287,249	84.20	84.51	23.16	1.14	2.11	1.94	19.30	19.11	19.08	3
除く ABS	1,143,676	95.49	95.73	10.34	0.83	1.12	1.09	8.78	8.71	8.73	4
短期(1-3)	230,891	99.59	99.72	2.07	0.41	0.62	0.62	2.06	2.06	2.06	6
中期(3-7)	310,951	99.68	99.88	4.94	0.67	0.75	0.74	4.85	4.84	4.85	5
長期(7-)	601,834	91.75	92.05	16.30	1.07	1.54	1.47	13.76	13.65	13.67	4
長期(7-11)	206,987	100.81	101.13	8.84	1.05	0.96	0.97	8.42	8.38	8.42	3
超長期(11-)	394,847	87.01	87.29	20.21	1.08	1.89	1.78	17.01	16.85	16.87	4
(11-15)	93,835	94.53	94.77	13.05	0.93	1.41	1.38	12.23	12.14	12.21	4
(15-)	301,013	84.66	84.95	22.44	1.12	2.05	1.92	18.67	18.49	18.48	4
除く MBS・ABS	1,129,716	95.51	95.74	10.38	0.83	1.12	1.08	8.80	8.73	8.75	4
短期(1-3)	230,891	99.59	99.72	2.07	0.41	0.62	0.62	2.06	2.06	2.06	6
中期(3-7)	310,951	99.68	99.88	4.94	0.67	0.75	0.74	4.85	4.84	4.85	5
長期(7-)	587,874	91.69	91.99	16.51	1.08	1.55	1.47	13.93	13.82	13.83	3
長期(7-11)	206,812	100.81	101.13	8.84	1.05	0.96	0.97	8.43	8.39	8.43	3
超長期(11-)	381,062	86.74	87.03	20.67	1.09	1.92	1.79	17.40	17.24	17.24	3
(11-15)	93,835	94.53	94.77	13.05	0.93	1.41	1.38	12.23	12.14	12.21	4
(15-)	287,228	84.20	84.51	23.16	1.14	2.11	1.94	19.30	19.11	19.08	3
除く国債	173,731	95.94	96.11	7.43	0.70	1.12	1.15	6.59	6.55	6.60	25
短期(1-3)	41,237	99.20	99.31	2.11	0.44	0.84	0.84	2.10	2.09	2.10	28
中期(3-7)	58,808	98.32	98.48	4.86	0.62	0.97	0.96	4.77	4.75	4.77	27
長期(7-)	73,686	92.23	92.42	12.45	0.91	1.42	1.49	10.84	10.75	10.85	23
長期(7-11)	27,013	98.67	98.92	8.72	0.99	1.17	1.17	8.33	8.28	8.33	24
超長期(11-)	46,674	88.50	88.66	14.61	0.86	1.59	1.70	12.47	12.35	12.48	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11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	71,165	95.48	95.68	7.33	0.75	1.28	1.24	6.24	6.19	6.21	39
短期 (1-3)	21,079	99.17	99.30	1.94	0.47	0.92	0.92	1.93	1.92	1.93	36
中期 (3-7)	26,893	98.17	98.36	4.66	0.69	1.09	1.08	4.58	4.55	4.58	39
長期 (7-)	23,193	89.01	89.28	15.32	1.08	1.89	1.77	12.72	12.60	12.62	43
長期 (7-11)	9,812	97.60	97.89	8.65	1.08	1.40	1.38	8.24	8.19	8.24	46
超長期 (11-)	13,381	82.70	82.97	20.20	1.08	2.31	2.10	16.59	16.41	16.41	40
水産・農林業	33	98.89	99.02	3.92	0.86	1.16	1.16	3.86	3.84	3.86	50
短期 (1-3)	5	98.52	98.57	2.93	0.55	1.07	1.06	2.91	2.89	2.91	46
中期 (3-7)	28	98.96	99.10	4.10	0.91	1.18	1.17	4.03	4.00	4.03	50
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
鉱業	30	96.23	96.27	4.82	0.21	1.01	0.99	4.73	4.70	4.73	32
短期 (1-3)	10	99.08	99.10	1.29	0.08	0.80	0.79	1.29	1.29	1.29	28
中期 (3-7)	20	94.81	94.85	6.58	0.28	1.12	1.09	6.52	6.49	6.52	35
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
建設業	1,260	97.47	97.65	4.36	0.52	1.08	1.06	4.19	4.17	4.19	38
短期 (1-3)	490	98.83	98.96	2.25	0.36	0.91	0.91	2.24	2.23	2.24	33
中期 (3-7)	620	97.75	97.93	4.51	0.59	1.10	1.09	4.44	4.42	4.44	41
長期 (7-)	150	91.89	92.20	10.58	0.75	1.58	1.51	9.95	9.87	9.94	43
長期 (7-11)	84	96.06	96.36	8.12	0.78	1.33	1.30	7.85	7.80	7.85	44
超長期 (11-)	66	86.58	86.90	13.72	0.71	1.93	1.80	12.91	12.80	12.89	41
食料品	1,494	97.44	97.57	4.97	0.53	1.08	1.07	4.69	4.66	4.68	34
短期 (1-3)	592	98.94	99.04	1.87	0.29	0.86	0.86	1.87	1.86	1.87	31
中期 (3-7)	547	97.67	97.78	4.38	0.47	1.03	1.02	4.33	4.31	4.33	35
長期 (7-)	355	94.59	94.80	11.03	1.00	1.55	1.50	10.19	10.11	10.16	39
長期 (7-11)	215	97.48	97.68	8.60	0.95	1.28	1.27	8.25	8.20	8.25	36
超長期 (11-)	140	90.15	90.37	14.76	1.09	1.98	1.89	13.40	13.27	13.34	43
繊維製品	225	97.32	97.46	4.69	0.53	1.10	1.08	4.47	4.44	4.47	37
短期 (1-3)	80	98.71	98.83	2.43	0.33	0.88	0.88	2.42	2.41	2.42	30
中期 (3-7)	109	97.97	98.11	4.07	0.52	1.05	1.04	4.02	4.00	4.02	38
長期 (7-)	36	92.30	92.47	11.56	1.03	1.75	1.68	10.76	10.67	10.75	50
長期 (7-11)	16	98.85	98.87	8.99	1.29	1.44	1.43	8.51	8.45	8.50	48
超長期 (11-)	20	87.05	87.35	13.63	0.83	2.05	1.91	12.80	12.68	12.78	52
パルプ・紙	329	96.10	96.22	4.87	0.44	1.24	1.21	4.58	4.54	4.57	49
短期 (1-3)	129	98.64	98.70	1.81	0.28	1.05	1.04	1.80	1.79	1.80	49
中期 (3-7)	145	96.30	96.43	4.76	0.43	1.19	1.17	4.68	4.65	4.68	48
長期 (7-)	55	89.61	89.88	12.30	0.86	1.86	1.76	11.40	11.29	11.38	52
長期 (7-11)	20	95.71	96.09	8.04	0.83	1.47	1.44	7.74	7.69	7.74	58
超長期 (11-)	35	86.12	86.33	14.74	0.88	2.11	1.96	13.72	13.59	13.69	48
化学	2,403	95.82	95.99	5.37	0.53	1.22	1.18	4.99	4.95	4.98	44
短期 (1-3)	757	98.88	98.99	2.03	0.34	0.91	0.91	2.01	2.01	2.01	35
中期 (3-7)	1,078	97.35	97.51	4.57	0.51	1.10	1.09	4.51	4.48	4.51	40
長期 (7-)	568	88.82	89.09	11.36	0.82	1.92	1.80	10.39	10.29	10.37	67
長期 (7-11)	295	95.74	96.03	8.00	0.81	1.44	1.41	7.73	7.68	7.73	55
超長期 (11-)	273	81.34	81.60	14.97	0.83	2.54	2.30	13.77	13.61	13.74	82
医薬品	848	96.15	96.29	5.83	0.56	1.18	1.15	5.49	5.45	5.48	40
短期 (1-3)	178	99.18	99.27	1.61	0.30	0.82	0.81	1.61	1.60	1.61	28
中期 (3-7)	545	96.65	96.77	5.55	0.56	1.15	1.13	5.44	5.41	5.44	42
長期 (7-)	125	89.70	89.99	13.04	0.94	1.86	1.76	11.78	11.67	11.74	48
長期 (7-11)	25	97.18	97.40	8.59	1.05	1.43	1.41	8.21	8.15	8.20	50
超長期 (11-)	100	87.82	88.14	14.15	0.91	1.98	1.85	12.77	12.64	12.72	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11月末、12月ポートフォリオ)

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
事業債 全体	70,594	95.44	95.64	7.48	0.77	1.29	1.25	6.38	6.33	6.35	40
短期 (1-3)	20,594	99.13	99.26	2.09	0.49	0.93	0.93	2.07	2.07	2.07	36
中期 (3-7)	26,948	98.07	98.26	4.79	0.70	1.11	1.10	4.70	4.67	4.70	41
長期 (7-)	23,052	89.06	89.34	15.43	1.09	1.89	1.76	12.81	12.68	12.71	42
長期 (7-11)	9,682	97.89	98.17	8.78	1.11	1.38	1.37	8.35	8.29	8.35	44
超長期 (11-)	13,370	82.67	82.94	20.25	1.08	2.32	2.11	16.63	16.45	16.44	40
水産・農林業	33	98.89	99.02	3.92	0.86	1.16	1.16	3.86	3.84	3.86	50
短期 (1-3)	5	98.52	98.57	2.93	0.55	1.07	1.06	2.91	2.89	2.91	46
中期 (3-7)	28	98.96	99.10	4.10	0.91	1.18	1.17	4.03	4.00	4.03	50
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
鉱業	30	96.23	96.27	4.82	0.21	1.01	0.99	4.73	4.70	4.73	32
短期 (1-3)	10	99.08	99.10	1.29	0.08	0.80	0.79	1.29	1.29	1.29	28
中期 (3-7)	20	94.81	94.85	6.58	0.28	1.12	1.09	6.52	6.49	6.52	35
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
建設業	1,255	97.47	97.64	4.37	0.52	1.08	1.06	4.21	4.18	4.21	38
短期 (1-3)	510	98.80	98.93	2.30	0.36	0.91	0.91	2.29	2.28	2.29	33
中期 (3-7)	595	97.73	97.91	4.58	0.60	1.11	1.09	4.50	4.48	4.50	41
長期 (7-)	150	91.89	92.20	10.58	0.75	1.58	1.51	9.95	9.87	9.94	43
長期 (7-11)	84	96.06	96.36	8.12	0.78	1.33	1.30	7.85	7.80	7.85	44
超長期 (11-)	66	86.58	86.90	13.72	0.71	1.93	1.80	12.91	12.80	12.89	41
食料品	1,566	97.52	97.64	5.12	0.55	1.08	1.07	4.85	4.82	4.84	33
短期 (1-3)	584	98.88	98.98	1.96	0.28	0.86	0.86	1.95	1.94	1.95	30
中期 (3-7)	607	97.86	97.97	4.56	0.52	1.02	1.01	4.50	4.47	4.50	33
長期 (7-)	375	94.83	95.03	10.97	1.02	1.54	1.50	10.14	10.06	10.11	39
長期 (7-11)	235	97.62	97.81	8.71	0.98	1.30	1.28	8.34	8.29	8.34	36
超長期 (11-)	140	90.15	90.37	14.76	1.09	1.98	1.89	13.40	13.27	13.34	43
繊維製品	225	97.32	97.46	4.69	0.53	1.10	1.08	4.47	4.44	4.47	37
短期 (1-3)	80	98.71	98.83	2.43	0.33	0.88	0.88	2.42	2.41	2.42	30
中期 (3-7)	109	97.97	98.11	4.07	0.52	1.05	1.04	4.02	4.00	4.02	38
長期 (7-)	36	92.30	92.47	11.56	1.03	1.75	1.68	10.76	10.67	10.75	50
長期 (7-11)	16	98.85	98.87	8.99	1.29	1.44	1.43	8.51	8.45	8.50	48
超長期 (11-)	20	87.05	87.35	13.63	0.83	2.05	1.91	12.80	12.68	12.78	52
パルプ・紙	329	96.10	96.22	4.87	0.44	1.24	1.21	4.58	4.54	4.57	49
短期 (1-3)	144	98.63	98.71	1.94	0.31	1.04	1.04	1.93	1.92	1.93	48
中期 (3-7)	140	95.85	95.96	5.10	0.41	1.22	1.20	5.02	4.99	5.02	50
長期 (7-)	45	88.80	89.10	13.47	0.98	1.98	1.86	12.43	12.31	12.41	51
長期 (7-11)	10	98.17	98.79	9.04	1.34	1.58	1.56	8.48	8.42	8.48	61
超長期 (11-)	35	86.12	86.33	14.74	0.88	2.11	1.96	13.72	13.59	13.69	48
化学	2,303	95.66	95.83	5.56	0.54	1.24	1.20	5.17	5.13	5.16	45
短期 (1-3)	747	98.73	98.84	2.28	0.36	0.95	0.94	2.27	2.26	2.27	36
中期 (3-7)	1,063	96.99	97.14	4.88	0.51	1.14	1.12	4.80	4.77	4.80	43
長期 (7-)	493	88.15	88.43	12.02	0.88	1.99	1.86	10.95	10.85	10.93	66
長期 (7-11)	220	96.60	96.92	8.34	0.94	1.42	1.39	8.01	7.95	8.00	51
超長期 (11-)	273	81.34	81.60	14.97	0.83	2.54	2.30	13.77	13.61	13.74	82
医薬品	818	96.03	96.17	6.01	0.57	1.19	1.17	5.66	5.62	5.65	40
短期 (1-3)	168	99.05	99.14	1.89	0.33	0.84	0.84	1.88	1.87	1.88	28
中期 (3-7)	525	96.57	96.69	5.65	0.56	1.16	1.14	5.54	5.51	5.54	42
長期 (7-)	125	89.70	89.99	13.04	0.94	1.86	1.76	11.78	11.67	11.74	48
長期 (7-11)	25	97.18	97.40	8.59	1.05	1.43	1.41	8.21	8.15	8.20	50
超長期 (11-)	100	87.82	88.14	14.15	0.91	1.98	1.85	12.77	12.64	12.72	48

出所:NFRG

- 東証 33 業種分類を参考に NFRG で分類

事業債 業種別・ポートフォリオ指標 (2/4) (2024年11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	95.74	95.97	6.45	0.60	1.30	1.27	6.10	6.06	6.10	49
短期 (1-3)	50	98.76	98.85	2.08	0.30	0.93	0.92	2.07	2.06	2.07	36
中期 (3-7)	95	95.97	96.06	5.36	0.39	1.17	1.14	5.28	5.25	5.28	44
長期 (7-)	120	94.29	94.69	9.14	0.90	1.57	1.52	8.52	8.45	8.51	58
長期 (7-11)	95	96.14	96.51	7.55	0.84	1.40	1.38	7.30	7.25	7.30	57
超長期 (11-)	25	87.28	87.76	15.19	1.13	2.27	2.13	13.63	13.48	13.57	63
ゴム製品	330	97.80	97.88	3.61	0.39	1.01	1.00	3.55	3.53	3.55	36
短期 (1-3)	158	98.83	98.88	2.03	0.30	0.89	0.89	2.03	2.02	2.03	33
中期 (3-7)	147	97.06	97.14	4.59	0.41	1.08	1.07	4.54	4.52	4.54	38
長期 (7-)	25	95.64	95.89	7.83	0.76	1.39	1.36	7.59	7.54	7.59	52
長期 (7-11)	25	95.64	95.89	7.83	0.76	1.39	1.36	7.59	7.54	7.59	52
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
ガラス・土石製品	282	96.23	96.39	5.47	0.54	1.20	1.17	5.13	5.10	5.13	42
短期 (1-3)	83	98.89	98.94	1.86	0.27	0.88	0.88	1.85	1.84	1.85	34
中期 (3-7)	112	97.39	97.52	4.32	0.49	1.11	1.10	4.27	4.24	4.26	42
長期 (7-)	87	92.21	92.50	10.36	0.87	1.65	1.57	9.63	9.55	9.62	52
長期 (7-11)	62	96.47	96.79	8.53	0.89	1.37	1.35	8.20	8.14	8.20	44
超長期 (11-)	25	81.60	81.83	14.92	0.80	2.46	2.22	13.86	13.70	13.83	73
鉄鋼	458	97.86	98.02	4.02	0.53	1.10	1.09	3.90	3.87	3.89	42
短期 (1-3)	160	98.83	98.92	1.90	0.28	0.91	0.91	1.89	1.88	1.89	35
中期 (3-7)	245	97.73	97.92	4.22	0.57	1.12	1.11	4.16	4.14	4.16	44
長期 (7-)	53	95.51	95.80	9.46	1.09	1.58	1.54	8.87	8.80	8.87	56
長期 (7-11)	43	97.67	97.92	8.51	1.12	1.43	1.42	8.11	8.05	8.10	52
超長期 (11-)	10	86.24	86.68	13.54	0.95	2.28	2.13	12.59	12.46	12.57	75
非鉄金属	380	97.76	97.89	4.11	0.47	1.08	1.07	4.02	4.00	4.02	40
短期 (1-3)	165	98.63	98.71	2.14	0.30	0.97	0.96	2.13	2.12	2.13	39
中期 (3-7)	165	97.27	97.39	4.71	0.55	1.14	1.12	4.64	4.61	4.64	43
長期 (7-)	50	96.49	96.80	8.62	0.81	1.26	1.24	8.31	8.26	8.31	33
長期 (7-11)	50	96.49	96.80	8.62	0.81	1.26	1.24	8.31	8.26	8.31	33
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
金属製品	196	98.22	98.39	3.76	0.56	1.07	1.06	3.70	3.68	3.70	42
短期 (1-3)	75	98.68	98.78	2.23	0.36	0.98	0.98	2.21	2.20	2.21	41
中期 (3-7)	112	98.15	98.37	4.47	0.68	1.11	1.10	4.40	4.37	4.40	42
長期 (7-)	9	95.24	95.41	7.74	0.70	1.39	1.35	7.53	7.48	7.53	53
長期 (7-11)	9	95.24	95.41	7.74	0.70	1.39	1.35	7.53	7.48	7.53	53
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
機械	1,342	97.70	97.84	4.57	0.51	1.08	1.07	4.45	4.43	4.45	39
短期 (1-3)	460	98.72	98.81	2.15	0.31	0.92	0.92	2.14	2.13	2.14	35
中期 (3-7)	615	97.27	97.40	4.69	0.49	1.09	1.08	4.62	4.60	4.62	39
長期 (7-)	267	96.93	97.18	8.45	0.91	1.34	1.32	8.11	8.06	8.11	42
長期 (7-11)	267	96.93	97.18	8.45	0.91	1.34	1.32	8.11	8.06	8.11	42
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
電気機器	2,095	98.10	98.25	4.06	0.53	1.05	1.04	3.96	3.94	3.96	38
短期 (1-3)	810	98.94	99.03	1.98	0.35	0.89	0.89	1.97	1.96	1.97	34
中期 (3-7)	1,010	97.62	97.78	4.51	0.55	1.09	1.08	4.44	4.42	4.44	39
長期 (7-)	275	97.33	97.65	8.50	1.02	1.40	1.38	8.12	8.07	8.12	48
長期 (7-11)	275	97.33	97.65	8.50	1.02	1.40	1.38	8.12	8.07	8.12	48
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
輸送用機器	1,165	97.10	97.24	4.33	0.44	1.13	1.11	4.14	4.11	4.13	43
短期 (1-3)	539	98.74	98.82	1.82	0.26	0.99	0.98	1.81	1.81	1.81	44
中期 (3-7)	407	97.30	97.43	4.50	0.48	1.09	1.08	4.44	4.41	4.44	40
長期 (7-)	219	92.72	92.98	10.18	0.79	1.57	1.51	9.62	9.55	9.61	45
長期 (7-11)	129	96.72	97.01	8.43	0.88	1.34	1.32	8.10	8.05	8.10	42
超長期 (11-)	90	86.97	87.21	12.68	0.67	1.94	1.81	12.04	11.93	12.03	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 (2/4) (2024年11月末、12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	95.74	95.97	6.45	0.60	1.30	1.27	6.10	6.06	6.10	49
短期 (1-3)	50	98.76	98.85	2.08	0.30	0.93	0.92	2.07	2.06	2.07	36
中期 (3-7)	95	95.97	96.06	5.36	0.39	1.17	1.14	5.28	5.25	5.28	44
長期 (7-)	120	94.29	94.69	9.14	0.90	1.57	1.52	8.52	8.45	8.51	58
長期 (7-11)	95	96.14	96.51	7.55	0.84	1.40	1.38	7.30	7.25	7.30	57
超長期 (11-)	25	87.28	87.76	15.19	1.13	2.27	2.13	13.63	13.48	13.57	63
ゴム製品	330	97.80	97.88	3.61	0.39	1.01	1.00	3.55	3.53	3.55	36
短期 (1-3)	158	98.83	98.88	2.03	0.30	0.89	0.89	2.03	2.02	2.03	33
中期 (3-7)	147	97.06	97.14	4.59	0.41	1.08	1.07	4.54	4.52	4.54	38
長期 (7-)	25	95.64	95.89	7.83	0.76	1.39	1.36	7.59	7.54	7.59	52
長期 (7-11)	25	95.64	95.89	7.83	0.76	1.39	1.36	7.59	7.54	7.59	52
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
ガラス・土石製品	272	96.11	96.27	5.70	0.57	1.23	1.20	5.36	5.32	5.36	43
短期 (1-3)	68	98.78	98.83	2.04	0.29	0.90	0.90	2.04	2.03	2.04	34
中期 (3-7)	117	97.47	97.61	4.35	0.52	1.12	1.11	4.29	4.26	4.29	43
長期 (7-)	87	92.21	92.50	10.36	0.87	1.65	1.57	9.63	9.55	9.62	52
長期 (7-11)	62	96.47	96.79	8.53	0.89	1.37	1.35	8.20	8.14	8.20	44
超長期 (11-)	25	81.60	81.83	14.92	0.80	2.46	2.22	13.86	13.70	13.83	73
鉄鋼	458	97.86	98.02	4.02	0.53	1.10	1.09	3.90	3.87	3.89	42
短期 (1-3)	170	98.79	98.88	1.97	0.28	0.92	0.91	1.96	1.95	1.96	35
中期 (3-7)	235	97.72	97.90	4.27	0.58	1.12	1.11	4.21	4.19	4.21	44
長期 (7-)	53	95.51	95.80	9.46	1.09	1.58	1.54	8.87	8.80	8.87	56
長期 (7-11)	43	97.67	97.92	8.51	1.12	1.43	1.42	8.11	8.05	8.10	52
超長期 (11-)	10	86.24	86.68	13.54	0.95	2.28	2.13	12.59	12.46	12.57	75
非鉄金属	390	97.80	97.92	4.13	0.48	1.07	1.06	4.04	4.02	4.04	40
短期 (1-3)	165	98.63	98.71	2.14	0.30	0.97	0.96	2.13	2.12	2.13	39
中期 (3-7)	175	97.38	97.50	4.72	0.56	1.12	1.11	4.65	4.62	4.65	42
長期 (7-)	50	96.49	96.80	8.62	0.81	1.26	1.24	8.31	8.26	8.31	33
長期 (7-11)	50	96.49	96.80	8.62	0.81	1.26	1.24	8.31	8.26	8.31	33
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
金属製品	196	98.21	98.39	3.96	0.59	1.08	1.07	3.89	3.87	3.89	42
短期 (1-3)	65	98.58	98.68	2.41	0.39	1.00	1.00	2.40	2.39	2.40	41
中期 (3-7)	122	98.24	98.45	4.51	0.69	1.10	1.09	4.43	4.41	4.43	41
長期 (7-)	9	95.24	95.41	7.74	0.70	1.39	1.35	7.53	7.48	7.53	53
長期 (7-11)	9	95.24	95.41	7.74	0.70	1.39	1.35	7.53	7.48	7.53	53
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
機械	1,307	97.65	97.79	4.66	0.52	1.09	1.08	4.55	4.52	4.55	39
短期 (1-3)	445	98.66	98.76	2.27	0.32	0.94	0.93	2.26	2.25	2.26	36
中期 (3-7)	595	97.23	97.35	4.75	0.49	1.10	1.08	4.68	4.65	4.68	39
長期 (7-)	267	96.93	97.18	8.45	0.91	1.34	1.32	8.11	8.06	8.11	42
長期 (7-11)	267	96.93	97.18	8.45	0.91	1.34	1.32	8.11	8.06	8.11	42
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
電気機器	1,945	97.99	98.15	4.29	0.55	1.07	1.06	4.19	4.17	4.19	39
短期 (1-3)	765	98.77	98.87	2.31	0.38	0.92	0.92	2.30	2.29	2.30	34
中期 (3-7)	935	97.42	97.57	4.75	0.56	1.11	1.10	4.68	4.66	4.68	41
長期 (7-)	245	97.73	98.07	8.68	1.10	1.41	1.39	8.27	8.21	8.26	47
長期 (7-11)	245	97.73	98.07	8.68	1.10	1.41	1.39	8.27	8.21	8.26	47
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
輸送用機器	1,185	97.14	97.28	4.34	0.45	1.13	1.11	4.15	4.12	4.15	43
短期 (1-3)	564	98.71	98.80	1.87	0.27	0.99	0.99	1.87	1.86	1.87	44
中期 (3-7)	412	97.26	97.38	4.67	0.50	1.10	1.08	4.60	4.58	4.60	40
長期 (7-)	209	92.67	92.94	10.33	0.81	1.58	1.52	9.75	9.67	9.74	45
長期 (7-11)	119	96.99	97.28	8.55	0.92	1.34	1.32	8.20	8.14	8.19	41
超長期 (11-)	90	86.97	87.21	12.68	0.67	1.94	1.81	12.04	11.93	12.03	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11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	97.75	97.86	4.28	0.58	1.12	1.11	4.17	4.15	4.17	44
短期 (1-3)	80	99.17	99.23	1.99	0.39	0.85	0.85	1.98	1.97	1.98	29
中期 (3-7)	125	97.30	97.43	4.71	0.60	1.18	1.17	4.64	4.61	4.64	48
長期 (7-)	35	96.15	96.26	7.96	0.97	1.52	1.50	7.66	7.60	7.66	65
長期 (7-11)	35	96.15	96.26	7.96	0.97	1.52	1.50	7.66	7.60	7.66	65
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
その他製品	195	94.78	94.96	6.63	0.53	1.25	1.21	6.19	6.15	6.19	38
短期 (1-3)	30	98.70	98.80	1.85	0.41	1.12	1.11	1.84	1.83	1.84	56
中期 (3-7)	120	97.44	97.64	5.02	0.52	1.06	1.04	4.95	4.92	4.95	34
長期 (7-)	45	85.11	85.25	14.11	0.63	1.96	1.81	13.36	13.24	13.35	38
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	45	85.11	85.25	14.11	0.63	1.96	1.81	13.36	13.24	13.35	38
電気・ガス業	12,205	94.47	94.64	8.05	0.82	1.43	1.38	7.05	6.99	7.02	48
短期 (1-3)	2,670	99.14	99.23	2.08	0.48	0.91	0.90	2.07	2.06	2.07	34
中期 (3-7)	4,199	97.69	97.86	4.94	0.73	1.19	1.18	4.84	4.81	4.84	48
長期 (7-)	5,336	89.60	89.82	13.49	1.06	1.92	1.81	11.69	11.58	11.64	56
長期 (7-11)	2,499	96.75	96.97	8.70	1.08	1.51	1.48	8.28	8.22	8.28	56
超長期 (11-)	2,838	83.29	83.52	17.71	1.04	2.34	2.14	15.18	15.01	15.07	55
陸運業	6,692	89.14	89.38	13.69	1.02	1.63	1.50	10.24	10.14	10.11	35
短期 (1-3)	787	100.21	100.43	1.91	0.88	0.84	0.84	1.89	1.89	1.89	29
中期 (3-7)	1,848	99.84	100.08	4.91	1.04	1.03	1.02	4.78	4.76	4.78	33
長期 (7-)	4,057	82.12	82.37	19.98	1.04	2.16	1.92	15.24	15.07	15.00	38
長期 (7-11)	1,109	99.20	99.51	8.73	1.19	1.29	1.28	8.28	8.22	8.27	36
超長期 (11-)	2,948	75.69	75.92	24.21	0.98	2.58	2.24	18.67	18.45	18.31	39
海運業	169	98.55	98.78	4.92	0.92	1.20	1.20	4.75	4.72	4.75	48
短期 (1-3)	20	100.75	101.38	1.61	1.46	0.94	0.95	1.59	1.58	1.59	40
中期 (3-7)	119	98.59	98.76	4.40	0.77	1.17	1.16	4.32	4.29	4.32	48
長期 (7-)	30	96.93	97.10	9.17	1.14	1.52	1.50	8.71	8.64	8.70	54
長期 (7-11)	30	96.93	97.10	9.17	1.14	1.52	1.50	8.71	8.64	8.70	54
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
空運業	315	93.83	94.00	7.89	0.98	1.77	1.71	7.12	7.05	7.11	78
短期 (1-3)	90	99.10	99.33	1.71	0.65	1.19	1.19	1.70	1.69	1.70	64
中期 (3-7)	40	95.58	95.64	4.44	0.36	1.40	1.37	4.40	4.37	4.40	69
長期 (7-)	185	90.89	91.06	11.64	1.28	2.17	2.06	10.61	10.50	10.59	88
長期 (7-11)	85	98.84	98.99	9.26	1.53	1.68	1.67	8.65	8.58	8.64	70
超長期 (11-)	100	84.14	84.31	13.66	1.07	2.65	2.44	12.57	12.41	12.54	106
倉庫・運輸関連業	159	95.11	95.28	6.29	0.61	1.38	1.35	5.97	5.93	5.97	56
短期 (1-3)	17	99.62	99.88	2.05	0.82	1.00	1.00	2.02	2.01	2.02	46
中期 (3-7)	105	95.92	96.05	5.04	0.46	1.32	1.29	4.96	4.93	4.96	60
長期 (7-)	37	90.70	90.93	11.87	0.93	1.79	1.70	11.05	10.96	11.04	49
長期 (7-11)	17	97.82	98.07	9.09	1.18	1.45	1.44	8.62	8.56	8.62	48
超長期 (11-)	20	84.82	85.04	14.17	0.72	2.11	1.95	13.37	13.24	13.34	51
情報・通信業	2,511	96.92	97.16	4.49	0.94	1.59	1.56	4.19	4.15	4.18	88
短期 (1-3)	970	99.00	99.19	1.97	0.75	1.30	1.30	1.96	1.94	1.96	74
中期 (3-7)	1,183	97.07	97.31	4.68	0.92	1.57	1.55	4.56	4.52	4.56	86
長期 (7-)	358	90.77	91.20	10.67	1.50	2.53	2.38	9.46	9.34	9.44	131
長期 (7-11)	240	95.53	95.98	8.93	1.40	2.00	1.94	8.37	8.29	8.37	100
超長期 (11-)	118	81.03	81.43	14.24	1.73	3.79	3.44	12.08	11.87	12.02	205
卸売業	1,322	97.42	97.66	6.20	0.91	1.24	1.22	5.85	5.81	5.84	44
短期 (1-3)	193	99.90	100.17	1.93	0.96	0.99	0.99	1.91	1.90	1.91	44
中期 (3-7)	672	98.83	99.05	4.67	0.84	1.12	1.11	4.57	4.54	4.57	43
長期 (7-)	457	94.28	94.55	10.27	0.99	1.55	1.50	9.59	9.51	9.58	45
長期 (7-11)	312	97.83	98.11	8.58	1.06	1.34	1.33	8.19	8.13	8.18	42
超長期 (11-)	145	86.66	86.90	13.90	0.82	2.05	1.91	12.98	12.86	12.96	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11月末、12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	259	97.86	97.97	4.47	0.66	1.15	1.14	4.36	4.34	4.36	46
短期 (1-3)	70	99.15	99.21	2.13	0.43	0.85	0.85	2.12	2.11	2.12	28
中期 (3-7)	154	97.66	97.80	4.74	0.70	1.21	1.20	4.66	4.63	4.66	50
長期 (7-)	35	96.15	96.26	7.96	0.97	1.52	1.50	7.66	7.60	7.66	65
長期 (7-11)	35	96.15	96.26	7.96	0.97	1.52	1.50	7.66	7.60	7.66	65
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
その他製品	195	94.78	94.96	6.63	0.53	1.25	1.21	6.19	6.15	6.19	38
短期 (1-3)	30	98.70	98.80	1.85	0.41	1.12	1.11	1.84	1.83	1.84	56
中期 (3-7)	120	97.44	97.64	5.02	0.52	1.06	1.04	4.95	4.92	4.95	34
長期 (7-)	45	85.11	85.25	14.11	0.63	1.96	1.81	13.36	13.24	13.35	38
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	45	85.11	85.25	14.11	0.63	1.96	1.81	13.36	13.24	13.35	38
電気・ガス業	12,367	94.52	94.70	8.13	0.83	1.43	1.38	7.12	7.06	7.10	48
短期 (1-3)	2,671	99.12	99.22	2.14	0.48	0.91	0.91	2.12	2.11	2.12	34
中期 (3-7)	4,273	97.73	97.90	5.02	0.74	1.19	1.18	4.91	4.88	4.91	48
長期 (7-)	5,424	89.74	89.95	13.53	1.07	1.93	1.82	11.72	11.61	11.67	56
長期 (7-11)	2,534	96.73	96.94	8.76	1.09	1.52	1.49	8.34	8.27	8.33	57
超長期 (11-)	2,890	83.60	83.82	17.71	1.06	2.34	2.15	15.16	14.99	15.06	56
陸運業	6,630	89.04	89.29	13.84	1.03	1.64	1.51	10.36	10.26	10.23	35
短期 (1-3)	813	100.39	100.63	2.13	0.97	0.85	0.85	2.10	2.09	2.10	29
中期 (3-7)	1,810	99.78	100.02	5.08	1.03	1.04	1.03	4.95	4.92	4.94	34
長期 (7-)	4,007	81.89	82.14	20.17	1.04	2.17	1.94	15.40	15.23	15.15	38
長期 (7-11)	1,049	99.14	99.44	8.83	1.19	1.30	1.29	8.37	8.31	8.36	36
超長期 (11-)	2,958	75.77	76.00	24.19	0.98	2.58	2.24	18.66	18.44	18.31	39
海運業	169	98.55	98.78	4.92	0.92	1.20	1.20	4.75	4.72	4.75	48
短期 (1-3)	20	100.75	101.38	1.61	1.46	0.94	0.95	1.59	1.58	1.59	40
中期 (3-7)	119	98.59	98.76	4.40	0.77	1.17	1.16	4.32	4.29	4.32	48
長期 (7-)	30	96.93	97.10	9.17	1.14	1.52	1.50	8.71	8.64	8.70	54
長期 (7-11)	30	96.93	97.10	9.17	1.14	1.52	1.50	8.71	8.64	8.70	54
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
空運業	315	93.83	94.00	7.89	0.98	1.77	1.71	7.12	7.05	7.11	78
短期 (1-3)	90	99.10	99.33	1.71	0.65	1.19	1.19	1.70	1.69	1.70	64
中期 (3-7)	40	95.58	95.64	4.44	0.36	1.40	1.37	4.40	4.37	4.40	69
長期 (7-)	185	90.89	91.06	11.64	1.28	2.17	2.06	10.61	10.50	10.59	88
長期 (7-11)	85	98.84	98.99	9.26	1.53	1.68	1.67	8.65	8.58	8.64	70
超長期 (11-)	100	84.14	84.31	13.66	1.07	2.65	2.44	12.57	12.41	12.54	106
倉庫・運輸関連業	152	94.90	95.06	6.54	0.61	1.41	1.38	6.21	6.17	6.21	57
短期 (1-3)	18	98.93	99.13	2.87	0.68	1.05	1.05	2.84	2.82	2.84	45
中期 (3-7)	97	95.73	95.86	5.21	0.47	1.35	1.32	5.13	5.10	5.13	62
長期 (7-)	37	90.70	90.93	11.87	0.93	1.79	1.70	11.05	10.96	11.04	49
長期 (7-11)	17	97.82	98.07	9.09	1.18	1.45	1.44	8.62	8.56	8.62	48
超長期 (11-)	20	84.82	85.04	14.17	0.72	2.11	1.95	13.37	13.24	13.34	51
情報・通信業	2,431	96.84	97.08	4.60	0.95	1.61	1.58	4.29	4.25	4.29	89
短期 (1-3)	955	98.90	99.09	2.12	0.76	1.32	1.32	2.11	2.09	2.11	75
中期 (3-7)	1,118	97.01	97.25	4.77	0.94	1.60	1.57	4.65	4.61	4.65	88
長期 (7-)	358	90.77	91.20	10.67	1.50	2.53	2.38	9.46	9.34	9.44	131
長期 (7-11)	240	95.53	95.98	8.93	1.40	2.00	1.94	8.37	8.29	8.37	100
超長期 (11-)	118	81.03	81.43	14.24	1.73	3.79	3.44	12.08	11.87	12.02	205
卸売業	1,297	97.35	97.59	6.33	0.90	1.25	1.23	5.97	5.93	5.97	44
短期 (1-3)	158	99.80	100.02	2.13	0.91	1.02	1.02	2.11	2.10	2.11	45
中期 (3-7)	687	98.80	99.01	4.69	0.84	1.12	1.12	4.59	4.56	4.59	43
長期 (7-)	452	94.30	94.58	10.30	0.99	1.55	1.50	9.61	9.54	9.60	44
長期 (7-11)	307	97.92	98.20	8.60	1.07	1.34	1.33	8.20	8.15	8.20	42
超長期 (11-)	145	86.66	86.90	13.90	0.82	2.05	1.91	12.98	12.86	12.96	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11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	1,285	97.99	98.15	3.82	0.62	1.17	1.16	3.67	3.64	3.66	51
短期 (1-3)	535	99.10	99.22	1.55	0.37	0.94	0.94	1.54	1.54	1.54	42
中期 (3-7)	589	97.87	98.03	4.21	0.67	1.20	1.19	4.13	4.11	4.13	52
長期 (7-)	161	94.70	94.98	9.92	1.23	1.83	1.78	9.26	9.18	9.25	75
長期 (7-11)	121	96.75	96.99	8.73	1.34	1.79	1.76	8.23	8.16	8.23	84
超長期 (11-)	40	88.51	88.90	13.51	0.88	1.96	1.85	12.65	12.54	12.63	47
銀行業	1,349	99.72	100.05	3.48	1.24	1.25	1.25	3.38	3.35	3.38	62
短期 (1-3)	654	100.36	100.73	1.91	1.40	1.17	1.17	1.89	1.87	1.89	62
中期 (3-7)	647	99.17	99.44	4.64	1.07	1.31	1.31	4.52	4.49	4.52	62
長期 (7-)	48	98.49	98.90	9.15	1.32	1.53	1.52	8.59	8.53	8.59	55
長期 (7-11)	48	98.49	98.90	9.15	1.32	1.53	1.52	8.59	8.53	8.59	55
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
証券、商品先物取引業	910	98.90	99.16	2.25	0.78	1.28	1.28	2.22	2.20	2.22	71
短期 (1-3)	695	99.07	99.33	1.77	0.74	1.25	1.25	1.75	1.74	1.75	70
中期 (3-7)	210	98.44	98.69	3.71	0.94	1.38	1.37	3.65	3.62	3.65	72
長期 (7-)	5	94.16	94.37	7.76	0.90	1.76	1.71	7.49	7.43	7.49	88
長期 (7-11)	5	94.16	94.37	7.76	0.90	1.76	1.71	7.49	7.43	7.49	88
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
保険業	330	97.94	97.98	3.32	0.38	1.04	1.03	3.25	3.24	3.25	41
短期 (1-3)	210	98.52	98.54	2.21	0.26	0.95	0.95	2.20	2.19	2.20	37
中期 (3-7)	70	98.15	98.20	3.41	0.48	1.04	1.03	3.38	3.37	3.38	40
長期 (7-)	50	95.21	95.31	7.87	0.75	1.43	1.39	7.65	7.59	7.65	55
長期 (7-11)	50	95.21	95.31	7.87	0.75	1.43	1.39	7.65	7.59	7.65	55
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
その他金融業	6,598	98.02	98.18	3.78	0.51	1.08	1.07	3.67	3.65	3.67	42
短期 (1-3)	2,877	98.91	99.02	1.82	0.36	0.98	0.98	1.81	1.80	1.81	43
中期 (3-7)	3,090	97.74	97.92	4.51	0.57	1.09	1.07	4.44	4.41	4.44	40
長期 (7-)	631	95.39	95.67	9.13	0.96	1.52	1.48	8.64	8.57	8.63	52
長期 (7-11)	553	96.82	97.11	8.46	0.96	1.42	1.39	8.11	8.06	8.11	49
超長期 (11-)	78	85.28	85.48	13.95	0.96	2.34	2.16	12.87	12.73	12.85	76
不動産業	2,658	94.88	95.09	7.42	0.75	1.36	1.31	6.42	6.37	6.40	47
短期 (1-3)	570	99.27	99.40	2.15	0.58	0.97	0.97	2.14	2.13	2.14	40
中期 (3-7)	1,092	97.35	97.52	4.67	0.59	1.17	1.15	4.59	4.57	4.59	47
長期 (7-)	996	89.66	89.97	13.44	1.02	1.83	1.72	11.30	11.19	11.23	51
長期 (7-11)	528	97.32	97.66	8.50	1.04	1.39	1.37	8.11	8.05	8.11	47
超長期 (11-)	468	81.01	81.28	19.02	1.00	2.44	2.19	15.63	15.45	15.46	57
サービス業	864	92.60	92.87	5.43	0.73	2.10	1.97	5.03	4.97	5.02	124
短期 (1-3)	242	97.50	97.64	2.01	0.38	1.67	1.65	2.00	1.98	2.00	109
中期 (3-7)	352	96.92	97.11	4.92	0.63	1.32	1.29	4.84	4.81	4.84	59
長期 (7-)	270	82.58	83.07	9.18	1.16	3.75	3.34	8.51	8.37	8.50	238
長期 (7-11)	220	85.76	86.21	8.40	1.10	3.36	3.07	8.00	7.88	7.99	216
超長期 (11-)	50	68.58	69.27	12.58	1.45	5.86	4.86	11.30	11.04	11.27	357
財投機関債	20,230	95.54	95.77	8.97	0.81	1.18	1.14	7.47	7.41	7.42	19
短期 (1-3)	5,699	99.41	99.54	1.91	0.40	0.73	0.72	1.90	1.89	1.90	17
中期 (3-7)	6,432	99.29	99.51	4.58	0.72	0.86	0.86	4.50	4.48	4.50	18
長期 (7-)	8,099	89.84	90.15	17.43	1.17	1.81	1.70	14.40	14.26	14.27	21
長期 (7-11)	2,351	99.96	100.31	8.86	1.13	1.13	1.13	8.41	8.36	8.41	19
超長期 (11-)	5,748	85.70	86.00	20.93	1.18	2.13	1.98	17.26	17.08	17.07	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 業種別・ポートフォリオ指標 (4/4) (2024年11月末、12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	1,025	97.61	97.77	4.52	0.68	1.25	1.24	4.34	4.31	4.34	54
短期 (1-3)	315	98.57	98.66	2.16	0.39	1.06	1.06	2.14	2.13	2.14	49
中期 (3-7)	559	97.83	98.00	4.34	0.69	1.21	1.19	4.26	4.23	4.26	52
長期 (7-)	151	94.78	95.06	10.11	1.28	1.85	1.80	9.41	9.33	9.41	75
長期 (7-11)	111	97.04	97.28	8.89	1.42	1.81	1.78	8.35	8.27	8.34	85
超長期 (11-)	40	88.51	88.90	13.51	0.88	1.96	1.85	12.65	12.54	12.63	47
銀行業	1,415	99.69	100.00	3.57	1.22	1.24	1.24	3.47	3.44	3.47	61
短期 (1-3)	654	100.36	100.73	1.91	1.40	1.17	1.17	1.89	1.87	1.89	62
中期 (3-7)	713	99.15	99.41	4.72	1.05	1.29	1.29	4.59	4.56	4.59	60
長期 (7-)	48	98.49	98.90	9.15	1.32	1.53	1.52	8.59	8.53	8.59	55
長期 (7-11)	48	98.49	98.90	9.15	1.32	1.53	1.52	8.59	8.53	8.59	55
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
証券、商品先物取引業	860	98.83	99.05	2.42	0.77	1.29	1.29	2.38	2.37	2.38	71
短期 (1-3)	626	98.96	99.19	1.89	0.69	1.26	1.25	1.87	1.86	1.87	70
中期 (3-7)	229	98.55	98.77	3.77	0.98	1.39	1.38	3.70	3.68	3.70	72
長期 (7-)	5	94.16	94.37	7.76	0.90	1.76	1.71	7.49	7.43	7.49	88
長期 (7-11)	5	94.16	94.37	7.76	0.90	1.76	1.71	7.49	7.43	7.49	88
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
保険業	330	97.94	97.98	3.32	0.38	1.04	1.03	3.25	3.24	3.25	41
短期 (1-3)	210	98.52	98.54	2.21	0.26	0.95	0.95	2.20	2.19	2.20	37
中期 (3-7)	70	98.15	98.20	3.41	0.48	1.04	1.03	3.38	3.37	3.38	40
長期 (7-)	50	95.21	95.31	7.87	0.75	1.43	1.39	7.65	7.59	7.65	55
長期 (7-11)	50	95.21	95.31	7.87	0.75	1.43	1.39	7.65	7.59	7.65	55
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
その他金融業	6,673	98.03	98.19	4.08	0.56	1.10	1.09	3.96	3.94	3.96	42
短期 (1-3)	2,787	98.80	98.91	2.05	0.38	1.00	0.99	2.04	2.03	2.04	43
中期 (3-7)	3,226	97.68	97.85	4.72	0.61	1.11	1.10	4.64	4.61	4.64	41
長期 (7-)	660	96.49	96.74	9.53	1.10	1.49	1.46	8.95	8.88	8.94	46
長期 (7-11)	582	97.99	98.25	8.93	1.12	1.39	1.37	8.49	8.44	8.49	43
超長期 (11-)	78	85.28	85.48	13.95	0.96	2.34	2.16	12.87	12.73	12.85	76
不動産業	2,661	94.89	95.10	7.41	0.75	1.36	1.31	6.42	6.37	6.39	47
短期 (1-3)	573	99.27	99.40	2.16	0.58	0.98	0.98	2.14	2.13	2.14	41
中期 (3-7)	1,113	97.30	97.48	4.72	0.59	1.17	1.16	4.63	4.61	4.63	47
長期 (7-)	975	89.55	89.86	13.58	1.03	1.84	1.72	11.40	11.29	11.33	51
長期 (7-11)	507	97.43	97.78	8.56	1.06	1.38	1.36	8.16	8.11	8.16	46
超長期 (11-)	468	81.01	81.28	19.02	1.00	2.44	2.19	15.63	15.45	15.46	57
サービス業	899	92.86	93.13	5.41	0.73	2.05	1.92	5.02	4.96	5.01	120
短期 (1-3)	253	97.58	97.73	2.09	0.40	1.64	1.61	2.08	2.06	2.08	105
中期 (3-7)	461	94.34	94.58	5.33	0.72	1.79	1.70	5.16	5.11	5.16	99
長期 (7-)	185	82.72	83.20	10.17	1.22	3.47	3.05	9.33	9.19	9.32	200
長期 (7-11)	135	87.96	88.36	9.28	1.13	2.78	2.53	8.76	8.65	8.76	155
超長期 (11-)	50	68.58	69.27	12.58	1.45	5.86	4.86	11.30	11.04	11.27	357
財投機関債	20,011	95.48	95.71	9.11	0.81	1.19	1.15	7.60	7.54	7.55	19
短期 (1-3)	5,654	99.43	99.56	2.06	0.42	0.74	0.73	2.05	2.04	2.05	17
中期 (3-7)	6,239	99.24	99.45	4.69	0.71	0.87	0.87	4.60	4.58	4.60	18
長期 (7-)	8,118	89.86	90.17	17.43	1.17	1.81	1.70	14.40	14.27	14.28	21
長期 (7-11)	2,443	100.02	100.37	8.97	1.14	1.14	1.14	8.51	8.46	8.50	19
超長期 (11-)	5,675	85.48	85.78	21.07	1.18	2.15	1.99	17.38	17.20	17.19	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11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	75,012	95.65	95.86	7.14	0.77	1.29	1.25	6.09	6.04	6.06	41
短期 (1-3)	23,150	99.18	99.33	1.95	0.51	0.95	0.95	1.94	1.93	1.94	39
中期 (3-7)	28,309	98.19	98.38	4.64	0.71	1.10	1.10	4.55	4.52	4.55	41
長期 (7-)	23,553	89.14	89.42	15.25	1.09	1.90	1.77	12.67	12.55	12.57	44
長期 (7-11)	10,015	97.60	97.90	8.65	1.09	1.41	1.39	8.24	8.18	8.23	48
超長期 (11-)	13,538	82.87	83.14	20.14	1.09	2.32	2.10	16.53	16.35	16.35	41
AAA ~ A 格	74,037	95.62	95.83	7.18	0.77	1.28	1.24	6.12	6.07	6.09	41
短期 (1-3)	22,715	99.19	99.33	1.96	0.51	0.94	0.94	1.94	1.94	1.94	39
中期 (3-7)	27,881	98.19	98.38	4.64	0.70	1.10	1.09	4.55	4.52	4.55	41
長期 (7-)	23,442	89.12	89.40	15.27	1.09	1.89	1.77	12.68	12.56	12.58	44
長期 (7-11)	9,963	97.60	97.90	8.65	1.09	1.41	1.39	8.24	8.18	8.24	47
超長期 (11-)	13,479	82.85	83.11	20.16	1.09	2.31	2.10	16.54	16.36	16.36	40
AAA ~ AA 格	53,086	95.26	95.46	7.90	0.75	1.23	1.18	6.58	6.53	6.54	31
短期 (1-3)	15,650	99.29	99.42	1.95	0.46	0.84	0.84	1.94	1.93	1.94	29
中期 (3-7)	19,316	98.46	98.65	4.66	0.68	1.01	1.00	4.57	4.55	4.57	32
長期 (7-)	18,120	88.37	88.65	16.49	1.07	1.85	1.72	13.45	13.32	13.33	32
長期 (7-11)	6,970	98.28	98.57	8.69	1.04	1.27	1.26	8.29	8.24	8.29	34
超長期 (11-)	11,150	82.18	82.45	21.37	1.08	2.29	2.07	17.31	17.13	17.10	31
AAA 格	11,605	96.76	96.90	5.37	0.44	0.96	0.93	4.61	4.58	4.58	22
短期 (1-3)	4,515	99.02	99.08	1.86	0.20	0.75	0.75	1.85	1.84	1.85	20
中期 (3-7)	5,222	98.06	98.21	4.52	0.47	0.90	0.90	4.46	4.44	4.46	22
長期 (7-)	1,868	87.70	87.98	16.23	0.94	1.71	1.56	12.58	12.46	12.43	28
長期 (7-11)	1,066	97.50	97.78	8.54	0.87	1.20	1.18	8.21	8.16	8.21	28
超長期 (11-)	802	74.67	74.96	26.45	1.04	2.59	2.22	20.15	19.91	19.74	27
AA 格	41,481	94.84	95.06	8.61	0.83	1.30	1.25	7.14	7.08	7.10	34
短期 (1-3)	11,135	99.40	99.55	1.98	0.56	0.88	0.88	1.97	1.96	1.97	32
中期 (3-7)	14,094	98.61	98.81	4.71	0.76	1.05	1.04	4.62	4.59	4.62	36
長期 (7-)	16,252	88.45	88.72	16.52	1.08	1.87	1.74	13.55	13.42	13.43	33
長期 (7-11)	5,904	98.42	98.71	8.72	1.08	1.28	1.27	8.30	8.25	8.30	35
超長期 (11-)	10,348	82.76	83.03	20.97	1.09	2.27	2.06	17.12	16.93	16.91	31
A 格	20,952	96.54	96.75	5.36	0.81	1.43	1.40	4.98	4.94	4.98	66
短期 (1-3)	7,065	98.96	99.13	1.98	0.62	1.17	1.16	1.96	1.95	1.96	61
中期 (3-7)	8,565	97.57	97.77	4.59	0.76	1.30	1.29	4.49	4.47	4.49	61
長期 (7-)	5,321	91.66	91.94	11.11	1.16	2.03	1.93	10.13	10.03	10.11	81
長期 (7-11)	2,993	96.03	96.34	8.57	1.19	1.75	1.70	8.12	8.05	8.11	79
超長期 (11-)	2,328	86.04	86.30	14.37	1.12	2.43	2.26	13.02	12.88	12.98	83
BBB 格	974	97.95	98.13	4.22	0.98	1.50	1.48	3.96	3.92	3.95	80
短期 (1-3)	435	99.04	99.23	1.83	0.81	1.37	1.36	1.81	1.80	1.81	82
中期 (3-7)	428	98.03	98.18	4.57	1.00	1.45	1.43	4.46	4.43	4.46	75
長期 (7-)	111	93.40	93.60	12.27	1.57	2.24	2.17	10.86	10.74	10.82	95
長期 (7-11)	52	97.80	97.93	8.79	1.56	1.87	1.85	8.22	8.14	8.21	92
超長期 (11-)	59	89.51	89.76	15.34	1.58	2.60	2.47	13.41	13.24	13.33	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11月末、12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	74,543	95.62	95.82	7.28	0.78	1.30	1.26	6.22	6.18	6.19	42
短期 (1-3)	22,768	99.15	99.29	2.10	0.53	0.96	0.96	2.09	2.08	2.09	40
中期 (3-7)	28,359	98.09	98.28	4.76	0.72	1.12	1.11	4.67	4.64	4.67	42
長期 (7-)	23,417	89.20	89.47	15.37	1.11	1.89	1.77	12.76	12.63	12.66	43
長期 (7-11)	9,890	97.89	98.18	8.78	1.12	1.39	1.38	8.35	8.29	8.34	45
超長期 (11-)	13,526	82.85	83.11	20.18	1.10	2.32	2.11	16.57	16.39	16.38	41
AAA~A 格	73,589	95.59	95.79	7.32	0.78	1.30	1.25	6.25	6.20	6.22	41
短期 (1-3)	22,344	99.15	99.29	2.10	0.53	0.96	0.95	2.09	2.08	2.09	39
中期 (3-7)	27,939	98.09	98.28	4.76	0.71	1.12	1.11	4.67	4.64	4.67	42
長期 (7-)	23,306	89.18	89.45	15.38	1.10	1.89	1.77	12.77	12.64	12.67	43
長期 (7-11)	9,838	97.89	98.18	8.78	1.12	1.39	1.38	8.35	8.29	8.34	45
超長期 (11-)	13,468	82.82	83.08	20.20	1.09	2.32	2.11	16.58	16.40	16.40	41
AAA~AA 格	52,765	95.22	95.42	8.05	0.76	1.24	1.19	6.72	6.66	6.68	31
短期 (1-3)	15,420	99.26	99.39	2.12	0.48	0.86	0.85	2.10	2.09	2.10	29
中期 (3-7)	19,163	98.44	98.62	4.78	0.69	1.02	1.01	4.69	4.67	4.69	32
長期 (7-)	18,182	88.41	88.68	16.51	1.07	1.86	1.73	13.48	13.35	13.35	32
長期 (7-11)	7,076	98.34	98.62	8.79	1.06	1.28	1.27	8.37	8.32	8.37	34
超長期 (11-)	11,106	82.08	82.35	21.44	1.08	2.30	2.08	17.37	17.19	17.16	31
AAA 格	11,669	96.77	96.90	5.58	0.48	0.98	0.95	4.82	4.79	4.80	22
短期 (1-3)	4,525	98.95	99.02	2.08	0.23	0.76	0.76	2.07	2.06	2.07	19
中期 (3-7)	5,157	98.10	98.25	4.69	0.51	0.92	0.91	4.62	4.60	4.62	22
長期 (7-)	1,987	88.32	88.59	15.89	0.96	1.70	1.56	12.40	12.29	12.26	29
長期 (7-11)	1,185	97.56	97.81	8.74	0.91	1.23	1.22	8.38	8.33	8.38	29
超長期 (11-)	802	74.67	74.96	26.45	1.04	2.59	2.22	20.15	19.91	19.74	27
AA 格	41,095	94.79	95.00	8.74	0.84	1.31	1.26	7.27	7.21	7.22	34
短期 (1-3)	10,895	99.39	99.55	2.13	0.59	0.90	0.89	2.12	2.11	2.12	33
中期 (3-7)	14,006	98.57	98.76	4.82	0.76	1.06	1.05	4.72	4.69	4.72	36
長期 (7-)	16,195	88.42	88.69	16.59	1.09	1.88	1.75	13.61	13.48	13.49	33
長期 (7-11)	5,890	98.49	98.78	8.80	1.09	1.29	1.28	8.37	8.32	8.37	35
超長期 (11-)	10,304	82.66	82.93	21.04	1.09	2.28	2.07	17.18	17.00	16.98	31
A 格	20,824	96.52	96.73	5.48	0.83	1.44	1.41	5.09	5.05	5.08	66
短期 (1-3)	6,925	98.90	99.07	2.08	0.62	1.17	1.17	2.06	2.05	2.06	61
中期 (3-7)	8,776	97.32	97.52	4.72	0.77	1.34	1.32	4.62	4.59	4.62	63
長期 (7-)	5,124	91.91	92.20	11.37	1.21	2.01	1.92	10.33	10.23	10.31	77
長期 (7-11)	2,762	96.75	97.05	8.77	1.25	1.69	1.65	8.28	8.21	8.28	73
超長期 (11-)	2,361	86.26	86.52	14.40	1.15	2.43	2.26	13.03	12.88	12.99	84
BBB 格	955	97.90	98.08	4.42	1.06	1.57	1.55	4.14	4.10	4.14	86
短期 (1-3)	424	98.97	99.17	2.07	0.91	1.46	1.45	2.05	2.03	2.05	89
中期 (3-7)	420	98.02	98.17	4.71	1.06	1.51	1.49	4.58	4.55	4.58	81
長期 (7-)	111	93.40	93.60	12.27	1.57	2.24	2.17	10.86	10.74	10.82	95
長期 (7-11)	52	97.80	97.93	8.79	1.56	1.87	1.85	8.22	8.14	8.21	92
超長期 (11-)	59	89.51	89.76	15.34	1.58	2.60	2.47	13.41	13.24	13.33	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11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	51,540	95.15	95.35	8.04	0.74	1.23	1.18	6.69	6.63	6.65	30
短期(1-3)	14,779	99.29	99.41	1.93	0.44	0.83	0.83	1.92	1.92	1.92	27
中期(3-7)	18,700	98.45	98.63	4.68	0.67	1.00	0.99	4.59	4.57	4.59	31
長期(7-)	18,061	88.34	88.61	16.52	1.07	1.85	1.72	13.47	13.34	13.35	32
長期(7-11)	6,915	98.28	98.56	8.69	1.04	1.27	1.26	8.29	8.24	8.29	34
超長期(11-)	11,146	82.17	82.44	21.37	1.08	2.29	2.07	17.32	17.13	17.10	31
AAA~A格	70,661	95.47	95.67	7.36	0.75	1.28	1.24	6.26	6.21	6.23	39
短期(1-3)	20,822	99.18	99.31	1.94	0.47	0.91	0.91	1.93	1.92	1.93	36
中期(3-7)	26,676	98.18	98.37	4.67	0.69	1.08	1.08	4.58	4.55	4.58	39
長期(7-)	23,163	89.01	89.28	15.32	1.08	1.89	1.77	12.72	12.60	12.62	43
長期(7-11)	9,802	97.60	97.90	8.65	1.08	1.40	1.38	8.24	8.19	8.24	46
超長期(11-)	13,361	82.70	82.97	20.21	1.08	2.31	2.10	16.60	16.42	16.41	40
AAA~BBB格	71,165	95.48	95.68	7.33	0.75	1.28	1.24	6.24	6.19	6.21	39
短期(1-3)	21,079	99.17	99.30	1.94	0.47	0.92	0.92	1.93	1.92	1.93	36
中期(3-7)	26,893	98.17	98.36	4.66	0.69	1.09	1.08	4.58	4.55	4.58	39
長期(7-)	23,193	89.01	89.28	15.32	1.08	1.89	1.77	12.72	12.60	12.62	43
長期(7-11)	9,812	97.60	97.89	8.65	1.08	1.40	1.38	8.24	8.19	8.24	46
超長期(11-)	13,381	82.70	82.97	20.20	1.08	2.31	2.10	16.59	16.41	16.41	40
AAA~BB格	71,165	95.48	95.68	7.33	0.75	1.28	1.24	6.24	6.19	6.21	39
短期(1-3)	21,079	99.17	99.30	1.94	0.47	0.92	0.92	1.93	1.92	1.93	36
中期(3-7)	26,893	98.17	98.36	4.66	0.69	1.09	1.08	4.58	4.55	4.58	39
長期(7-)	23,193	89.01	89.28	15.32	1.08	1.89	1.77	12.72	12.60	12.62	43
長期(7-11)	9,812	97.60	97.89	8.65	1.08	1.40	1.38	8.24	8.19	8.24	46
超長期(11-)	13,381	82.70	82.97	20.20	1.08	2.31	2.10	16.59	16.41	16.41	40
AAA格	11,605	96.76	96.90	5.37	0.44	0.96	0.93	4.61	4.58	4.58	22
短期(1-3)	4,515	99.02	99.08	1.86	0.20	0.75	0.75	1.85	1.84	1.85	20
中期(3-7)	5,222	98.06	98.21	4.52	0.47	0.90	0.90	4.46	4.44	4.46	22
長期(7-)	1,868	87.70	87.98	16.23	0.94	1.71	1.56	12.58	12.46	12.43	28
長期(7-11)	1,066	97.50	97.78	8.54	0.87	1.20	1.18	8.21	8.16	8.21	28
超長期(11-)	802	74.67	74.96	26.45	1.04	2.59	2.22	20.15	19.91	19.74	27
AA格	39,935	94.68	94.89	8.82	0.83	1.31	1.26	7.30	7.24	7.26	33
短期(1-3)	10,265	99.41	99.56	1.97	0.55	0.87	0.86	1.96	1.95	1.96	31
中期(3-7)	13,478	98.60	98.80	4.74	0.75	1.04	1.03	4.65	4.62	4.65	35
長期(7-)	16,193	88.41	88.69	16.55	1.08	1.87	1.74	13.58	13.45	13.45	33
長期(7-11)	5,849	98.42	98.71	8.72	1.07	1.28	1.27	8.31	8.25	8.30	35
超長期(11-)	10,344	82.76	83.02	20.97	1.09	2.27	2.06	17.12	16.93	16.92	31
A格	19,121	96.33	96.53	5.51	0.77	1.41	1.38	5.12	5.08	5.11	63
短期(1-3)	6,043	98.90	99.05	1.95	0.53	1.11	1.11	1.94	1.93	1.94	56
中期(3-7)	7,976	97.55	97.74	4.64	0.74	1.28	1.26	4.54	4.52	4.54	58
長期(7-)	5,102	91.37	91.66	11.10	1.12	2.01	1.91	10.14	10.04	10.13	79
長期(7-11)	2,887	95.99	96.30	8.56	1.17	1.73	1.69	8.12	8.06	8.12	78
超長期(11-)	2,215	85.36	85.61	14.40	1.05	2.43	2.24	13.11	12.96	13.07	81
BBB格	504	97.33	97.57	3.53	0.75	1.49	1.47	3.36	3.34	3.36	83
短期(1-3)	257	98.70	98.94	1.80	0.74	1.48	1.47	1.78	1.77	1.78	93
中期(3-7)	217	97.13	97.36	4.39	0.75	1.42	1.40	4.30	4.27	4.30	72
長期(7-)	30	87.09	87.39	12.16	0.88	2.17	2.02	11.21	11.09	11.19	80
長期(7-11)	10	94.35	94.62	7.66	0.77	1.60	1.56	7.42	7.37	7.42	74
超長期(11-)	20	83.46	83.78	14.41	0.93	2.49	2.28	13.34	13.19	13.31	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11月末、12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	51,095	95.10	95.30	8.20	0.76	1.24	1.19	6.84	6.78	6.79	30
短期 (1-3)	14,455	99.26	99.38	2.10	0.46	0.84	0.84	2.09	2.08	2.09	27
中期 (3-7)	18,531	98.43	98.61	4.80	0.68	1.01	1.00	4.71	4.69	4.71	31
長期 (7-)	18,109	88.37	88.64	16.54	1.07	1.86	1.73	13.50	13.37	13.38	32
長期 (7-11)	7,007	98.34	98.62	8.79	1.06	1.28	1.27	8.37	8.32	8.37	34
超長期 (11-)	11,102	82.08	82.35	21.44	1.08	2.30	2.08	17.38	17.19	17.16	31
AAA~A 格	70,143	95.43	95.63	7.50	0.77	1.29	1.25	6.39	6.34	6.36	39
短期 (1-3)	20,371	99.14	99.27	2.09	0.48	0.92	0.92	2.07	2.06	2.07	35
中期 (3-7)	26,750	98.08	98.27	4.79	0.70	1.10	1.09	4.70	4.67	4.70	40
長期 (7-)	23,022	89.07	89.34	15.44	1.09	1.89	1.76	12.81	12.69	12.71	42
長期 (7-11)	9,672	97.89	98.18	8.78	1.11	1.38	1.37	8.35	8.29	8.35	44
超長期 (11-)	13,350	82.67	82.94	20.26	1.08	2.32	2.11	16.63	16.45	16.45	40
AAA~BBB 格	70,594	95.44	95.64	7.48	0.77	1.29	1.25	6.38	6.33	6.35	40
短期 (1-3)	20,594	99.13	99.26	2.09	0.49	0.93	0.93	2.07	2.07	2.07	36
中期 (3-7)	26,948	98.07	98.26	4.79	0.70	1.11	1.10	4.70	4.67	4.70	41
長期 (7-)	23,052	89.06	89.34	15.43	1.09	1.89	1.76	12.81	12.68	12.71	42
長期 (7-11)	9,682	97.89	98.17	8.78	1.11	1.38	1.37	8.35	8.29	8.35	44
超長期 (11-)	13,370	82.67	82.94	20.25	1.08	2.32	2.11	16.63	16.45	16.44	40
AAA~BB 格	70,594	95.44	95.64	7.48	0.77	1.29	1.25	6.38	6.33	6.35	40
短期 (1-3)	20,594	99.13	99.26	2.09	0.49	0.93	0.93	2.07	2.07	2.07	36
中期 (3-7)	26,948	98.07	98.26	4.79	0.70	1.11	1.10	4.70	4.67	4.70	41
長期 (7-)	23,052	89.06	89.34	15.43	1.09	1.89	1.76	12.81	12.68	12.71	42
長期 (7-11)	9,682	97.89	98.17	8.78	1.11	1.38	1.37	8.35	8.29	8.35	44
超長期 (11-)	13,370	82.67	82.94	20.25	1.08	2.32	2.11	16.63	16.45	16.44	40
AAA 格	11,669	96.77	96.90	5.58	0.48	0.98	0.95	4.82	4.79	4.80	22
短期 (1-3)	4,525	98.95	99.02	2.08	0.23	0.76	0.76	2.07	2.06	2.07	19
中期 (3-7)	5,157	98.10	98.25	4.69	0.51	0.92	0.91	4.62	4.60	4.62	22
長期 (7-)	1,987	88.32	88.59	15.89	0.96	1.70	1.56	12.40	12.29	12.26	29
長期 (7-11)	1,185	97.56	97.81	8.74	0.91	1.23	1.22	8.38	8.33	8.38	29
超長期 (11-)	802	74.67	74.96	26.45	1.04	2.59	2.22	20.15	19.91	19.74	27
AA 格	39,425	94.60	94.82	8.97	0.84	1.32	1.27	7.45	7.38	7.40	33
短期 (1-3)	9,931	99.40	99.55	2.11	0.57	0.88	0.88	2.10	2.09	2.10	31
中期 (3-7)	13,373	98.56	98.75	4.85	0.75	1.05	1.04	4.75	4.72	4.75	35
長期 (7-)	16,122	88.38	88.65	16.62	1.09	1.88	1.75	13.64	13.51	13.51	33
長期 (7-11)	5,822	98.49	98.78	8.80	1.09	1.29	1.28	8.37	8.32	8.37	34
超長期 (11-)	10,300	82.66	82.92	21.05	1.09	2.28	2.07	17.18	17.00	16.98	31
A 格	19,048	96.32	96.52	5.63	0.79	1.42	1.39	5.23	5.18	5.22	63
短期 (1-3)	5,916	98.85	98.99	2.05	0.53	1.12	1.12	2.04	2.03	2.04	56
中期 (3-7)	8,220	97.29	97.49	4.77	0.75	1.32	1.30	4.67	4.64	4.67	61
長期 (7-)	4,913	91.63	91.91	11.36	1.16	1.99	1.90	10.35	10.25	10.33	75
長期 (7-11)	2,665	96.72	97.02	8.77	1.23	1.67	1.63	8.29	8.22	8.28	71
超長期 (11-)	2,248	85.60	85.85	14.43	1.08	2.43	2.25	13.11	12.97	13.07	82
BBB 格	451	97.08	97.32	3.88	0.79	1.55	1.53	3.70	3.67	3.70	87
短期 (1-3)	223	98.49	98.75	2.16	0.80	1.57	1.56	2.13	2.12	2.13	99
中期 (3-7)	198	97.00	97.21	4.56	0.76	1.44	1.42	4.47	4.44	4.47	74
長期 (7-)	30	87.09	87.39	12.16	0.88	2.17	2.02	11.21	11.09	11.19	80
長期 (7-11)	10	94.35	94.62	7.66	0.77	1.60	1.56	7.42	7.37	7.42	74
超長期 (11-)	20	83.46	83.78	14.41	0.93	2.49	2.28	13.34	13.19	13.31	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11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	12,147	95.14	95.31	6.99	0.65	1.20	1.16	5.76	5.72	5.72	35
短期(1-3)	3,885	99.17	99.30	1.94	0.44	0.87	0.87	1.93	1.92	1.93	32
中期(3-7)	4,926	98.11	98.27	4.51	0.63	1.06	1.05	4.43	4.41	4.43	37
長期(7-)	3,336	86.06	86.30	16.52	0.93	1.88	1.73	13.13	13.00	12.98	37
長期(7-11)	1,480	97.10	97.36	8.62	0.93	1.32	1.30	8.27	8.21	8.26	39
超長期(11-)	1,856	77.25	77.48	22.81	0.93	2.45	2.15	17.99	17.79	17.71	35
AAA~A格	68,645	95.46	95.66	7.37	0.75	1.27	1.23	6.26	6.21	6.23	38
短期(1-3)	20,490	99.19	99.32	1.94	0.47	0.91	0.91	1.93	1.92	1.93	35
中期(3-7)	25,627	98.16	98.34	4.67	0.68	1.07	1.06	4.58	4.56	4.58	38
長期(7-)	22,529	89.01	89.29	15.36	1.08	1.89	1.76	12.74	12.62	12.64	42
長期(7-11)	9,506	97.65	97.94	8.66	1.08	1.40	1.38	8.25	8.19	8.24	46
超長期(11-)	13,024	82.71	82.97	20.26	1.08	2.31	2.09	16.61	16.43	16.43	39
AAA~BBB格	70,925	95.46	95.66	7.33	0.75	1.28	1.23	6.24	6.19	6.21	39
短期(1-3)	21,079	99.17	99.30	1.94	0.47	0.92	0.92	1.93	1.92	1.93	36
中期(3-7)	26,678	98.15	98.34	4.67	0.68	1.08	1.07	4.58	4.56	4.58	39
長期(7-)	23,168	89.00	89.28	15.32	1.08	1.89	1.77	12.72	12.60	12.62	43
長期(7-11)	9,812	97.60	97.89	8.65	1.08	1.40	1.38	8.24	8.19	8.24	46
超長期(11-)	13,356	82.68	82.95	20.21	1.08	2.31	2.10	16.60	16.42	16.41	39
AAA~BB格	71,165	95.48	95.68	7.33	0.75	1.28	1.24	6.24	6.19	6.21	39
短期(1-3)	21,079	99.17	99.30	1.94	0.47	0.92	0.92	1.93	1.92	1.93	36
中期(3-7)	26,893	98.17	98.36	4.66	0.69	1.09	1.08	4.58	4.55	4.58	39
長期(7-)	23,193	89.01	89.28	15.32	1.08	1.89	1.77	12.72	12.60	12.62	43
長期(7-11)	9,812	97.60	97.89	8.65	1.08	1.40	1.38	8.24	8.19	8.24	46
超長期(11-)	13,381	82.70	82.97	20.20	1.08	2.31	2.10	16.59	16.41	16.41	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	95.14	95.31	6.99	0.65	1.20	1.16	5.76	5.72	5.72	35
短期(1-3)	3,885	99.17	99.30	1.94	0.44	0.87	0.87	1.93	1.92	1.93	32
中期(3-7)	4,926	98.11	98.27	4.51	0.63	1.06	1.05	4.43	4.41	4.43	37
長期(7-)	3,336	86.06	86.30	16.52	0.93	1.88	1.73	13.13	13.00	12.98	37
長期(7-11)	1,480	97.10	97.36	8.62	0.93	1.32	1.30	8.27	8.21	8.26	39
超長期(11-)	1,856	77.25	77.48	22.81	0.93	2.45	2.15	17.99	17.79	17.71	35
A格	56,499	95.53	95.74	7.45	0.77	1.29	1.24	6.37	6.32	6.34	39
短期(1-3)	16,605	99.19	99.32	1.94	0.48	0.92	0.91	1.93	1.92	1.93	36
中期(3-7)	20,701	98.17	98.36	4.71	0.69	1.08	1.07	4.62	4.60	4.62	38
長期(7-)	19,193	89.52	89.81	15.16	1.11	1.89	1.77	12.68	12.55	12.58	43
長期(7-11)	8,025	97.75	98.05	8.66	1.11	1.41	1.39	8.24	8.18	8.24	47
超長期(11-)	11,168	83.61	83.89	19.84	1.10	2.28	2.08	16.40	16.23	16.23	40
BBB格	2,279	95.53	95.72	6.42	0.76	1.43	1.39	5.73	5.68	5.71	58
短期(1-3)	590	98.64	98.82	1.93	0.56	1.28	1.27	1.92	1.91	1.92	72
中期(3-7)	1,051	97.96	98.14	4.54	0.73	1.21	1.20	4.45	4.43	4.45	52
長期(7-)	639	88.67	88.88	13.65	0.99	1.97	1.84	11.95	11.83	11.89	56
長期(7-11)	306	96.15	96.35	8.51	0.98	1.53	1.49	8.16	8.10	8.15	58
超長期(11-)	333	81.78	82.02	18.38	1.00	2.45	2.22	16.04	15.86	15.94	54
BB格	240	100.14	100.55	5.50	2.26	2.08	2.08	4.98	4.92	4.97	133
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	215	101.00	101.47	4.33	2.25	1.98	1.99	4.13	4.09	4.13	131
長期(7-)	25	92.71	92.71	15.49	2.37	3.06	2.96	12.94	12.75	12.86	146
長期(7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期(11-)	25	92.71	92.71	15.49	2.37	3.06	2.96	12.94	12.75	12.86	146
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 11 月末、12 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	12,054	95.06	95.23	7.16	0.66	1.21	1.17	5.93	5.88	5.89	35
短期 (1-3)	3,801	99.11	99.23	2.13	0.45	0.89	0.88	2.12	2.11	2.12	32
中期 (3-7)	4,947	98.01	98.17	4.68	0.63	1.07	1.06	4.60	4.57	4.60	37
長期 (7-)	3,306	85.98	86.22	16.64	0.94	1.90	1.74	13.22	13.09	13.08	37
長期 (7-11)	1,450	97.14	97.40	8.74	0.95	1.33	1.31	8.37	8.31	8.36	39
超長期 (11-)	1,856	77.25	77.48	22.81	0.93	2.45	2.15	17.99	17.79	17.71	35
AAA~A 格	68,069	95.42	95.62	7.51	0.76	1.28	1.24	6.40	6.35	6.36	39
短期 (1-3)	20,038	99.15	99.28	2.09	0.48	0.92	0.92	2.07	2.06	2.07	35
中期 (3-7)	25,651	98.06	98.24	4.80	0.69	1.09	1.08	4.71	4.68	4.71	39
長期 (7-)	22,380	89.06	89.33	15.48	1.09	1.88	1.76	12.83	12.70	12.72	41
長期 (7-11)	9,387	97.92	98.21	8.79	1.11	1.38	1.37	8.35	8.30	8.35	44
超長期 (11-)	12,993	82.65	82.92	20.31	1.08	2.31	2.10	16.65	16.47	16.46	39
AAA~BBB 格	70,354	95.42	95.62	7.48	0.76	1.29	1.25	6.38	6.33	6.35	39
短期 (1-3)	20,594	99.13	99.26	2.09	0.49	0.93	0.93	2.07	2.07	2.07	36
中期 (3-7)	26,733	98.05	98.23	4.80	0.69	1.10	1.09	4.70	4.68	4.70	40
長期 (7-)	23,027	89.06	89.33	15.43	1.09	1.89	1.76	12.81	12.68	12.71	42
長期 (7-11)	9,682	97.89	98.17	8.78	1.11	1.38	1.37	8.35	8.29	8.35	44
超長期 (11-)	13,345	82.65	82.92	20.26	1.08	2.32	2.10	16.64	16.46	16.45	40
AAA~BB 格	70,594	95.44	95.64	7.48	0.77	1.29	1.25	6.38	6.33	6.35	40
短期 (1-3)	20,594	99.13	99.26	2.09	0.49	0.93	0.93	2.07	2.07	2.07	36
中期 (3-7)	26,948	98.07	98.26	4.79	0.70	1.11	1.10	4.70	4.67	4.70	41
長期 (7-)	23,052	89.06	89.34	15.43	1.09	1.89	1.76	12.81	12.68	12.71	42
長期 (7-11)	9,682	97.89	98.17	8.78	1.11	1.38	1.37	8.35	8.29	8.35	44
超長期 (11-)	13,370	82.67	82.94	20.25	1.08	2.32	2.11	16.63	16.45	16.44	40
AAA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA 格	12,054	95.06	95.23	7.16	0.66	1.21	1.17	5.93	5.88	5.89	35
短期 (1-3)	3,801	99.11	99.23	2.13	0.45	0.89	0.88	2.12	2.11	2.12	32
中期 (3-7)	4,947	98.01	98.17	4.68	0.63	1.07	1.06	4.60	4.57	4.60	37
長期 (7-)	3,306	85.98	86.22	16.64	0.94	1.90	1.74	13.22	13.09	13.08	37
長期 (7-11)	1,450	97.14	97.40	8.74	0.95	1.33	1.31	8.37	8.31	8.36	39
超長期 (11-)	1,856	77.25	77.48	22.81	0.93	2.45	2.15	17.99	17.79	17.71	35
A 格	56,015	95.50	95.70	7.59	0.78	1.30	1.25	6.50	6.45	6.47	39
短期 (1-3)	16,237	99.16	99.29	2.08	0.49	0.93	0.92	2.06	2.05	2.06	36
中期 (3-7)	20,705	98.07	98.26	4.83	0.70	1.10	1.09	4.73	4.71	4.73	40
長期 (7-)	19,074	89.59	89.87	15.27	1.12	1.88	1.77	12.76	12.64	12.66	42
長期 (7-11)	7,937	98.06	98.36	8.80	1.14	1.39	1.38	8.35	8.29	8.35	44
超長期 (11-)	11,137	83.55	83.83	19.89	1.10	2.29	2.09	16.45	16.27	16.27	40
BBB 格	2,285	95.52	95.70	6.68	0.79	1.44	1.40	5.97	5.92	5.95	58
短期 (1-3)	556	98.52	98.70	2.12	0.57	1.31	1.30	2.10	2.09	2.10	73
中期 (3-7)	1,082	97.80	97.98	4.69	0.76	1.25	1.24	4.59	4.56	4.59	55
長期 (7-)	647	89.11	89.33	13.95	1.02	1.93	1.81	12.17	12.05	12.11	51
長期 (7-11)	295	96.82	97.01	8.56	0.98	1.41	1.39	8.20	8.14	8.20	48
超長期 (11-)	352	82.64	82.88	18.46	1.06	2.43	2.22	16.06	15.88	15.95	53
BB 格	240	100.14	100.55	5.50	2.26	2.08	2.08	4.98	4.92	4.97	133
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	215	101.00	101.47	4.33	2.25	1.98	1.99	4.13	4.09	4.13	131
長期 (7-)	25	92.71	92.71	15.49	2.37	3.06	2.96	12.94	12.75	12.86	146
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	25	92.71	92.71	15.49	2.37	3.06	2.96	12.94	12.75	12.86	146
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11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	41,872	94.99	95.21	8.53	0.78	1.23	1.18	6.99	6.93	6.94	28
短期 (1-3)	11,739	99.34	99.47	1.95	0.45	0.80	0.80	1.94	1.93	1.94	25
中期 (3-7)	14,503	98.84	99.04	4.63	0.72	0.97	0.96	4.54	4.52	4.54	28
長期 (7-)	15,631	88.16	88.45	17.09	1.09	1.86	1.73	13.80	13.66	13.66	30
長期 (7-11)	5,765	98.67	98.97	8.75	1.07	1.24	1.23	8.33	8.28	8.33	31
超長期 (11-)	9,865	82.03	82.30	21.97	1.11	2.29	2.07	17.64	17.44	17.40	29
AAA~A 格	64,386	95.36	95.56	7.59	0.76	1.27	1.22	6.42	6.37	6.39	37
短期 (1-3)	18,758	99.20	99.33	1.95	0.45	0.88	0.88	1.94	1.93	1.94	33
中期 (3-7)	23,758	98.29	98.48	4.68	0.70	1.06	1.06	4.59	4.56	4.59	37
長期 (7-)	21,871	88.89	89.17	15.60	1.08	1.88	1.75	12.90	12.77	12.79	40
長期 (7-11)	9,022	97.80	98.08	8.69	1.07	1.36	1.34	8.28	8.22	8.27	42
超長期 (11-)	12,849	82.64	82.91	20.46	1.09	2.31	2.10	16.74	16.55	16.54	38
AAA~BBB 格	64,940	95.37	95.57	7.56	0.76	1.27	1.23	6.40	6.34	6.36	37
短期 (1-3)	18,998	99.19	99.32	1.95	0.46	0.89	0.89	1.94	1.93	1.94	34
中期 (3-7)	24,031	98.27	98.46	4.67	0.70	1.07	1.06	4.58	4.56	4.58	38
長期 (7-)	21,912	88.89	89.16	15.59	1.08	1.88	1.76	12.89	12.77	12.79	40
長期 (7-11)	9,043	97.77	98.05	8.69	1.07	1.36	1.35	8.28	8.22	8.27	43
超長期 (11-)	12,869	82.65	82.91	20.45	1.09	2.31	2.10	16.73	16.55	16.54	38
AAA~BB 格	64,940	95.37	95.57	7.56	0.76	1.27	1.23	6.40	6.34	6.36	37
短期 (1-3)	18,998	99.19	99.32	1.95	0.46	0.89	0.89	1.94	1.93	1.94	34
中期 (3-7)	24,031	98.27	98.46	4.67	0.70	1.07	1.06	4.58	4.56	4.58	38
長期 (7-)	21,912	88.89	89.16	15.59	1.08	1.88	1.76	12.89	12.77	12.79	40
長期 (7-11)	9,043	97.77	98.05	8.69	1.07	1.36	1.35	8.28	8.22	8.27	43
超長期 (11-)	12,869	82.65	82.91	20.45	1.09	2.31	2.10	16.73	16.55	16.54	38
AAA 格	885	97.84	97.92	3.65	0.32	0.91	0.90	3.56	3.54	3.56	26
短期 (1-3)	465	98.85	98.90	1.97	0.20	0.81	0.81	1.97	1.96	1.97	25
中期 (3-7)	320	97.71	97.79	4.33	0.42	0.94	0.93	4.28	4.26	4.28	26
長期 (7-)	100	93.51	93.79	9.31	0.57	1.31	1.27	8.98	8.92	8.98	29
長期 (7-11)	70	95.85	96.16	8.22	0.62	1.18	1.16	7.99	7.95	7.99	28
超長期 (11-)	30	88.05	88.27	11.84	0.45	1.66	1.56	11.49	11.40	11.48	32
AA 格	40,987	94.93	95.15	8.64	0.79	1.24	1.19	7.07	7.01	7.02	28
短期 (1-3)	11,274	99.36	99.49	1.95	0.46	0.80	0.80	1.94	1.93	1.94	25
中期 (3-7)	14,183	98.86	99.07	4.64	0.72	0.97	0.96	4.55	4.53	4.55	28
長期 (7-)	15,531	88.13	88.41	17.14	1.10	1.86	1.73	13.83	13.69	13.69	30
長期 (7-11)	5,695	98.70	99.00	8.75	1.08	1.24	1.24	8.33	8.28	8.33	31
超長期 (11-)	9,835	82.01	82.28	22.00	1.11	2.29	2.07	17.66	17.46	17.42	29
A 格	22,514	96.05	96.23	5.85	0.71	1.34	1.31	5.37	5.33	5.36	53
短期 (1-3)	7,019	98.96	99.09	1.95	0.46	1.02	1.01	1.94	1.93	1.94	46
中期 (3-7)	9,255	97.43	97.60	4.74	0.67	1.22	1.20	4.65	4.63	4.65	52
長期 (7-)	6,240	90.73	90.97	11.86	1.04	1.92	1.83	10.71	10.61	10.69	66
長期 (7-11)	3,256	96.26	96.50	8.59	1.06	1.57	1.54	8.18	8.12	8.18	63
超長期 (11-)	2,984	84.69	84.92	15.44	1.02	2.36	2.18	13.86	13.70	13.80	69
BBB 格	554	96.67	96.95	3.73	0.82	1.70	1.67	3.55	3.52	3.55	103
短期 (1-3)	241	98.33	98.61	1.81	0.76	1.68	1.67	1.79	1.78	1.79	113
中期 (3-7)	272	97.01	97.27	4.37	0.85	1.56	1.53	4.27	4.24	4.27	86
長期 (7-)	41	84.67	85.01	10.79	0.93	2.96	2.70	10.10	9.97	10.08	159
長期 (7-11)	21	85.81	86.19	7.34	0.93	3.39	3.09	7.09	6.99	7.09	229
超長期 (11-)	20	83.46	83.78	14.41	0.93	2.49	2.28	13.34	13.19	13.31	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	96.59	96.78	4.90	0.71	1.37	1.33	4.61	4.58	4.61	62
短期 (1-3)	2,081	98.99	99.14	1.82	0.59	1.15	1.14	1.80	1.79	1.80	60
中期 (3-7)	2,862	97.32	97.49	4.59	0.63	1.24	1.22	4.51	4.49	4.51	54
長期 (7-)	1,281	91.04	91.38	10.61	1.07	2.06	1.93	9.81	9.71	9.79	85
長期 (7-11)	769	95.63	96.02	8.27	1.22	1.88	1.80	7.85	7.78	7.85	92
超長期 (11-)	512	84.14	84.41	14.11	0.85	2.36	2.15	13.14	13.00	13.11	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11月末、12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	41,935	94.98	95.19	8.64	0.79	1.24	1.19	7.10	7.04	7.05	28
短期 (1-3)	11,674	99.34	99.47	2.10	0.47	0.81	0.81	2.08	2.07	2.08	25
中期 (3-7)	14,567	98.78	98.98	4.76	0.72	0.98	0.97	4.67	4.64	4.67	28
長期 (7-)	15,695	88.20	88.49	17.10	1.10	1.86	1.73	13.81	13.68	13.67	30
長期 (7-11)	5,893	98.71	99.01	8.85	1.09	1.25	1.24	8.42	8.37	8.42	31
超長期 (11-)	9,802	81.89	82.16	22.06	1.11	2.30	2.08	17.71	17.52	17.47	29
AAA~A 格	64,326	95.35	95.55	7.71	0.77	1.28	1.23	6.53	6.48	6.49	37
短期 (1-3)	18,484	99.18	99.32	2.07	0.47	0.89	0.89	2.06	2.05	2.06	32
中期 (3-7)	23,957	98.25	98.44	4.78	0.70	1.07	1.06	4.69	4.66	4.69	37
長期 (7-)	21,886	88.94	89.21	15.66	1.09	1.88	1.76	12.95	12.83	12.84	40
長期 (7-11)	9,048	97.91	98.19	8.80	1.09	1.37	1.35	8.37	8.31	8.37	42
超長期 (11-)	12,838	82.61	82.88	20.50	1.09	2.32	2.10	16.78	16.59	16.58	39
AAA~BBB 格	64,857	95.36	95.56	7.68	0.77	1.28	1.24	6.51	6.45	6.47	37
短期 (1-3)	18,701	99.17	99.30	2.07	0.47	0.90	0.90	2.06	2.05	2.06	33
中期 (3-7)	24,240	98.23	98.41	4.78	0.70	1.08	1.07	4.69	4.66	4.69	38
長期 (7-)	21,916	88.93	89.20	15.66	1.09	1.89	1.76	12.95	12.82	12.84	40
長期 (7-11)	9,058	97.90	98.18	8.80	1.09	1.37	1.35	8.37	8.31	8.36	42
超長期 (11-)	12,858	82.61	82.88	20.49	1.09	2.32	2.10	16.77	16.59	16.58	39
AAA~BB 格	64,857	95.36	95.56	7.68	0.77	1.28	1.24	6.51	6.45	6.47	37
短期 (1-3)	18,701	99.17	99.30	2.07	0.47	0.90	0.90	2.06	2.05	2.06	33
中期 (3-7)	24,240	98.23	98.41	4.78	0.70	1.08	1.07	4.69	4.66	4.69	38
長期 (7-)	21,916	88.93	89.20	15.66	1.09	1.89	1.76	12.95	12.82	12.84	40
長期 (7-11)	9,058	97.90	98.18	8.80	1.09	1.37	1.35	8.37	8.31	8.36	42
超長期 (11-)	12,858	82.61	82.88	20.49	1.09	2.32	2.10	16.77	16.59	16.58	39
AAA 格	955	97.92	98.00	3.70	0.35	0.91	0.90	3.61	3.59	3.61	26
短期 (1-3)	485	98.87	98.92	2.01	0.22	0.81	0.81	2.00	2.00	2.00	25
中期 (3-7)	370	97.86	97.94	4.40	0.46	0.94	0.94	4.35	4.33	4.35	26
長期 (7-)	100	93.51	93.79	9.31	0.57	1.31	1.27	8.98	8.92	8.98	29
長期 (7-11)	70	95.85	96.16	8.22	0.62	1.18	1.16	7.99	7.95	7.99	28
超長期 (11-)	30	88.05	88.27	11.84	0.45	1.66	1.56	11.49	11.40	11.48	32
AA 格	40,980	94.91	95.12	8.75	0.80	1.24	1.19	7.18	7.12	7.13	28
短期 (1-3)	11,189	99.36	99.50	2.10	0.48	0.81	0.81	2.09	2.08	2.09	25
中期 (3-7)	14,197	98.81	99.01	4.77	0.72	0.98	0.97	4.68	4.65	4.68	28
長期 (7-)	15,595	88.17	88.45	17.15	1.10	1.86	1.73	13.84	13.71	13.70	30
長期 (7-11)	5,823	98.75	99.04	8.86	1.09	1.25	1.25	8.43	8.38	8.42	31
超長期 (11-)	9,772	81.87	82.14	22.09	1.11	2.30	2.08	17.73	17.54	17.49	29
A 格	22,391	96.04	96.22	5.96	0.72	1.35	1.32	5.48	5.43	5.47	54
短期 (1-3)	6,810	98.91	99.04	2.04	0.47	1.02	1.02	2.02	2.01	2.02	46
中期 (3-7)	9,390	97.43	97.59	4.82	0.68	1.22	1.21	4.72	4.69	4.72	52
長期 (7-)	6,191	90.79	91.03	12.02	1.07	1.94	1.85	10.84	10.73	10.81	66
長期 (7-11)	3,155	96.40	96.65	8.70	1.11	1.59	1.56	8.27	8.20	8.26	64
超長期 (11-)	3,036	84.96	85.19	15.48	1.04	2.37	2.19	13.87	13.72	13.81	69
BBB 格	530	96.53	96.80	4.04	0.86	1.75	1.72	3.85	3.82	3.85	105
短期 (1-3)	217	98.12	98.41	2.14	0.81	1.78	1.77	2.12	2.10	2.12	120
中期 (3-7)	283	96.32	96.57	4.63	0.90	1.70	1.65	4.50	4.46	4.50	97
長期 (7-)	30	87.09	87.39	12.16	0.88	2.17	2.02	11.21	11.09	11.19	80
長期 (7-11)	10	94.35	94.62	7.66	0.77	1.60	1.56	7.42	7.37	7.42	74
超長期 (11-)	20	83.46	83.78	14.41	0.93	2.49	2.28	13.34	13.19	13.31	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	5,737	96.34	96.54	5.24	0.74	1.42	1.38	4.93	4.90	4.93	65
短期 (1-3)	1,893	98.72	98.87	2.22	0.62	1.20	1.20	2.20	2.19	2.20	63
中期 (3-7)	2,708	96.67	96.86	4.90	0.68	1.36	1.34	4.79	4.76	4.79	64
長期 (7-)	1,136	91.57	91.90	11.07	1.10	1.93	1.81	10.17	10.08	10.16	69
長期 (7-11)	624	97.67	98.04	8.57	1.30	1.62	1.57	8.08	8.01	8.07	67
超長期 (11-)	512	84.14	84.41	14.11	0.85	2.36	2.15	13.14	13.00	13.11	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11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	30,223	96.26	96.41	5.87	0.57	1.13	1.10	5.21	5.17	5.20	34
短期 (1-3)	10,276	99.11	99.21	1.91	0.36	0.85	0.85	1.90	1.89	1.90	29
中期 (3-7)	12,711	97.72	97.87	4.66	0.54	1.03	1.02	4.58	4.56	4.58	34
長期 (7-)	7,236	89.63	89.87	13.62	0.93	1.75	1.64	11.60	11.50	11.54	41
長期 (7-11)	3,827	96.99	97.23	8.54	0.92	1.33	1.31	8.20	8.14	8.19	40
超長期 (11-)	3,409	81.36	81.59	19.33	0.94	2.32	2.09	16.16	15.99	16.01	43
AAA~A 格	42,264	96.18	96.35	5.82	0.65	1.23	1.20	5.23	5.19	5.22	44
短期 (1-3)	13,845	99.05	99.16	1.92	0.41	0.92	0.92	1.91	1.90	1.91	36
中期 (3-7)	17,686	97.68	97.84	4.66	0.62	1.12	1.11	4.58	4.56	4.58	43
長期 (7-)	10,733	89.99	90.25	12.76	1.00	1.88	1.77	11.10	11.00	11.05	58
長期 (7-11)	5,763	96.26	96.52	8.57	1.01	1.52	1.48	8.19	8.13	8.18	57
超長期 (11-)	4,970	82.72	82.97	17.63	1.00	2.38	2.16	15.04	14.87	14.92	59
AAA~BBB 格	42,537	96.18	96.35	5.81	0.65	1.24	1.20	5.22	5.18	5.21	44
短期 (1-3)	13,976	99.05	99.16	1.92	0.41	0.92	0.92	1.91	1.90	1.91	37
中期 (3-7)	17,799	97.68	97.84	4.66	0.62	1.12	1.11	4.58	4.55	4.58	43
長期 (7-)	10,763	89.98	90.24	12.76	1.00	1.88	1.77	11.10	11.00	11.05	58
長期 (7-11)	5,773	96.25	96.52	8.57	1.01	1.52	1.48	8.19	8.13	8.18	57
超長期 (11-)	4,990	82.73	82.98	17.62	1.00	2.38	2.16	15.03	14.87	14.91	59
AAA~BB 格	42,537	96.18	96.35	5.81	0.65	1.24	1.20	5.22	5.18	5.21	44
短期 (1-3)	13,976	99.05	99.16	1.92	0.41	0.92	0.92	1.91	1.90	1.91	37
中期 (3-7)	17,799	97.68	97.84	4.66	0.62	1.12	1.11	4.58	4.55	4.58	43
長期 (7-)	10,763	89.98	90.24	12.76	1.00	1.88	1.77	11.10	11.00	11.05	58
長期 (7-11)	5,773	96.25	96.52	8.57	1.01	1.52	1.48	8.19	8.13	8.18	57
超長期 (11-)	4,990	82.73	82.98	17.62	1.00	2.38	2.16	15.03	14.87	14.91	59
AAA 格	11,130	96.68	96.82	5.48	0.45	0.96	0.94	4.69	4.66	4.66	22
短期 (1-3)	4,230	99.03	99.09	1.84	0.20	0.74	0.74	1.84	1.83	1.84	19
中期 (3-7)	5,032	98.04	98.19	4.54	0.47	0.90	0.90	4.48	4.46	4.48	22
長期 (7-)	1,868	87.70	87.98	16.23	0.94	1.71	1.56	12.58	12.46	12.43	28
長期 (7-11)	1,066	97.50	97.78	8.54	0.87	1.20	1.18	8.21	8.16	8.21	28
超長期 (11-)	802	74.67	74.96	26.45	1.04	2.59	2.22	20.15	19.91	19.74	27
AA 格	19,093	96.01	96.17	6.10	0.65	1.23	1.19	5.52	5.48	5.51	41
短期 (1-3)	6,047	99.16	99.29	1.95	0.48	0.92	0.92	1.94	1.93	1.94	37
中期 (3-7)	7,678	97.52	97.66	4.74	0.59	1.12	1.11	4.65	4.63	4.65	42
長期 (7-)	5,368	90.30	90.52	12.72	0.93	1.77	1.67	11.28	11.17	11.23	46
長期 (7-11)	2,761	96.79	97.02	8.54	0.94	1.37	1.35	8.19	8.14	8.19	45
超長期 (11-)	2,607	83.41	83.63	17.14	0.91	2.25	2.05	15.07	14.91	14.98	47
A 格	12,041	95.98	96.19	5.70	0.83	1.50	1.46	5.29	5.24	5.28	70
短期 (1-3)	3,569	98.89	99.02	1.96	0.53	1.12	1.12	1.95	1.94	1.95	56
中期 (3-7)	4,975	97.57	97.77	4.68	0.82	1.35	1.33	4.58	4.55	4.58	65
長期 (7-)	3,497	90.74	91.04	10.98	1.15	2.15	2.04	10.08	9.98	10.07	92
長期 (7-11)	1,936	94.81	95.11	8.62	1.17	1.90	1.84	8.17	8.09	8.16	92
超長期 (11-)	1,562	85.71	85.98	13.92	1.11	2.50	2.31	12.71	12.56	12.67	91
BBB 格	273	97.14	97.40	3.86	0.78	1.43	1.40	3.61	3.58	3.60	75
短期 (1-3)	130	99.00	99.23	1.66	0.75	1.34	1.33	1.64	1.63	1.64	81
中期 (3-7)	113	97.67	97.95	4.19	0.78	1.36	1.34	4.10	4.08	4.10	67
長期 (7-)	30	87.09	87.39	12.16	0.88	2.17	2.02	11.21	11.09	11.19	80
長期 (7-11)	10	94.35	94.62	7.66	0.77	1.60	1.56	7.42	7.37	7.42	74
超長期 (11-)	20	83.46	83.78	14.41	0.93	2.49	2.28	13.34	13.19	13.31	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	94.44	94.68	9.59	0.91	1.35	1.29	7.77	7.71	7.71	32
短期 (1-3)	7,104	99.41	99.58	1.98	0.59	0.91	0.91	1.96	1.95	1.96	35
中期 (3-7)	9,094	99.14	99.37	4.67	0.83	1.02	1.01	4.57	4.55	4.57	33
長期 (7-)	12,430	88.16	88.45	17.53	1.15	1.90	1.76	14.14	14.01	14.00	30
長期 (7-11)	4,039	99.53	99.86	8.78	1.19	1.25	1.24	8.32	8.27	8.32	31
超長期 (11-)	8,391	82.69	82.96	21.74	1.13	2.27	2.06	17.52	17.33	17.29	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11月末、12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	30,430	96.26	96.41	6.01	0.59	1.14	1.11	5.35	5.31	5.33	34
短期 (1-3)	10,282	99.03	99.13	2.09	0.38	0.86	0.86	2.08	2.07	2.08	29
中期 (3-7)	12,828	97.74	97.88	4.79	0.56	1.04	1.03	4.71	4.69	4.71	34
長期 (7-)	7,320	89.77	90.00	13.65	0.95	1.75	1.65	11.63	11.53	11.56	41
長期 (7-11)	3,892	97.09	97.33	8.64	0.95	1.33	1.32	8.28	8.22	8.28	40
超長期 (11-)	3,428	81.45	81.68	19.33	0.95	2.32	2.09	16.17	15.99	16.01	43
AAA~A 格	42,460	96.18	96.35	5.95	0.66	1.24	1.21	5.35	5.31	5.34	44
短期 (1-3)	13,830	98.99	99.09	2.07	0.42	0.93	0.92	2.06	2.05	2.06	36
中期 (3-7)	17,969	97.58	97.75	4.80	0.64	1.14	1.13	4.71	4.68	4.71	44
長期 (7-)	10,661	90.17	90.42	12.91	1.02	1.87	1.76	11.21	11.11	11.16	56
長期 (7-11)	5,631	96.65	96.90	8.70	1.03	1.48	1.45	8.30	8.24	8.29	53
超長期 (11-)	5,030	82.91	83.16	17.62	1.01	2.38	2.16	15.02	14.86	14.90	59
AAA~BBB 格	42,682	96.18	96.35	5.94	0.66	1.24	1.21	5.35	5.31	5.34	44
短期 (1-3)	13,929	98.98	99.09	2.07	0.42	0.93	0.93	2.06	2.05	2.06	36
中期 (3-7)	18,063	97.58	97.75	4.80	0.64	1.15	1.13	4.71	4.68	4.71	44
長期 (7-)	10,691	90.16	90.41	12.90	1.02	1.87	1.76	11.21	11.11	11.16	56
長期 (7-11)	5,641	96.64	96.90	8.70	1.03	1.48	1.45	8.29	8.23	8.29	53
超長期 (11-)	5,050	82.91	83.16	17.60	1.01	2.38	2.16	15.01	14.85	14.90	59
AAA~BB 格	42,682	96.18	96.35	5.94	0.66	1.24	1.21	5.35	5.31	5.34	44
短期 (1-3)	13,929	98.98	99.09	2.07	0.42	0.93	0.93	2.06	2.05	2.06	36
中期 (3-7)	18,063	97.58	97.75	4.80	0.64	1.15	1.13	4.71	4.68	4.71	44
長期 (7-)	10,691	90.16	90.41	12.90	1.02	1.87	1.76	11.21	11.11	11.16	56
長期 (7-11)	5,641	96.64	96.90	8.70	1.03	1.48	1.45	8.29	8.23	8.29	53
超長期 (11-)	5,050	82.91	83.16	17.60	1.01	2.38	2.16	15.01	14.85	14.90	59
AAA 格	11,569	96.75	96.89	5.61	0.48	0.98	0.95	4.84	4.81	4.82	22
短期 (1-3)	4,465	98.96	99.03	2.08	0.23	0.76	0.76	2.07	2.06	2.07	19
中期 (3-7)	5,117	98.10	98.25	4.70	0.51	0.92	0.91	4.63	4.61	4.63	22
長期 (7-)	1,987	88.32	88.59	15.89	0.96	1.70	1.56	12.40	12.29	12.26	29
長期 (7-11)	1,185	97.56	97.81	8.74	0.91	1.23	1.22	8.38	8.33	8.38	29
超長期 (11-)	802	74.67	74.96	26.45	1.04	2.59	2.22	20.15	19.91	19.74	27
AA 格	18,860	95.95	96.11	6.25	0.66	1.24	1.20	5.67	5.62	5.65	41
短期 (1-3)	5,818	99.09	99.22	2.10	0.49	0.94	0.93	2.09	2.08	2.09	37
中期 (3-7)	7,710	97.49	97.64	4.85	0.60	1.13	1.11	4.77	4.74	4.77	42
長期 (7-)	5,332	90.30	90.53	12.81	0.94	1.77	1.68	11.35	11.25	11.31	46
長期 (7-11)	2,706	96.89	97.12	8.60	0.96	1.38	1.36	8.23	8.18	8.23	45
超長期 (11-)	2,626	83.52	83.74	17.16	0.92	2.25	2.06	15.08	14.92	14.99	47
A 格	12,030	95.97	96.18	5.79	0.84	1.51	1.47	5.37	5.32	5.36	70
短期 (1-3)	3,548	98.85	98.98	2.02	0.54	1.13	1.12	2.01	2.00	2.01	56
中期 (3-7)	5,141	97.20	97.41	4.82	0.83	1.41	1.38	4.70	4.67	4.70	69
長期 (7-)	3,341	91.04	91.33	11.28	1.19	2.12	2.01	10.31	10.21	10.30	87
長期 (7-11)	1,740	95.65	95.94	8.83	1.23	1.81	1.76	8.34	8.26	8.33	83
超長期 (11-)	1,602	86.04	86.32	13.94	1.14	2.49	2.31	12.70	12.56	12.67	91
BBB 格	222	96.60	96.86	4.50	0.82	1.52	1.49	4.21	4.18	4.21	79
短期 (1-3)	99	98.73	98.98	2.25	0.85	1.46	1.45	2.22	2.20	2.22	88
中期 (3-7)	94	97.40	97.66	4.43	0.77	1.40	1.38	4.34	4.31	4.34	70
長期 (7-)	30	87.09	87.39	12.16	0.88	2.17	2.02	11.21	11.09	11.19	80
長期 (7-11)	10	94.35	94.62	7.66	0.77	1.60	1.56	7.42	7.37	7.42	74
超長期 (11-)	20	83.46	83.78	14.41	0.93	2.49	2.28	13.34	13.19	13.31	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	27,912	94.31	94.55	9.83	0.92	1.36	1.31	7.98	7.91	7.92	32
短期 (1-3)	6,665	99.44	99.62	2.12	0.62	0.92	0.92	2.10	2.09	2.10	36
中期 (3-7)	8,886	99.07	99.30	4.78	0.83	1.03	1.02	4.68	4.65	4.68	33
長期 (7-)	12,361	88.12	88.41	17.62	1.15	1.90	1.77	14.22	14.08	14.07	29
長期 (7-11)	4,041	99.62	99.96	8.90	1.21	1.25	1.25	8.42	8.37	8.42	31
超長期 (11-)	8,320	82.53	82.80	21.86	1.13	2.28	2.07	17.61	17.42	17.38	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11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	24,274	95.54	95.76	8.55	0.81	1.22	1.17	7.15	7.09	7.10	25
短期 (1-3)	6,846	99.34	99.46	1.96	0.44	0.79	0.79	1.95	1.94	1.95	23
中期 (3-7)	7,949	98.89	99.09	4.61	0.70	0.92	0.92	4.53	4.51	4.53	23
長期 (7-)	9,479	90.00	90.30	16.61	1.17	1.83	1.72	13.69	13.56	13.58	29
長期 (7-11)	3,344	99.33	99.64	8.77	1.13	1.23	1.22	8.34	8.28	8.33	29
超長期 (11-)	6,135	84.92	85.21	20.88	1.20	2.21	2.03	17.10	16.92	16.92	29
AAA~BBB 格	26,127	95.55	95.76	8.46	0.82	1.23	1.19	7.10	7.04	7.06	27
短期 (1-3)	7,116	99.32	99.44	1.96	0.43	0.79	0.79	1.95	1.94	1.95	23
中期 (3-7)	8,910	98.89	99.09	4.61	0.73	0.96	0.96	4.52	4.50	4.52	27
長期 (7-)	10,102	89.95	90.24	16.44	1.16	1.84	1.73	13.59	13.47	13.48	31
長期 (7-11)	3,629	99.14	99.44	8.76	1.12	1.24	1.24	8.33	8.28	8.32	31
超長期 (11-)	6,473	84.79	85.08	20.75	1.19	2.23	2.05	17.05	16.87	16.86	30
AAA~BB 格	26,127	95.55	95.76	8.46	0.82	1.23	1.19	7.10	7.04	7.06	27
短期 (1-3)	7,116	99.32	99.44	1.96	0.43	0.79	0.79	1.95	1.94	1.95	23
中期 (3-7)	8,910	98.89	99.09	4.61	0.73	0.96	0.96	4.52	4.50	4.52	27
長期 (7-)	10,102	89.95	90.24	16.44	1.16	1.84	1.73	13.59	13.47	13.48	31
長期 (7-11)	3,629	99.14	99.44	8.76	1.12	1.24	1.24	8.33	8.28	8.32	31
超長期 (11-)	6,473	84.79	85.08	20.75	1.19	2.23	2.05	17.05	16.87	16.86	30
AAA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
A 格	24,274	95.54	95.76	8.55	0.81	1.22	1.17	7.15	7.09	7.10	25
短期 (1-3)	6,846	99.34	99.46	1.96	0.44	0.79	0.79	1.95	1.94	1.95	23
中期 (3-7)	7,949	98.89	99.09	4.61	0.70	0.92	0.92	4.53	4.51	4.53	23
長期 (7-)	9,479	90.00	90.30	16.61	1.17	1.83	1.72	13.69	13.56	13.58	29
長期 (7-11)	3,344	99.33	99.64	8.77	1.13	1.23	1.22	8.34	8.28	8.33	29
超長期 (11-)	6,135	84.92	85.21	20.88	1.20	2.21	2.03	17.10	16.92	16.92	29
BBB 格	1,854	95.62	95.81	7.33	0.94	1.43	1.39	6.48	6.43	6.46	53
短期 (1-3)	270	98.87	98.96	2.05	0.33	0.88	0.87	2.04	2.03	2.04	31
中期 (3-7)	961	98.93	99.14	4.56	1.03	1.28	1.28	4.44	4.42	4.44	59
長期 (7-)	623	89.09	89.29	13.91	1.05	1.95	1.83	12.11	11.99	12.05	54
長期 (7-11)	285	96.91	97.10	8.60	0.98	1.40	1.38	8.23	8.17	8.22	47
超長期 (11-)	338	82.49	82.70	18.40	1.11	2.49	2.27	15.95	15.77	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	45,038	95.44	95.63	6.67	0.71	1.31	1.26	5.74	5.69	5.71	46
短期 (1-3)	13,964	99.09	99.23	1.93	0.49	0.98	0.98	1.91	1.90	1.91	43
中期 (3-7)	17,983	97.82	98.00	4.69	0.67	1.15	1.14	4.60	4.58	4.60	45
長期 (7-)	13,091	88.28	88.54	14.45	1.01	1.93	1.80	12.03	11.91	11.94	53
長期 (7-11)	6,183	96.70	96.99	8.59	1.06	1.50	1.47	8.19	8.13	8.19	56
超長期 (11-)	6,908	80.74	80.99	19.70	0.97	2.40	2.15	16.14	15.96	15.95	49

出所:NFRC

- 格付は、Moody's の格付をもとに NFRC で分類

事業債 Moody's 格付別・ポートフォリオ指標 (2024年11月末、12月ポートフォリオ)

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
AAA~AA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AAA~A 格	24,157	95.51	95.73	8.65	0.82	1.22	1.18	7.24	7.18	7.20	25
短期 (1-3)	6,813	99.35	99.47	2.08	0.45	0.80	0.79	2.07	2.06	2.07	23
中期 (3-7)	7,844	98.86	99.06	4.71	0.70	0.93	0.93	4.62	4.60	4.62	24
長期 (7-)	9,500	90.00	90.29	16.62	1.17	1.83	1.72	13.71	13.58	13.59	29
長期 (7-11)	3,408	99.37	99.67	8.84	1.13	1.23	1.23	8.39	8.34	8.39	29
超長期 (11-)	6,092	84.76	85.05	20.97	1.19	2.22	2.04	17.19	17.01	17.00	29
AAA~BBB 格	26,049	95.53	95.74	8.57	0.83	1.24	1.20	7.20	7.14	7.16	27
短期 (1-3)	7,083	99.33	99.44	2.08	0.45	0.80	0.80	2.07	2.06	2.07	23
中期 (3-7)	8,825	98.87	99.07	4.70	0.74	0.97	0.96	4.61	4.59	4.61	28
長期 (7-)	10,142	89.96	90.25	16.46	1.16	1.84	1.73	13.61	13.48	13.50	31
長期 (7-11)	3,693	99.18	99.47	8.82	1.12	1.24	1.24	8.38	8.33	8.38	31
超長期 (11-)	6,449	84.68	84.96	20.83	1.19	2.24	2.06	17.12	16.94	16.94	30
AAA~BB 格	26,049	95.53	95.74	8.57	0.83	1.24	1.20	7.20	7.14	7.16	27
短期 (1-3)	7,083	99.33	99.44	2.08	0.45	0.80	0.80	2.07	2.06	2.07	23
中期 (3-7)	8,825	98.87	99.07	4.70	0.74	0.97	0.96	4.61	4.59	4.61	28
長期 (7-)	10,142	89.96	90.25	16.46	1.16	1.84	1.73	13.61	13.48	13.50	31
長期 (7-11)	3,693	99.18	99.47	8.82	1.12	1.24	1.24	8.38	8.33	8.38	31
超長期 (11-)	6,449	84.68	84.96	20.83	1.19	2.24	2.06	17.12	16.94	16.94	30
AAA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
A 格	24,157	95.51	95.73	8.65	0.82	1.22	1.18	7.24	7.18	7.20	25
短期 (1-3)	6,813	99.35	99.47	2.08	0.45	0.80	0.79	2.07	2.06	2.07	23
中期 (3-7)	7,844	98.86	99.06	4.71	0.70	0.93	0.93	4.62	4.60	4.62	24
長期 (7-)	9,500	90.00	90.29	16.62	1.17	1.83	1.72	13.71	13.58	13.59	29
長期 (7-11)	3,408	99.37	99.67	8.84	1.13	1.23	1.23	8.39	8.34	8.39	29
超長期 (11-)	6,092	84.76	85.05	20.97	1.19	2.22	2.04	17.19	17.01	17.00	29
BBB 格	1,893	95.67	95.86	7.49	0.95	1.44	1.40	6.61	6.56	6.60	53
短期 (1-3)	270	98.81	98.89	2.12	0.31	0.89	0.88	2.11	2.10	2.11	32
中期 (3-7)	981	98.94	99.15	4.64	1.04	1.28	1.28	4.53	4.50	4.53	59
長期 (7-)	642	89.34	89.55	14.09	1.08	1.96	1.84	12.24	12.12	12.18	53
長期 (7-11)	285	96.91	97.10	8.60	0.98	1.40	1.38	8.23	8.17	8.22	47
超長期 (11-)	357	83.30	83.52	18.48	1.16	2.48	2.27	15.97	15.79	15.86	59
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	44,544	95.39	95.58	6.84	0.73	1.32	1.28	5.90	5.85	5.87	47
短期 (1-3)	13,511	99.03	99.17	2.09	0.51	1.00	0.99	2.08	2.07	2.08	43
中期 (3-7)	18,123	97.68	97.86	4.84	0.69	1.18	1.16	4.74	4.71	4.74	47
長期 (7-)	12,910	88.36	88.62	14.63	1.04	1.93	1.79	12.16	12.04	12.07	51
長期 (7-11)	5,989	97.09	97.37	8.76	1.10	1.47	1.45	8.33	8.27	8.33	52
超長期 (11-)	6,921	80.81	81.05	19.71	0.98	2.40	2.16	16.15	15.97	15.96	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11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	84.36	84.64	17.46	0.98	1.88	1.68	13.33	13.19	13.18	31
短期 (1-3)	40	102.15	102.94	2.07	1.75	0.80	0.81	2.02	2.02	2.02	24
中期 (3-7)	115	95.97	96.03	5.33	0.22	1.00	0.98	5.28	5.26	5.28	28
長期 (7-)	696	81.42	81.70	20.35	1.06	2.13	1.88	15.71	15.54	15.52	32
長期 (7-11)	212	100.33	100.61	8.54	1.25	1.21	1.21	8.09	8.04	8.09	30
超長期 (11-)	484	73.14	73.42	25.52	0.98	2.69	2.29	20.28	20.03	19.98	33
AAA~A 格	16,361	94.13	94.35	8.89	0.76	1.24	1.18	7.24	7.18	7.19	27
短期 (1-3)	4,038	99.51	99.64	1.91	0.48	0.79	0.78	1.90	1.89	1.90	23
中期 (3-7)	5,629	98.58	98.79	4.84	0.67	0.96	0.96	4.75	4.73	4.75	27
長期 (7-)	6,694	87.15	87.42	16.52	1.00	1.82	1.67	13.27	13.14	13.14	30
長期 (7-11)	2,738	98.88	99.18	8.59	1.08	1.21	1.21	8.19	8.14	8.19	30
超長期 (11-)	3,956	79.03	79.29	22.00	0.94	2.34	2.07	17.67	17.48	17.43	30
AAA~BBB 格	16,576	94.18	94.39	8.84	0.75	1.24	1.18	7.20	7.14	7.15	27
短期 (1-3)	4,088	99.51	99.64	1.90	0.48	0.79	0.79	1.89	1.89	1.89	24
中期 (3-7)	5,764	98.57	98.77	4.82	0.67	0.97	0.96	4.73	4.71	4.73	27
長期 (7-)	6,724	87.18	87.46	16.49	1.00	1.82	1.67	13.25	13.13	13.12	30
長期 (7-11)	2,758	98.87	99.18	8.59	1.08	1.21	1.21	8.19	8.14	8.18	30
超長期 (11-)	3,966	79.05	79.30	21.98	0.94	2.34	2.07	17.66	17.47	17.41	30
AAA~BB 格	16,816	94.26	94.48	8.79	0.78	1.25	1.19	7.16	7.10	7.11	29
短期 (1-3)	4,088	99.51	99.64	1.90	0.48	0.79	0.79	1.89	1.89	1.89	24
中期 (3-7)	5,979	98.66	98.87	4.80	0.72	1.00	1.00	4.71	4.69	4.71	31
長期 (7-)	6,749	87.20	87.48	16.49	1.00	1.82	1.67	13.25	13.12	13.12	30
長期 (7-11)	2,758	98.87	99.18	8.59	1.08	1.21	1.21	8.19	8.14	8.18	30
超長期 (11-)	3,991	79.13	79.39	21.94	0.95	2.35	2.08	17.62	17.43	17.38	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	84.36	84.64	17.46	0.98	1.88	1.68	13.33	13.19	13.18	31
短期 (1-3)	40	102.15	102.94	2.07	1.75	0.80	0.81	2.02	2.02	2.02	24
中期 (3-7)	115	95.97	96.03	5.33	0.22	1.00	0.98	5.28	5.26	5.28	28
長期 (7-)	696	81.42	81.70	20.35	1.06	2.13	1.88	15.71	15.54	15.52	32
長期 (7-11)	212	100.33	100.61	8.54	1.25	1.21	1.21	8.09	8.04	8.09	30
超長期 (11-)	484	73.14	73.42	25.52	0.98	2.69	2.29	20.28	20.03	19.98	33
A 格	15,510	94.67	94.88	8.42	0.74	1.21	1.16	6.94	6.88	6.89	27
短期 (1-3)	3,998	99.49	99.61	1.90	0.47	0.78	0.78	1.89	1.89	1.89	23
中期 (3-7)	5,514	98.64	98.84	4.83	0.68	0.96	0.96	4.74	4.72	4.74	27
長期 (7-)	5,998	87.81	88.09	16.07	0.99	1.79	1.65	13.01	12.89	12.88	29
長期 (7-11)	2,526	98.75	99.06	8.60	1.06	1.21	1.21	8.20	8.15	8.19	30
超長期 (11-)	3,472	79.85	80.10	21.51	0.94	2.30	2.04	17.34	17.15	17.10	29
BBB 格	215	97.69	97.88	4.35	0.58	1.11	1.10	4.18	4.15	4.18	41
短期 (1-3)	50	98.94	99.01	1.79	0.28	0.88	0.88	1.78	1.77	1.78	33
中期 (3-7)	135	97.97	98.17	4.03	0.59	1.09	1.08	3.97	3.94	3.96	42
長期 (7-)	30	94.37	94.66	10.05	1.08	1.64	1.59	9.34	9.27	9.34	56
長期 (7-11)	20	98.43	98.65	8.30	1.15	1.36	1.35	7.92	7.86	7.92	47
超長期 (11-)	10	86.24	86.68	13.54	0.95	2.28	2.13	12.59	12.46	12.57	75
BB 格	240	100.14	100.55	5.50	2.26	2.08	2.08	4.98	4.92	4.97	133
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	215	101.00	101.47	4.33	2.25	1.98	1.99	4.13	4.09	4.13	131
長期 (7-)	25	92.71	92.71	15.49	2.37	3.06	2.96	12.94	12.75	12.86	146
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	25	92.71	92.71	15.49	2.37	3.06	2.96	12.94	12.75	12.86	146
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	95.86	96.05	6.88	0.75	1.29	1.25	5.96	5.91	5.93	43
短期 (1-3)	16,992	99.09	99.22	1.95	0.47	0.95	0.95	1.93	1.93	1.93	39
中期 (3-7)	20,913	98.03	98.22	4.62	0.68	1.11	1.10	4.54	4.51	4.54	42
長期 (7-)	16,444	89.75	90.02	14.84	1.11	1.92	1.80	12.51	12.39	12.42	48
長期 (7-11)	7,053	97.10	97.39	8.68	1.08	1.48	1.45	8.26	8.21	8.26	53
超長期 (11-)	9,390	84.22	84.49	19.47	1.13	2.30	2.11	16.18	16.00	16.02	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11月末、12月ポートフォリオ)

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
AAA~AA 格	851	84.36	84.64	17.46	0.98	1.88	1.68	13.33	13.19	13.18	31
短期 (1-3)	40	102.15	102.94	2.07	1.75	0.80	0.81	2.02	2.02	2.02	24
中期 (3-7)	135	97.35	97.53	5.59	0.46	1.01	1.00	5.50	5.47	5.50	28
長期 (7-)	676	80.71	80.98	20.74	1.03	2.17	1.92	16.06	15.88	15.87	32
長期 (7-11)	192	99.81	100.04	8.69	1.19	1.22	1.22	8.25	8.20	8.25	30
超長期 (11-)	484	73.14	73.42	25.52	0.98	2.69	2.29	20.28	20.03	19.98	33
AAA~A 格	16,246	94.08	94.30	9.10	0.78	1.26	1.20	7.43	7.37	7.38	27
短期 (1-3)	3,867	99.46	99.59	2.16	0.51	0.80	0.80	2.14	2.14	2.14	23
中期 (3-7)	5,607	98.61	98.80	4.99	0.69	0.97	0.97	4.89	4.87	4.89	27
長期 (7-)	6,772	87.27	87.54	16.47	1.00	1.82	1.67	13.25	13.12	13.11	30
長期 (7-11)	2,846	98.81	99.10	8.71	1.09	1.23	1.22	8.30	8.24	8.29	30
超長期 (11-)	3,926	78.91	79.16	22.09	0.94	2.35	2.08	17.74	17.54	17.49	30
AAA~BBB 格	16,461	94.13	94.34	9.04	0.77	1.25	1.20	7.39	7.33	7.34	27
短期 (1-3)	3,927	99.45	99.58	2.16	0.51	0.80	0.80	2.14	2.13	2.14	23
中期 (3-7)	5,732	98.59	98.79	4.97	0.69	0.98	0.97	4.87	4.85	4.87	28
長期 (7-)	6,802	87.30	87.58	16.44	1.00	1.82	1.67	13.23	13.10	13.10	30
長期 (7-11)	2,866	98.81	99.10	8.71	1.09	1.23	1.22	8.29	8.24	8.29	30
超長期 (11-)	3,936	78.92	79.18	22.07	0.94	2.35	2.08	17.72	17.53	17.48	30
AAA~BB 格	16,701	94.22	94.43	8.99	0.80	1.27	1.21	7.35	7.29	7.30	29
短期 (1-3)	3,927	99.45	99.58	2.16	0.51	0.80	0.80	2.14	2.13	2.14	23
中期 (3-7)	5,947	98.68	98.88	4.94	0.74	1.01	1.01	4.84	4.82	4.84	31
長期 (7-)	6,827	87.32	87.59	16.43	1.01	1.82	1.68	13.23	13.10	13.10	30
長期 (7-11)	2,866	98.81	99.10	8.71	1.09	1.23	1.22	8.29	8.24	8.29	30
超長期 (11-)	3,961	79.01	79.27	22.03	0.95	2.36	2.09	17.69	17.49	17.44	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	84.36	84.64	17.46	0.98	1.88	1.68	13.33	13.19	13.18	31
短期 (1-3)	40	102.15	102.94	2.07	1.75	0.80	0.81	2.02	2.02	2.02	24
中期 (3-7)	135	97.35	97.53	5.59	0.46	1.01	1.00	5.50	5.47	5.50	28
長期 (7-)	676	80.71	80.98	20.74	1.03	2.17	1.92	16.06	15.88	15.87	32
長期 (7-11)	192	99.81	100.04	8.69	1.19	1.22	1.22	8.25	8.20	8.25	30
超長期 (11-)	484	73.14	73.42	25.52	0.98	2.69	2.29	20.28	20.03	19.98	33
A 格	15,395	94.62	94.83	8.64	0.77	1.23	1.17	7.14	7.09	7.10	27
短期 (1-3)	3,827	99.43	99.56	2.16	0.50	0.80	0.80	2.15	2.14	2.15	23
中期 (3-7)	5,472	98.64	98.83	4.97	0.69	0.97	0.97	4.88	4.85	4.87	27
長期 (7-)	6,096	88.00	88.27	15.99	1.00	1.78	1.65	12.96	12.84	12.83	30
長期 (7-11)	2,654	98.74	99.03	8.71	1.08	1.23	1.22	8.30	8.25	8.29	30
超長期 (11-)	3,442	79.72	79.97	21.61	0.94	2.31	2.05	17.41	17.22	17.17	29
BBB 格	215	97.69	97.88	4.35	0.58	1.11	1.10	4.18	4.15	4.18	41
短期 (1-3)	60	98.80	98.89	2.00	0.29	0.90	0.90	1.99	1.98	1.99	33
中期 (3-7)	125	97.96	98.16	4.10	0.60	1.09	1.08	4.04	4.02	4.04	42
長期 (7-)	30	94.37	94.66	10.05	1.08	1.64	1.59	9.34	9.27	9.34	56
長期 (7-11)	20	98.43	98.65	8.30	1.15	1.36	1.35	7.92	7.86	7.92	47
超長期 (11-)	10	86.24	86.68	13.54	0.95	2.28	2.13	12.59	12.46	12.57	75
BB 格	240	100.14	100.55	5.50	2.26	2.08	2.08	4.98	4.92	4.97	133
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	215	101.00	101.47	4.33	2.25	1.98	1.99	4.13	4.09	4.13	131
長期 (7-)	25	92.71	92.71	15.49	2.37	3.06	2.96	12.94	12.75	12.86	146
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	25	92.71	92.71	15.49	2.37	3.06	2.96	12.94	12.75	12.86	146
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	53,893	95.82	96.01	7.01	0.76	1.30	1.26	6.08	6.03	6.05	43
短期 (1-3)	16,667	99.06	99.19	2.07	0.48	0.96	0.96	2.06	2.05	2.06	39
中期 (3-7)	21,001	97.90	98.08	4.75	0.69	1.13	1.12	4.66	4.63	4.66	43
長期 (7-)	16,225	89.80	90.07	15.01	1.13	1.91	1.80	12.64	12.51	12.55	46
長期 (7-11)	6,816	97.50	97.78	8.81	1.11	1.45	1.43	8.37	8.31	8.37	50
超長期 (11-)	9,409	84.21	84.48	19.50	1.14	2.30	2.11	16.21	16.04	16.05	44

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11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	1,546	99.07	99.31	3.16	0.85	1.16	1.16	3.09	3.08	3.09	54
短期(1-3)	870	99.29	99.51	2.17	0.74	1.08	1.08	2.15	2.13	2.15	51
中期(3-7)	616	98.83	99.10	4.04	0.95	1.24	1.23	3.95	3.93	3.95	56
長期(7-)	60	98.21	98.64	8.73	1.36	1.60	1.59	8.16	8.10	8.16	67
長期(7-11)	55	98.41	98.81	8.34	1.31	1.55	1.53	7.89	7.83	7.89	65
超長期(11-)	4	95.60	96.33	13.84	1.99	2.41	2.36	11.87	11.73	11.82	100
AAA~A格	3,377	98.87	99.16	3.51	1.06	1.42	1.41	3.36	3.33	3.36	77
短期(1-3)	1,893	99.30	99.56	2.15	0.97	1.29	1.29	2.13	2.11	2.13	72
中期(3-7)	1,205	98.35	98.65	3.98	1.00	1.43	1.42	3.89	3.86	3.89	76
長期(7-)	279	98.26	98.65	10.77	1.95	2.19	2.18	9.52	9.42	9.49	108
長期(7-11)	162	97.52	97.94	8.53	1.56	1.93	1.91	7.95	7.88	7.95	101
超長期(11-)	118	99.26	99.64	13.85	2.50	2.55	2.53	11.64	11.49	11.58	118
AAA~BBB格	3,847	98.84	99.11	3.69	1.08	1.43	1.42	3.51	3.48	3.51	77
短期(1-3)	2,071	99.32	99.57	2.13	0.96	1.29	1.28	2.10	2.09	2.10	72
中期(3-7)	1,416	98.44	98.71	4.10	1.03	1.44	1.43	4.00	3.97	4.00	76
長期(7-)	360	97.69	98.03	11.11	1.92	2.21	2.19	9.79	9.68	9.76	106
長期(7-11)	204	97.75	98.10	8.64	1.60	1.93	1.91	8.05	7.97	8.04	100
超長期(11-)	157	97.61	97.95	14.34	2.35	2.57	2.54	12.06	11.91	11.99	115
AAA~BB格	3,847	98.84	99.11	3.69	1.08	1.43	1.42	3.51	3.48	3.51	77
短期(1-3)	2,071	99.32	99.57	2.13	0.96	1.29	1.28	2.10	2.09	2.10	72
中期(3-7)	1,416	98.44	98.71	4.10	1.03	1.44	1.43	4.00	3.97	4.00	76
長期(7-)	360	97.69	98.03	11.11	1.92	2.21	2.19	9.79	9.68	9.76	106
長期(7-11)	204	97.75	98.10	8.64	1.60	1.93	1.91	8.05	7.97	8.04	100
超長期(11-)	157	97.61	97.95	14.34	2.35	2.57	2.54	12.06	11.91	11.99	115
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	99.07	99.31	3.16	0.85	1.16	1.16	3.09	3.08	3.09	54
短期(1-3)	870	99.29	99.51	2.17	0.74	1.08	1.08	2.15	2.13	2.15	51
中期(3-7)	616	98.83	99.10	4.04	0.95	1.24	1.23	3.95	3.93	3.95	56
長期(7-)	60	98.21	98.64	8.73	1.36	1.60	1.59	8.16	8.10	8.16	67
長期(7-11)	55	98.41	98.81	8.34	1.31	1.55	1.53	7.89	7.83	7.89	65
超長期(11-)	4	95.60	96.33	13.84	1.99	2.41	2.36	11.87	11.73	11.82	100
A格	1,831	98.71	99.04	3.81	1.24	1.63	1.62	3.59	3.55	3.58	96
短期(1-3)	1,022	99.31	99.61	2.14	1.16	1.47	1.47	2.11	2.09	2.11	90
中期(3-7)	589	97.84	98.19	3.92	1.05	1.64	1.62	3.82	3.79	3.82	97
長期(7-)	220	98.27	98.66	11.32	2.12	2.35	2.33	9.89	9.77	9.86	119
長期(7-11)	106	97.06	97.48	8.63	1.69	2.14	2.11	7.99	7.90	7.98	120
超長期(11-)	113	99.40	99.76	13.85	2.52	2.55	2.54	11.63	11.48	11.57	119
BBB格	471	98.61	98.72	4.96	1.22	1.51	1.49	4.59	4.55	4.58	77
短期(1-3)	178	99.52	99.65	1.87	0.91	1.21	1.21	1.85	1.84	1.85	66
中期(3-7)	211	98.94	99.02	4.77	1.25	1.47	1.47	4.62	4.59	4.62	78
長期(7-)	81	95.73	95.90	12.31	1.82	2.27	2.22	10.74	10.62	10.69	100
長期(7-11)	42	98.61	98.72	9.06	1.74	1.93	1.92	8.40	8.32	8.39	97
超長期(11-)	39	92.62	92.84	15.82	1.91	2.65	2.56	13.44	13.27	13.34	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 11 月末、12 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	1,670	99.06	99.29	3.31	0.87	1.18	1.18	3.24	3.22	3.24	55
短期 (1-3)	965	99.29	99.50	2.34	0.78	1.10	1.10	2.31	2.30	2.31	52
中期 (3-7)	632	98.80	99.04	4.16	0.96	1.26	1.25	4.07	4.04	4.07	58
長期 (7-)	73	98.20	98.58	8.94	1.40	1.64	1.62	8.35	8.28	8.34	68
長期 (7-11)	69	98.36	98.72	8.64	1.36	1.59	1.58	8.14	8.07	8.13	67
超長期 (11-)	4	95.60	96.33	13.84	1.99	2.41	2.36	11.87	11.73	11.82	100
AAA ~ A 格	3,446	98.86	99.13	3.61	1.06	1.42	1.41	3.46	3.43	3.46	76
短期 (1-3)	1,974	99.26	99.51	2.28	0.96	1.29	1.29	2.26	2.24	2.26	71
中期 (3-7)	1,189	98.28	98.57	4.10	1.00	1.44	1.43	4.01	3.98	4.01	76
長期 (7-)	284	98.43	98.82	10.84	1.98	2.19	2.17	9.58	9.47	9.55	107
長期 (7-11)	166	97.83	98.24	8.71	1.62	1.94	1.92	8.10	8.02	8.10	100
超長期 (11-)	118	99.26	99.64	13.85	2.50	2.55	2.53	11.64	11.49	11.58	118
AAA ~ BBB 格	3,950	98.83	99.08	3.78	1.09	1.44	1.43	3.59	3.57	3.59	77
短期 (1-3)	2,174	99.28	99.52	2.26	0.97	1.30	1.29	2.23	2.21	2.23	72
中期 (3-7)	1,411	98.39	98.64	4.21	1.05	1.46	1.45	4.11	4.08	4.11	78
長期 (7-)	365	97.83	98.17	11.17	1.95	2.21	2.18	9.83	9.72	9.80	106
長期 (7-11)	208	97.99	98.34	8.78	1.64	1.93	1.92	8.16	8.08	8.16	99
超長期 (11-)	157	97.61	97.95	14.34	2.35	2.57	2.54	12.06	11.91	11.99	115
AAA ~ BB 格	3,950	98.83	99.08	3.78	1.09	1.44	1.43	3.59	3.57	3.59	77
短期 (1-3)	2,174	99.28	99.52	2.26	0.97	1.30	1.29	2.23	2.21	2.23	72
中期 (3-7)	1,411	98.39	98.64	4.21	1.05	1.46	1.45	4.11	4.08	4.11	78
長期 (7-)	365	97.83	98.17	11.17	1.95	2.21	2.18	9.83	9.72	9.80	106
長期 (7-11)	208	97.99	98.34	8.78	1.64	1.93	1.92	8.16	8.08	8.16	99
超長期 (11-)	157	97.61	97.95	14.34	2.35	2.57	2.54	12.06	11.91	11.99	115
AAA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA 格	1,670	99.06	99.29	3.31	0.87	1.18	1.18	3.24	3.22	3.24	55
短期 (1-3)	965	99.29	99.50	2.34	0.78	1.10	1.10	2.31	2.30	2.31	52
中期 (3-7)	632	98.80	99.04	4.16	0.96	1.26	1.25	4.07	4.04	4.07	58
長期 (7-)	73	98.20	98.58	8.94	1.40	1.64	1.62	8.35	8.28	8.34	68
長期 (7-11)	69	98.36	98.72	8.64	1.36	1.59	1.58	8.14	8.07	8.13	67
超長期 (11-)	4	95.60	96.33	13.84	1.99	2.41	2.36	11.87	11.73	11.82	100
A 格	1,776	98.67	98.98	3.90	1.23	1.64	1.63	3.67	3.63	3.66	96
短期 (1-3)	1,009	99.23	99.52	2.23	1.13	1.48	1.47	2.20	2.19	2.20	90
中期 (3-7)	556	97.70	98.04	4.03	1.04	1.65	1.64	3.93	3.90	3.93	97
長期 (7-)	211	98.51	98.90	11.50	2.18	2.38	2.36	10.00	9.88	9.97	121
長期 (7-11)	98	97.47	97.90	8.77	1.80	2.18	2.16	8.08	7.99	8.07	123
超長期 (11-)	113	99.40	99.76	13.85	2.52	2.55	2.54	11.63	11.48	11.57	119
BBB 格	504	98.64	98.76	4.90	1.30	1.58	1.57	4.53	4.49	4.52	85
短期 (1-3)	200	99.50	99.64	1.97	1.04	1.34	1.34	1.95	1.94	1.95	78
中期 (3-7)	222	98.93	99.02	4.84	1.33	1.56	1.55	4.68	4.64	4.67	86
長期 (7-)	81	95.73	95.90	12.31	1.82	2.27	2.22	10.74	10.62	10.69	100
長期 (7-11)	42	98.61	98.72	9.06	1.74	1.93	1.92	8.40	8.32	8.39	97
超長期 (11-)	39	92.62	92.84	15.82	1.91	2.65	2.56	13.44	13.27	13.34	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 11 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	472	99.08	99.31	3.10	0.79	1.10	1.10	3.05	3.03	3.05	49
短期 (1-3)	309	99.36	99.59	2.31	0.77	1.07	1.06	2.29	2.28	2.29	49
中期 (3-7)	149	98.66	98.88	4.28	0.81	1.16	1.15	4.20	4.18	4.20	48
長期 (7-)	14	97.32	97.55	7.95	0.94	1.36	1.34	7.67	7.62	7.66	49
長期 (7-11)	14	97.32	97.55	7.95	0.94	1.36	1.34	7.67	7.62	7.66	49
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AAA ~ A 格	2,221	99.26	99.51	3.29	0.96	1.24	1.24	3.18	3.16	3.18	61
短期 (1-3)	1,325	99.41	99.65	2.10	0.88	1.16	1.16	2.08	2.07	2.08	60
中期 (3-7)	756	98.74	99.03	4.00	0.94	1.26	1.25	3.92	3.89	3.92	59
長期 (7-)	141	100.64	100.85	10.68	1.87	1.88	1.89	9.54	9.45	9.51	80
長期 (7-11)	82	97.66	97.96	8.41	1.23	1.58	1.57	7.97	7.91	7.97	67
超長期 (11-)	59	104.80	104.89	13.86	2.75	2.26	2.30	11.59	11.46	11.53	95
AAA ~ BBB 格	3,847	98.84	99.11	3.69	1.08	1.43	1.42	3.51	3.48	3.51	77
短期 (1-3)	2,071	99.32	99.57	2.13	0.96	1.29	1.28	2.10	2.09	2.10	72
中期 (3-7)	1,416	98.44	98.71	4.10	1.03	1.44	1.43	4.00	3.97	4.00	76
長期 (7-)	360	97.69	98.03	11.11	1.92	2.21	2.19	9.79	9.68	9.76	106
長期 (7-11)	204	97.75	98.10	8.64	1.60	1.93	1.91	8.05	7.97	8.04	100
超長期 (11-)	157	97.61	97.95	14.34	2.35	2.57	2.54	12.06	11.91	11.99	115
AAA ~ BB 格	3,847	98.84	99.11	3.69	1.08	1.43	1.42	3.51	3.48	3.51	77
短期 (1-3)	2,071	99.32	99.57	2.13	0.96	1.29	1.28	2.10	2.09	2.10	72
中期 (3-7)	1,416	98.44	98.71	4.10	1.03	1.44	1.43	4.00	3.97	4.00	76
長期 (7-)	360	97.69	98.03	11.11	1.92	2.21	2.19	9.79	9.68	9.76	106
長期 (7-11)	204	97.75	98.10	8.64	1.60	1.93	1.91	8.05	7.97	8.04	100
超長期 (11-)	157	97.61	97.95	14.34	2.35	2.57	2.54	12.06	11.91	11.99	115
AAA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA 格	472	99.08	99.31	3.10	0.79	1.10	1.10	3.05	3.03	3.05	49
短期 (1-3)	309	99.36	99.59	2.31	0.77	1.07	1.06	2.29	2.28	2.29	49
中期 (3-7)	149	98.66	98.88	4.28	0.81	1.16	1.15	4.20	4.18	4.20	48
長期 (7-)	14	97.32	97.55	7.95	0.94	1.36	1.34	7.67	7.62	7.66	49
長期 (7-11)	14	97.32	97.55	7.95	0.94	1.36	1.34	7.67	7.62	7.66	49
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
A 格	1,750	99.31	99.57	3.34	1.01	1.28	1.28	3.22	3.20	3.22	64
短期 (1-3)	1,016	99.43	99.66	2.04	0.91	1.19	1.19	2.02	2.00	2.02	63
中期 (3-7)	606	98.76	99.07	3.93	0.98	1.28	1.28	3.85	3.83	3.85	62
長期 (7-)	127	100.99	101.21	10.97	1.97	1.93	1.94	9.74	9.64	9.71	83
長期 (7-11)	68	97.73	98.05	8.50	1.29	1.63	1.61	8.03	7.97	8.03	71
超長期 (11-)	59	104.80	104.89	13.86	2.75	2.26	2.30	11.59	11.46	11.53	95
BBB 格	1,626	98.27	98.56	4.24	1.23	1.68	1.67	3.96	3.93	3.96	98
短期 (1-3)	746	99.15	99.44	2.17	1.11	1.50	1.50	2.14	2.12	2.14	93
中期 (3-7)	661	98.09	98.34	4.20	1.14	1.64	1.63	4.09	4.06	4.09	96
長期 (7-)	219	95.80	96.22	11.39	1.96	2.44	2.39	9.96	9.84	9.92	124
長期 (7-11)	122	97.81	98.19	8.79	1.84	2.16	2.14	8.10	8.01	8.09	122
超長期 (11-)	98	93.30	93.78	14.62	2.11	2.79	2.70	12.38	12.21	12.30	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 11 月末、12 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	467	99.07	99.30	3.12	0.79	1.10	1.10	3.07	3.05	3.07	48
短期 (1-3)	304	99.36	99.59	2.33	0.77	1.06	1.06	2.31	2.30	2.31	48
中期 (3-7)	149	98.66	98.88	4.28	0.81	1.16	1.15	4.20	4.18	4.20	48
長期 (7-)	14	97.32	97.55	7.95	0.94	1.36	1.34	7.67	7.62	7.66	49
長期 (7-11)	14	97.32	97.55	7.95	0.94	1.36	1.34	7.67	7.62	7.66	49
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AAA~A 格	2,280	99.23	99.47	3.42	0.97	1.25	1.25	3.31	3.29	3.31	61
短期 (1-3)	1,383	99.39	99.62	2.25	0.89	1.17	1.17	2.22	2.21	2.22	59
中期 (3-7)	751	98.61	98.88	4.16	0.94	1.28	1.27	4.07	4.04	4.07	60
長期 (7-)	145	100.89	101.11	10.82	1.92	1.88	1.89	9.65	9.56	9.62	79
長期 (7-11)	87	98.25	98.55	8.77	1.36	1.61	1.60	8.25	8.19	8.25	67
超長期 (11-)	59	104.80	104.89	13.86	2.75	2.26	2.30	11.59	11.46	11.53	95
AAA~BBB 格	3,950	98.83	99.08	3.78	1.09	1.44	1.43	3.59	3.57	3.59	77
短期 (1-3)	2,174	99.28	99.52	2.26	0.97	1.30	1.29	2.23	2.21	2.23	72
中期 (3-7)	1,411	98.39	98.64	4.21	1.05	1.46	1.45	4.11	4.08	4.11	78
長期 (7-)	365	97.83	98.17	11.17	1.95	2.21	2.18	9.83	9.72	9.80	106
長期 (7-11)	208	97.99	98.34	8.78	1.64	1.93	1.92	8.16	8.08	8.16	99
超長期 (11-)	157	97.61	97.95	14.34	2.35	2.57	2.54	12.06	11.91	11.99	115
AAA~BB 格	3,950	98.83	99.08	3.78	1.09	1.44	1.43	3.59	3.57	3.59	77
短期 (1-3)	2,174	99.28	99.52	2.26	0.97	1.30	1.29	2.23	2.21	2.23	72
中期 (3-7)	1,411	98.39	98.64	4.21	1.05	1.46	1.45	4.11	4.08	4.11	78
長期 (7-)	365	97.83	98.17	11.17	1.95	2.21	2.18	9.83	9.72	9.80	106
長期 (7-11)	208	97.99	98.34	8.78	1.64	1.93	1.92	8.16	8.08	8.16	99
超長期 (11-)	157	97.61	97.95	14.34	2.35	2.57	2.54	12.06	11.91	11.99	115
AAA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA 格	467	99.07	99.30	3.12	0.79	1.10	1.10	3.07	3.05	3.07	48
短期 (1-3)	304	99.36	99.59	2.33	0.77	1.06	1.06	2.31	2.30	2.31	48
中期 (3-7)	149	98.66	98.88	4.28	0.81	1.16	1.15	4.20	4.18	4.20	48
長期 (7-)	14	97.32	97.55	7.95	0.94	1.36	1.34	7.67	7.62	7.66	49
長期 (7-11)	14	97.32	97.55	7.95	0.94	1.36	1.34	7.67	7.62	7.66	49
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
A 格	1,813	99.27	99.51	3.50	1.02	1.29	1.29	3.37	3.35	3.37	64
短期 (1-3)	1,079	99.40	99.63	2.22	0.92	1.20	1.20	2.20	2.18	2.20	63
中期 (3-7)	602	98.60	98.88	4.13	0.97	1.31	1.30	4.03	4.01	4.03	63
長期 (7-)	132	101.27	101.48	11.12	2.03	1.93	1.95	9.85	9.75	9.82	82
長期 (7-11)	73	98.42	98.73	8.92	1.44	1.66	1.65	8.36	8.29	8.35	71
超長期 (11-)	59	104.80	104.89	13.86	2.75	2.26	2.30	11.59	11.46	11.53	95
BBB 格	1,670	98.28	98.55	4.26	1.24	1.69	1.68	3.99	3.95	3.98	99
短期 (1-3)	791	99.09	99.35	2.27	1.10	1.52	1.51	2.24	2.22	2.24	94
中期 (3-7)	659	98.12	98.38	4.28	1.18	1.67	1.65	4.16	4.13	4.16	98
長期 (7-)	219	95.80	96.22	11.39	1.96	2.44	2.39	9.96	9.84	9.92	124
長期 (7-11)	122	97.81	98.19	8.79	1.84	2.16	2.14	8.10	8.01	8.09	122
超長期 (11-)	98	93.30	93.78	14.62	2.11	2.79	2.70	12.38	12.21	12.30	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11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	99.96	100.50	1.60	1.37	1.41	1.41	1.58	1.56	1.58	87
短期 (1-3)	30	99.96	100.50	1.60	1.37	1.41	1.41	1.58	1.56	1.58	87
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AAA~A 格	740	98.66	99.05	2.92	0.98	1.41	1.40	2.85	2.83	2.85	80
短期 (1-3)	394	99.25	99.63	1.90	0.95	1.31	1.30	1.88	1.87	1.88	75
中期 (3-7)	317	98.26	98.65	3.74	1.02	1.52	1.51	3.66	3.63	3.66	85
長期 (7-)	29	94.99	95.39	7.93	0.96	1.70	1.66	7.61	7.55	7.61	81
長期 (7-11)	29	94.99	95.39	7.93	0.96	1.70	1.66	7.61	7.55	7.61	81
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AAA~BBB 格	751	98.49	98.88	3.06	0.99	1.43	1.42	2.96	2.94	2.96	81
短期 (1-3)	394	99.25	99.63	1.90	0.95	1.31	1.30	1.88	1.87	1.88	75
中期 (3-7)	317	98.26	98.65	3.74	1.02	1.52	1.51	3.66	3.63	3.66	85
長期 (7-)	41	92.84	93.31	9.08	1.06	1.97	1.89	8.51	8.43	8.50	94
長期 (7-11)	29	94.99	95.39	7.93	0.96	1.70	1.66	7.61	7.55	7.61	81
超長期 (11-)	11	87.37	87.99	12.03	1.32	2.71	2.55	11.00	10.87	10.99	131
AAA~BB 格	751	98.49	98.88	3.06	0.99	1.43	1.42	2.96	2.94	2.96	81
短期 (1-3)	394	99.25	99.63	1.90	0.95	1.31	1.30	1.88	1.87	1.88	75
中期 (3-7)	317	98.26	98.65	3.74	1.02	1.52	1.51	3.66	3.63	3.66	85
長期 (7-)	41	92.84	93.31	9.08	1.06	1.97	1.89	8.51	8.43	8.50	94
長期 (7-11)	29	94.99	95.39	7.93	0.96	1.70	1.66	7.61	7.55	7.61	81
超長期 (11-)	11	87.37	87.99	12.03	1.32	2.71	2.55	11.00	10.87	10.99	131
AAA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA 格	30	99.96	100.50	1.60	1.37	1.41	1.41	1.58	1.56	1.58	87
短期 (1-3)	30	99.96	100.50	1.60	1.37	1.41	1.41	1.58	1.56	1.58	87
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
A 格	710	98.60	98.98	2.98	0.97	1.41	1.40	2.91	2.89	2.91	80
短期 (1-3)	364	99.20	99.56	1.93	0.92	1.30	1.29	1.90	1.89	1.90	74
中期 (3-7)	317	98.26	98.65	3.74	1.02	1.52	1.51	3.66	3.63	3.66	85
長期 (7-)	29	94.99	95.39	7.93	0.96	1.70	1.66	7.61	7.55	7.61	81
長期 (7-11)	29	94.99	95.39	7.93	0.96	1.70	1.66	7.61	7.55	7.61	81
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
BBB 格	11	87.37	87.99	12.03	1.32	2.71	2.55	11.00	10.87	10.99	131
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	11	87.37	87.99	12.03	1.32	2.71	2.55	11.00	10.87	10.99	131
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	11	87.37	87.99	12.03	1.32	2.71	2.55	11.00	10.87	10.99	131
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	98.93	99.17	3.85	1.10	1.43	1.42	3.64	3.61	3.64	76
短期 (1-3)	1,677	99.34	99.56	2.18	0.96	1.28	1.28	2.15	2.14	2.15	71
中期 (3-7)	1,100	98.49	98.73	4.20	1.04	1.42	1.41	4.10	4.07	4.10	74
長期 (7-)	320	98.30	98.63	11.37	2.03	2.24	2.22	9.94	9.83	9.91	108
長期 (7-11)	175	98.21	98.55	8.76	1.70	1.97	1.95	8.12	8.04	8.11	103
超長期 (11-)	145	98.42	98.73	14.52	2.43	2.56	2.54	12.14	11.98	12.07	114

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11月末、12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	236	99.33	99.72	3.08	1.20	1.40	1.39	2.97	2.94	2.96	77
短期 (1-3)	166	99.66	100.02	2.18	1.15	1.31	1.31	2.15	2.14	2.15	73
中期 (3-7)	55	98.89	99.30	4.05	1.20	1.50	1.49	3.94	3.91	3.94	82
長期 (7-)	15	97.31	97.95	9.45	1.72	2.06	2.03	8.52	8.43	8.50	105
長期 (7-11)	11	97.97	98.59	7.74	1.62	1.92	1.90	7.25	7.18	7.24	108
超長期 (11-)	4	95.60	96.33	13.84	1.99	2.41	2.36	11.87	11.73	11.82	100
AAA~A 格	891	98.70	99.06	3.13	1.00	1.41	1.41	3.04	3.02	3.04	79
短期 (1-3)	505	99.23	99.56	2.17	0.93	1.30	1.30	2.15	2.13	2.15	72
中期 (3-7)	351	98.15	98.53	3.93	1.04	1.54	1.52	3.84	3.81	3.84	86
長期 (7-)	35	96.58	97.13	8.79	1.41	1.87	1.84	8.16	8.08	8.15	92
長期 (7-11)	31	96.71	97.24	8.11	1.33	1.80	1.77	7.66	7.59	7.66	91
超長期 (11-)	4	95.60	96.33	13.84	1.99	2.41	2.36	11.87	11.73	11.82	100
AAA~BBB 格	902	98.56	98.92	3.24	1.00	1.43	1.42	3.13	3.11	3.13	79
短期 (1-3)	505	99.23	99.56	2.17	0.93	1.30	1.30	2.15	2.13	2.15	72
中期 (3-7)	351	98.15	98.53	3.93	1.04	1.54	1.52	3.84	3.81	3.84	86
長期 (7-)	47	94.33	94.91	9.58	1.39	2.06	2.00	8.80	8.71	8.79	100
長期 (7-11)	31	96.71	97.24	8.11	1.33	1.80	1.77	7.66	7.59	7.66	91
超長期 (11-)	16	89.58	90.24	12.52	1.50	2.63	2.49	11.25	11.12	11.22	122
AAA~BB 格	902	98.56	98.92	3.24	1.00	1.43	1.42	3.13	3.11	3.13	79
短期 (1-3)	505	99.23	99.56	2.17	0.93	1.30	1.30	2.15	2.13	2.15	72
中期 (3-7)	351	98.15	98.53	3.93	1.04	1.54	1.52	3.84	3.81	3.84	86
長期 (7-)	47	94.33	94.91	9.58	1.39	2.06	2.00	8.80	8.71	8.79	100
長期 (7-11)	31	96.71	97.24	8.11	1.33	1.80	1.77	7.66	7.59	7.66	91
超長期 (11-)	16	89.58	90.24	12.52	1.50	2.63	2.49	11.25	11.12	11.22	122
AAA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA 格	236	99.33	99.72	3.08	1.20	1.40	1.39	2.97	2.94	2.96	77
短期 (1-3)	166	99.66	100.02	2.18	1.15	1.31	1.31	2.15	2.14	2.15	73
中期 (3-7)	55	98.89	99.30	4.05	1.20	1.50	1.49	3.94	3.91	3.94	82
長期 (7-)	15	97.31	97.95	9.45	1.72	2.06	2.03	8.52	8.43	8.50	105
長期 (7-11)	11	97.97	98.59	7.74	1.62	1.92	1.90	7.25	7.18	7.24	108
超長期 (11-)	4	95.60	96.33	13.84	1.99	2.41	2.36	11.87	11.73	11.82	100
A 格	655	98.47	98.82	3.14	0.92	1.42	1.41	3.07	3.05	3.07	79
短期 (1-3)	339	99.02	99.33	2.17	0.83	1.29	1.29	2.14	2.13	2.14	72
中期 (3-7)	296	98.01	98.39	3.90	1.01	1.54	1.53	3.82	3.79	3.82	87
長期 (7-)	20	96.04	96.53	8.31	1.18	1.73	1.69	7.89	7.82	7.88	82
長期 (7-11)	20	96.04	96.53	8.31	1.18	1.73	1.69	7.89	7.82	7.88	82
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
BBB 格	11	87.37	87.99	12.03	1.32	2.71	2.55	11.00	10.87	10.99	131
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	11	87.37	87.99	12.03	1.32	2.71	2.55	11.00	10.87	10.99	131
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	11	87.37	87.99	12.03	1.32	2.71	2.55	11.00	10.87	10.99	131
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	3,048	98.91	99.13	3.94	1.11	1.44	1.43	3.73	3.70	3.73	76
短期 (1-3)	1,669	99.30	99.51	2.28	0.97	1.30	1.29	2.25	2.24	2.25	72
中期 (3-7)	1,060	98.46	98.68	4.31	1.06	1.43	1.42	4.20	4.17	4.20	75
長期 (7-)	318	98.34	98.65	11.40	2.03	2.23	2.21	9.98	9.87	9.94	107
長期 (7-11)	177	98.22	98.53	8.90	1.70	1.96	1.94	8.25	8.17	8.24	100
超長期 (11-)	141	98.50	98.80	14.54	2.45	2.57	2.55	12.14	11.99	12.07	114

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11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	293	99.06	99.40	3.13	0.99	1.29	1.29	3.03	3.01	3.03	67
短期 (1-3)	200	99.46	99.76	2.20	0.92	1.19	1.19	2.18	2.17	2.18	62
中期 (3-7)	71	98.81	99.24	3.99	1.08	1.40	1.39	3.89	3.87	3.89	73
長期 (7-)	22	96.17	96.67	8.72	1.36	1.90	1.86	8.05	7.97	8.04	95
長期 (7-11)	18	96.31	96.75	7.52	1.21	1.78	1.75	7.16	7.10	7.16	94
超長期 (11-)	4	95.60	96.33	13.84	1.99	2.41	2.36	11.87	11.73	11.82	100
AAA~A 格	1,175	98.86	99.17	4.30	1.37	1.70	1.69	3.98	3.94	3.98	99
短期 (1-3)	696	99.45	99.72	2.26	1.24	1.49	1.49	2.22	2.21	2.22	92
中期 (3-7)	279	97.75	98.09	4.19	1.13	1.72	1.71	4.08	4.04	4.08	104
長期 (7-)	200	98.36	98.75	11.56	2.17	2.39	2.37	10.04	9.92	10.00	121
長期 (7-11)	82	97.06	97.48	8.28	1.70	2.15	2.12	7.70	7.61	7.69	124
超長期 (11-)	118	99.26	99.64	13.85	2.50	2.55	2.53	11.64	11.49	11.58	118
AAA~BBB 格	1,176	98.86	99.16	4.30	1.37	1.70	1.69	3.98	3.94	3.98	99
短期 (1-3)	696	99.45	99.72	2.26	1.24	1.49	1.49	2.22	2.21	2.22	92
中期 (3-7)	280	97.74	98.07	4.19	1.13	1.73	1.71	4.08	4.04	4.08	104
長期 (7-)	200	98.36	98.75	11.56	2.17	2.39	2.37	10.04	9.92	10.00	121
長期 (7-11)	82	97.06	97.48	8.28	1.70	2.15	2.12	7.70	7.61	7.69	124
超長期 (11-)	118	99.26	99.64	13.85	2.50	2.55	2.53	11.64	11.49	11.58	118
AAA~BB 格	1,176	98.86	99.16	4.30	1.37	1.70	1.69	3.98	3.94	3.98	99
短期 (1-3)	696	99.45	99.72	2.26	1.24	1.49	1.49	2.22	2.21	2.22	92
中期 (3-7)	280	97.74	98.07	4.19	1.13	1.73	1.71	4.08	4.04	4.08	104
長期 (7-)	200	98.36	98.75	11.56	2.17	2.39	2.37	10.04	9.92	10.00	121
長期 (7-11)	82	97.06	97.48	8.28	1.70	2.15	2.12	7.70	7.61	7.69	124
超長期 (11-)	118	99.26	99.64	13.85	2.50	2.55	2.53	11.64	11.49	11.58	118
AAA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA 格	293	99.06	99.40	3.13	0.99	1.29	1.29	3.03	3.01	3.03	67
短期 (1-3)	200	99.46	99.76	2.20	0.92	1.19	1.19	2.18	2.17	2.18	62
中期 (3-7)	71	98.81	99.24	3.99	1.08	1.40	1.39	3.89	3.87	3.89	73
長期 (7-)	22	96.17	96.67	8.72	1.36	1.90	1.86	8.05	7.97	8.04	95
長期 (7-11)	18	96.31	96.75	7.52	1.21	1.78	1.75	7.16	7.10	7.16	94
超長期 (11-)	4	95.60	96.33	13.84	1.99	2.41	2.36	11.87	11.73	11.82	100
A 格	881	98.80	99.09	4.68	1.50	1.83	1.82	4.30	4.26	4.29	110
短期 (1-3)	496	99.44	99.70	2.28	1.37	1.61	1.61	2.24	2.22	2.24	104
中期 (3-7)	208	97.39	97.70	4.25	1.15	1.83	1.81	4.14	4.10	4.14	114
長期 (7-)	178	98.63	99.01	11.91	2.27	2.45	2.43	10.28	10.16	10.24	124
長期 (7-11)	64	97.28	97.69	8.50	1.83	2.25	2.22	7.84	7.76	7.84	132
超長期 (11-)	113	99.40	99.76	13.85	2.52	2.55	2.54	11.63	11.48	11.57	119
BBB 格	1	93.17	93.37	4.81	1.05	2.65	2.57	4.69	4.63	4.69	187
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	1	93.17	93.37	4.81	1.05	2.65	2.57	4.69	4.63	4.69	187
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	98.84	99.09	3.43	0.95	1.31	1.30	3.30	3.28	3.30	67
短期 (1-3)	1,375	99.25	99.50	2.06	0.82	1.18	1.18	2.04	2.03	2.04	62
中期 (3-7)	1,136	98.61	98.87	4.07	1.01	1.37	1.36	3.98	3.95	3.98	69
長期 (7-)	160	96.86	97.14	10.56	1.62	1.99	1.96	9.48	9.38	9.45	89
長期 (7-11)	122	98.21	98.51	8.88	1.53	1.79	1.77	8.28	8.21	8.28	84
超長期 (11-)	39	92.62	92.84	15.82	1.91	2.65	2.56	13.44	13.27	13.34	104

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11月末、12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	325	99.11	99.42	3.18	1.02	1.30	1.29	3.08	3.06	3.08	67
短期 (1-3)	224	99.48	99.75	2.32	0.95	1.20	1.20	2.29	2.28	2.29	62
中期 (3-7)	79	98.87	99.27	4.07	1.11	1.41	1.41	3.97	3.95	3.97	74
長期 (7-)	22	96.17	96.67	8.72	1.36	1.90	1.86	8.05	7.97	8.04	95
長期 (7-11)	18	96.31	96.75	7.52	1.21	1.78	1.75	7.16	7.10	7.16	94
超長期 (11-)	4	95.60	96.33	13.84	1.99	2.41	2.36	11.87	11.73	11.82	100
AAA~A 格	1,206	98.88	99.18	4.28	1.37	1.69	1.68	3.97	3.93	3.97	99
短期 (1-3)	732	99.42	99.69	2.30	1.24	1.49	1.49	2.27	2.25	2.27	91
中期 (3-7)	274	97.81	98.13	4.26	1.15	1.71	1.69	4.14	4.11	4.14	102
長期 (7-)	200	98.36	98.75	11.56	2.17	2.39	2.37	10.04	9.92	10.00	121
長期 (7-11)	82	97.06	97.48	8.28	1.70	2.15	2.12	7.70	7.61	7.69	124
超長期 (11-)	118	99.26	99.64	13.85	2.50	2.55	2.53	11.64	11.49	11.58	118
AAA~BBB 格	1,240	98.88	99.18	4.27	1.40	1.72	1.71	3.97	3.93	3.96	101
短期 (1-3)	754	99.42	99.69	2.32	1.26	1.52	1.51	2.28	2.27	2.28	94
中期 (3-7)	286	97.82	98.15	4.33	1.22	1.77	1.76	4.20	4.17	4.20	108
長期 (7-)	200	98.36	98.75	11.56	2.17	2.39	2.37	10.04	9.92	10.00	121
長期 (7-11)	82	97.06	97.48	8.28	1.70	2.15	2.12	7.70	7.61	7.69	124
超長期 (11-)	118	99.26	99.64	13.85	2.50	2.55	2.53	11.64	11.49	11.58	118
AAA~BB 格	1,240	98.88	99.18	4.27	1.40	1.72	1.71	3.97	3.93	3.96	101
短期 (1-3)	754	99.42	99.69	2.32	1.26	1.52	1.51	2.28	2.27	2.28	94
中期 (3-7)	286	97.82	98.15	4.33	1.22	1.77	1.76	4.20	4.17	4.20	108
長期 (7-)	200	98.36	98.75	11.56	2.17	2.39	2.37	10.04	9.92	10.00	121
長期 (7-11)	82	97.06	97.48	8.28	1.70	2.15	2.12	7.70	7.61	7.69	124
超長期 (11-)	118	99.26	99.64	13.85	2.50	2.55	2.53	11.64	11.49	11.58	118
AAA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA 格	325	99.11	99.42	3.18	1.02	1.30	1.29	3.08	3.06	3.08	67
短期 (1-3)	224	99.48	99.75	2.32	0.95	1.20	1.20	2.29	2.28	2.29	62
中期 (3-7)	79	98.87	99.27	4.07	1.11	1.41	1.41	3.97	3.95	3.97	74
長期 (7-)	22	96.17	96.67	8.72	1.36	1.90	1.86	8.05	7.97	8.04	95
長期 (7-11)	18	96.31	96.75	7.52	1.21	1.78	1.75	7.16	7.10	7.16	94
超長期 (11-)	4	95.60	96.33	13.84	1.99	2.41	2.36	11.87	11.73	11.82	100
A 格	881	98.80	99.09	4.68	1.50	1.83	1.82	4.30	4.26	4.29	110
短期 (1-3)	508	99.40	99.66	2.30	1.36	1.62	1.62	2.26	2.24	2.26	104
中期 (3-7)	196	97.38	97.68	4.33	1.16	1.83	1.81	4.21	4.17	4.21	114
長期 (7-)	178	98.63	99.01	11.91	2.27	2.45	2.43	10.28	10.16	10.24	124
長期 (7-11)	64	97.28	97.69	8.50	1.83	2.25	2.22	7.84	7.76	7.84	132
超長期 (11-)	113	99.40	99.76	13.85	2.52	2.55	2.54	11.63	11.48	11.57	119
BBB 格	34	98.90	99.22	4.00	2.35	2.65	2.64	3.77	3.71	3.76	199
短期 (1-3)	22	99.31	99.59	2.86	2.10	2.36	2.35	2.78	2.75	2.78	175
中期 (3-7)	12	98.16	98.54	6.09	2.81	3.20	3.17	5.59	5.50	5.59	244
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	2,710	98.80	99.04	3.55	0.94	1.31	1.30	3.42	3.40	3.42	66
短期 (1-3)	1,420	99.21	99.43	2.22	0.81	1.18	1.18	2.20	2.19	2.20	60
中期 (3-7)	1,125	98.53	98.77	4.18	1.01	1.38	1.37	4.09	4.06	4.09	70
長期 (7-)	165	97.19	97.47	10.69	1.68	1.99	1.96	9.58	9.48	9.55	88
長期 (7-11)	126	98.60	98.89	9.11	1.61	1.80	1.79	8.46	8.39	8.45	83
超長期 (11-)	39	92.62	92.84	15.82	1.91	2.65	2.56	13.44	13.27	13.34	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11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	1,326	99.04	99.27	3.16	0.81	1.14	1.14	3.09	3.08	3.09	52
短期 (1-3)	717	99.23	99.43	2.13	0.69	1.06	1.06	2.11	2.10	2.11	50
中期 (3-7)	564	98.83	99.08	4.04	0.93	1.22	1.21	3.96	3.93	3.96	54
長期 (7-)	45	98.52	98.87	8.48	1.24	1.45	1.44	8.05	7.99	8.04	55
長期 (7-11)	45	98.52	98.87	8.48	1.24	1.45	1.44	8.05	7.99	8.04	55
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AAA~A 格	2,277	99.23	99.48	3.34	0.96	1.24	1.24	3.23	3.21	3.23	61
短期 (1-3)	1,326	99.42	99.64	2.11	0.86	1.14	1.14	2.09	2.07	2.09	57
中期 (3-7)	795	98.68	98.98	3.97	0.94	1.28	1.27	3.89	3.87	3.89	61
長期 (7-)	157	100.41	100.66	10.60	1.89	1.92	1.93	9.48	9.39	9.45	85
長期 (7-11)	98	97.78	98.12	8.66	1.37	1.71	1.69	8.13	8.06	8.12	78
超長期 (11-)	59	104.80	104.89	13.86	2.75	2.26	2.30	11.59	11.46	11.53	95
AAA~BBB 格	3,701	98.85	99.11	3.75	1.06	1.40	1.40	3.56	3.53	3.56	74
短期 (1-3)	1,955	99.33	99.56	2.15	0.92	1.24	1.24	2.12	2.11	2.12	67
中期 (3-7)	1,386	98.47	98.74	4.10	1.03	1.43	1.42	4.00	3.98	4.00	75
長期 (7-)	360	97.69	98.03	11.11	1.92	2.21	2.19	9.79	9.68	9.76	106
長期 (7-11)	204	97.75	98.10	8.64	1.60	1.93	1.91	8.05	7.97	8.04	100
超長期 (11-)	157	97.61	97.95	14.34	2.35	2.57	2.54	12.06	11.91	11.99	115
AAA~BB 格	3,701	98.85	99.11	3.75	1.06	1.40	1.40	3.56	3.53	3.56	74
短期 (1-3)	1,955	99.33	99.56	2.15	0.92	1.24	1.24	2.12	2.11	2.12	67
中期 (3-7)	1,386	98.47	98.74	4.10	1.03	1.43	1.42	4.00	3.98	4.00	75
長期 (7-)	360	97.69	98.03	11.11	1.92	2.21	2.19	9.79	9.68	9.76	106
長期 (7-11)	204	97.75	98.10	8.64	1.60	1.93	1.91	8.05	7.97	8.04	100
超長期 (11-)	157	97.61	97.95	14.34	2.35	2.57	2.54	12.06	11.91	11.99	115
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	99.04	99.27	3.16	0.81	1.14	1.14	3.09	3.08	3.09	52
短期 (1-3)	717	99.23	99.43	2.13	0.69	1.06	1.06	2.11	2.10	2.11	50
中期 (3-7)	564	98.83	99.08	4.04	0.93	1.22	1.21	3.96	3.93	3.96	54
長期 (7-)	45	98.52	98.87	8.48	1.24	1.45	1.44	8.05	7.99	8.04	55
長期 (7-11)	45	98.52	98.87	8.48	1.24	1.45	1.44	8.05	7.99	8.04	55
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
A 格	951	99.50	99.78	3.60	1.17	1.38	1.38	3.41	3.39	3.41	73
短期 (1-3)	608	99.64	99.88	2.08	1.06	1.23	1.23	2.06	2.05	2.06	67
中期 (3-7)	231	98.32	98.73	3.81	0.97	1.44	1.43	3.73	3.70	3.73	77
長期 (7-)	112	101.16	101.37	11.45	2.15	2.10	2.12	10.04	9.93	10.00	96
長期 (7-11)	53	97.16	97.50	8.80	1.49	1.92	1.90	8.19	8.12	8.19	97
超長期 (11-)	59	104.80	104.89	13.86	2.75	2.26	2.30	11.59	11.46	11.53	95
BBB 格	1,424	98.24	98.51	4.40	1.22	1.66	1.65	4.10	4.07	4.10	95
短期 (1-3)	629	99.15	99.40	2.23	1.05	1.45	1.45	2.20	2.18	2.20	88
中期 (3-7)	592	98.18	98.43	4.27	1.15	1.63	1.61	4.16	4.12	4.16	94
長期 (7-)	204	95.60	96.01	11.51	1.95	2.44	2.39	10.04	9.92	10.00	124
長期 (7-11)	106	97.72	98.08	8.62	1.80	2.14	2.12	7.97	7.89	7.97	121
超長期 (11-)	98	93.30	93.78	14.62	2.11	2.79	2.70	12.38	12.21	12.30	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	98.66	99.21	2.22	1.57	2.02	2.01	2.16	2.14	2.16	145
短期 (1-3)	116	99.10	99.75	1.79	1.68	2.04	2.03	1.75	1.74	1.75	150
中期 (3-7)	30	96.98	97.12	3.87	1.12	1.96	1.93	3.79	3.75	3.79	127
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 Moody's 格付別・ポートフォリオ指標 (2024年11月末、12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	1,414	99.02	99.23	3.33	0.83	1.16	1.15	3.26	3.24	3.26	52
短期 (1-3)	784	99.23	99.42	2.31	0.72	1.07	1.07	2.29	2.28	2.29	49
中期 (3-7)	573	98.79	99.01	4.16	0.94	1.23	1.23	4.07	4.05	4.07	56
長期 (7-)	58	98.43	98.74	8.80	1.31	1.53	1.52	8.30	8.24	8.30	59
長期 (7-11)	58	98.43	98.74	8.80	1.31	1.53	1.52	8.30	8.24	8.30	59
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AAA~A 格	2,335	99.20	99.44	3.47	0.97	1.25	1.25	3.35	3.33	3.35	61
短期 (1-3)	1,392	99.39	99.61	2.26	0.87	1.15	1.15	2.23	2.22	2.23	57
中期 (3-7)	783	98.57	98.84	4.13	0.94	1.30	1.29	4.04	4.02	4.04	62
長期 (7-)	161	100.65	100.90	10.74	1.94	1.93	1.94	9.58	9.49	9.56	84
長期 (7-11)	103	98.27	98.61	8.95	1.48	1.72	1.71	8.36	8.28	8.35	77
超長期 (11-)	59	104.80	104.89	13.86	2.75	2.26	2.30	11.59	11.46	11.53	95
AAA~BBB 格	3,796	98.84	99.09	3.82	1.06	1.41	1.40	3.63	3.60	3.63	74
短期 (1-3)	2,061	99.31	99.53	2.26	0.93	1.25	1.25	2.23	2.22	2.23	67
中期 (3-7)	1,370	98.41	98.67	4.21	1.04	1.43	1.42	4.11	4.08	4.11	75
長期 (7-)	365	97.83	98.17	11.17	1.95	2.21	2.18	9.83	9.72	9.80	106
長期 (7-11)	208	97.99	98.34	8.78	1.64	1.93	1.92	8.16	8.08	8.16	99
超長期 (11-)	157	97.61	97.95	14.34	2.35	2.57	2.54	12.06	11.91	11.99	115
AAA~BB 格	3,796	98.84	99.09	3.82	1.06	1.41	1.40	3.63	3.60	3.63	74
短期 (1-3)	2,061	99.31	99.53	2.26	0.93	1.25	1.25	2.23	2.22	2.23	67
中期 (3-7)	1,370	98.41	98.67	4.21	1.04	1.43	1.42	4.11	4.08	4.11	75
長期 (7-)	365	97.83	98.17	11.17	1.95	2.21	2.18	9.83	9.72	9.80	106
長期 (7-11)	208	97.99	98.34	8.78	1.64	1.93	1.92	8.16	8.08	8.16	99
超長期 (11-)	157	97.61	97.95	14.34	2.35	2.57	2.54	12.06	11.91	11.99	115
AAA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA 格	1,414	99.02	99.23	3.33	0.83	1.16	1.15	3.26	3.24	3.26	52
短期 (1-3)	784	99.23	99.42	2.31	0.72	1.07	1.07	2.29	2.28	2.29	49
中期 (3-7)	573	98.79	99.01	4.16	0.94	1.23	1.23	4.07	4.05	4.07	56
長期 (7-)	58	98.43	98.74	8.80	1.31	1.53	1.52	8.30	8.24	8.30	59
長期 (7-11)	58	98.43	98.74	8.80	1.31	1.53	1.52	8.30	8.24	8.30	59
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
A 格	921	99.48	99.76	3.69	1.17	1.40	1.40	3.49	3.46	3.49	73
短期 (1-3)	608	99.60	99.84	2.18	1.06	1.24	1.24	2.15	2.14	2.15	67
中期 (3-7)	210	97.97	98.37	4.05	0.95	1.47	1.45	3.96	3.93	3.95	79
長期 (7-)	103	101.89	102.10	11.82	2.29	2.14	2.16	10.27	10.16	10.24	97
長期 (7-11)	45	98.07	98.43	9.14	1.69	1.98	1.96	8.43	8.34	8.42	100
超長期 (11-)	59	104.80	104.89	13.86	2.75	2.26	2.30	11.59	11.46	11.53	95
BBB 格	1,460	98.27	98.54	4.38	1.22	1.66	1.64	4.08	4.05	4.08	95
短期 (1-3)	670	99.14	99.38	2.27	1.05	1.45	1.45	2.24	2.22	2.24	88
中期 (3-7)	587	98.21	98.45	4.31	1.16	1.62	1.61	4.19	4.16	4.19	93
長期 (7-)	204	95.60	96.01	11.51	1.95	2.44	2.39	10.04	9.92	10.00	124
長期 (7-11)	106	97.72	98.08	8.62	1.80	2.14	2.12	7.97	7.89	7.97	121
超長期 (11-)	98	93.30	93.78	14.62	2.11	2.79	2.70	12.38	12.21	12.30	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	154	98.43	98.85	2.79	1.63	2.22	2.21	2.70	2.67	2.70	161
短期 (1-3)	113	98.80	99.29	2.17	1.63	2.19	2.18	2.12	2.10	2.12	161
中期 (3-7)	41	97.41	97.63	4.50	1.61	2.30	2.28	4.30	4.25	4.30	160
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11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	491	99.11	99.33	3.17	0.78	1.07	1.07	3.12	3.10	3.12	45
短期 (1-3)	323	99.39	99.61	2.43	0.76	1.02	1.02	2.40	2.39	2.40	44
中期 (3-7)	154	98.67	98.90	4.29	0.81	1.16	1.15	4.22	4.19	4.22	47
長期 (7-)	14	97.32	97.55	7.95	0.94	1.36	1.34	7.67	7.62	7.66	49
長期 (7-11)	14	97.32	97.55	7.95	0.94	1.36	1.34	7.67	7.62	7.66	49
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AAA~A 格	2,218	99.25	99.49	3.31	0.95	1.23	1.23	3.20	3.18	3.20	60
短期 (1-3)	1,293	99.42	99.63	2.12	0.86	1.14	1.14	2.10	2.09	2.10	57
中期 (3-7)	787	98.70	98.99	3.96	0.94	1.28	1.27	3.88	3.85	3.88	61
長期 (7-)	139	100.76	100.98	10.73	1.89	1.88	1.89	9.58	9.48	9.55	80
長期 (7-11)	80	97.79	98.10	8.44	1.25	1.58	1.57	7.99	7.93	7.99	67
超長期 (11-)	59	104.80	104.89	13.86	2.75	2.26	2.30	11.59	11.46	11.53	95
AAA~BBB 格	3,784	98.84	99.11	3.72	1.07	1.42	1.41	3.53	3.51	3.53	75
短期 (1-3)	2,015	99.32	99.56	2.14	0.94	1.26	1.26	2.11	2.10	2.11	70
中期 (3-7)	1,410	98.45	98.72	4.09	1.04	1.44	1.43	4.00	3.97	4.00	76
長期 (7-)	358	97.72	98.06	11.14	1.93	2.21	2.19	9.81	9.70	9.77	107
長期 (7-11)	201	97.80	98.15	8.65	1.61	1.93	1.92	8.06	7.98	8.05	100
超長期 (11-)	157	97.61	97.95	14.34	2.35	2.57	2.54	12.06	11.91	11.99	115
AAA~BB 格	3,784	98.84	99.11	3.72	1.07	1.42	1.41	3.53	3.51	3.53	75
短期 (1-3)	2,015	99.32	99.56	2.14	0.94	1.26	1.26	2.11	2.10	2.11	70
中期 (3-7)	1,410	98.45	98.72	4.09	1.04	1.44	1.43	4.00	3.97	4.00	76
長期 (7-)	358	97.72	98.06	11.14	1.93	2.21	2.19	9.81	9.70	9.77	107
長期 (7-11)	201	97.80	98.15	8.65	1.61	1.93	1.92	8.06	7.98	8.05	100
超長期 (11-)	157	97.61	97.95	14.34	2.35	2.57	2.54	12.06	11.91	11.99	115
AAA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA 格	491	99.11	99.33	3.17	0.78	1.07	1.07	3.12	3.10	3.12	45
短期 (1-3)	323	99.39	99.61	2.43	0.76	1.02	1.02	2.40	2.39	2.40	44
中期 (3-7)	154	98.67	98.90	4.29	0.81	1.16	1.15	4.22	4.19	4.22	47
長期 (7-)	14	97.32	97.55	7.95	0.94	1.36	1.34	7.67	7.62	7.66	49
長期 (7-11)	14	97.32	97.55	7.95	0.94	1.36	1.34	7.67	7.62	7.66	49
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
A 格	1,727	99.28	99.53	3.35	1.00	1.28	1.28	3.22	3.20	3.22	64
短期 (1-3)	970	99.43	99.64	2.01	0.89	1.18	1.17	2.00	1.98	2.00	61
中期 (3-7)	632	98.70	99.01	3.88	0.97	1.31	1.30	3.80	3.77	3.80	64
長期 (7-)	125	101.14	101.35	11.04	1.99	1.94	1.95	9.78	9.68	9.75	83
長期 (7-11)	66	97.89	98.22	8.54	1.32	1.63	1.61	8.06	8.00	8.06	71
超長期 (11-)	59	104.80	104.89	13.86	2.75	2.26	2.30	11.59	11.46	11.53	95
BBB 格	1,566	98.27	98.57	4.30	1.24	1.68	1.67	4.01	3.97	4.00	98
短期 (1-3)	723	99.15	99.43	2.17	1.10	1.49	1.49	2.14	2.13	2.14	92
中期 (3-7)	624	98.13	98.38	4.26	1.16	1.64	1.63	4.15	4.12	4.15	96
長期 (7-)	219	95.80	96.22	11.39	1.96	2.44	2.39	9.96	9.84	9.92	124
長期 (7-11)	122	97.81	98.19	8.79	1.84	2.16	2.14	8.10	8.01	8.09	122
超長期 (11-)	98	93.30	93.78	14.62	2.11	2.79	2.70	12.38	12.21	12.30	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	98.78	99.36	2.17	1.48	1.98	1.98	2.11	2.09	2.11	142
短期 (1-3)	56	99.28	99.94	1.72	1.62	2.05	2.05	1.69	1.67	1.69	151
中期 (3-7)	6	96.30	96.31	4.47	0.58	1.46	1.44	4.42	4.39	4.42	75
長期 (7-)	2	92.85	93.02	7.18	0.51	1.62	1.57	7.04	6.99	7.04	79
長期 (7-11)	2	92.85	93.02	7.18	0.51	1.62	1.57	7.04	6.99	7.04	79
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11月末、12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	99.11	99.33	3.17	0.78	1.07	1.07	3.12	3.10	3.12	45
短期 (1-3)	323	99.39	99.61	2.43	0.76	1.02	1.02	2.40	2.39	2.40	44
中期 (3-7)	154	98.67	98.90	4.29	0.81	1.16	1.15	4.22	4.19	4.22	47
長期 (7-)	14	97.32	97.55	7.95	0.94	1.36	1.34	7.67	7.62	7.66	49
長期 (7-11)	14	97.32	97.55	7.95	0.94	1.36	1.34	7.67	7.62	7.66	49
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AAA~A 格	2,281	99.22	99.45	3.44	0.96	1.24	1.24	3.32	3.30	3.32	60
短期 (1-3)	1,367	99.38	99.59	2.27	0.87	1.15	1.15	2.24	2.23	2.24	57
中期 (3-7)	770	98.59	98.85	4.12	0.94	1.29	1.28	4.04	4.01	4.04	61
長期 (7-)	143	101.02	101.23	10.88	1.94	1.89	1.90	9.69	9.59	9.66	79
長期 (7-11)	85	98.39	98.69	8.81	1.39	1.61	1.60	8.28	8.22	8.28	67
超長期 (11-)	59	104.80	104.89	13.86	2.75	2.26	2.30	11.59	11.46	11.53	95
AAA~BBB 格	3,890	98.83	99.08	3.80	1.08	1.43	1.42	3.62	3.59	3.61	76
短期 (1-3)	2,123	99.28	99.51	2.27	0.95	1.28	1.27	2.24	2.23	2.24	70
中期 (3-7)	1,405	98.39	98.65	4.21	1.05	1.46	1.45	4.11	4.08	4.11	78
長期 (7-)	363	97.86	98.20	11.19	1.96	2.21	2.19	9.85	9.74	9.82	106
長期 (7-11)	206	98.05	98.39	8.80	1.65	1.94	1.92	8.17	8.10	8.17	99
超長期 (11-)	157	97.61	97.95	14.34	2.35	2.57	2.54	12.06	11.91	11.99	115
AAA~BB 格	3,890	98.83	99.08	3.80	1.08	1.43	1.42	3.62	3.59	3.61	76
短期 (1-3)	2,123	99.28	99.51	2.27	0.95	1.28	1.27	2.24	2.23	2.24	70
中期 (3-7)	1,405	98.39	98.65	4.21	1.05	1.46	1.45	4.11	4.08	4.11	78
長期 (7-)	363	97.86	98.20	11.19	1.96	2.21	2.19	9.85	9.74	9.82	106
長期 (7-11)	206	98.05	98.39	8.80	1.65	1.94	1.92	8.17	8.10	8.17	99
超長期 (11-)	157	97.61	97.95	14.34	2.35	2.57	2.54	12.06	11.91	11.99	115
AAA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA 格	491	99.11	99.33	3.17	0.78	1.07	1.07	3.12	3.10	3.12	45
短期 (1-3)	323	99.39	99.61	2.43	0.76	1.02	1.02	2.40	2.39	2.40	44
中期 (3-7)	154	98.67	98.90	4.29	0.81	1.16	1.15	4.22	4.19	4.22	47
長期 (7-)	14	97.32	97.55	7.95	0.94	1.36	1.34	7.67	7.62	7.66	49
長期 (7-11)	14	97.32	97.55	7.95	0.94	1.36	1.34	7.67	7.62	7.66	49
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
A 格	1,790	99.25	99.48	3.51	1.01	1.29	1.29	3.38	3.35	3.38	64
短期 (1-3)	1,044	99.38	99.59	2.22	0.91	1.19	1.19	2.19	2.18	2.19	62
中期 (3-7)	616	98.57	98.84	4.08	0.97	1.32	1.31	3.99	3.97	3.99	64
長期 (7-)	130	101.41	101.62	11.19	2.05	1.94	1.96	9.89	9.79	9.86	82
長期 (7-11)	71	98.60	98.91	8.98	1.47	1.66	1.65	8.40	8.33	8.39	70
超長期 (11-)	59	104.80	104.89	13.86	2.75	2.26	2.30	11.59	11.46	11.53	95
BBB 格	1,610	98.28	98.56	4.32	1.25	1.69	1.68	4.04	4.00	4.03	99
短期 (1-3)	756	99.11	99.36	2.27	1.09	1.51	1.50	2.24	2.22	2.24	93
中期 (3-7)	635	98.16	98.41	4.32	1.20	1.67	1.66	4.20	4.16	4.20	98
長期 (7-)	219	95.80	96.22	11.39	1.96	2.44	2.39	9.96	9.84	9.92	124
長期 (7-11)	122	97.81	98.19	8.79	1.84	2.16	2.14	8.10	8.01	8.09	122
超長期 (11-)	98	93.30	93.78	14.62	2.11	2.79	2.70	12.38	12.21	12.30	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	59	98.73	99.31	2.26	1.52	2.02	2.01	2.19	2.17	2.19	144
短期 (1-3)	51	99.26	99.94	1.78	1.68	2.10	2.10	1.75	1.73	1.75	155
中期 (3-7)	6	96.30	96.31	4.47	0.58	1.46	1.44	4.42	4.39	4.42	75
長期 (7-)	2	92.85	93.02	7.18	0.51	1.62	1.57	7.04	6.99	7.04	79
長期 (7-11)	2	92.85	93.02	7.18	0.51	1.62	1.57	7.04	6.99	7.04	79
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11月末
銘柄数	14,003	14,825	15,436	15,639	16,113	16,319
額面(10億円)	972,326	1,018,210	1,056,757	1,085,263	1,124,834	1,156,141
時価単価(円)	108.39	106.48	104.19	101.51	98.40	95.54
利含単価(円)	108.52	106.59	104.30	101.61	98.50	95.78
残存年数(年)	9.84	9.89	10.01	10.16	10.21	10.15
利率(%)	0.89	0.83	0.79	0.77	0.78	0.82
単利(%)	0.08	0.14	0.27	0.43	0.73	1.11
複利(%)	0.08	0.14	0.27	0.43	0.72	1.07
Dur(年)	9.47	9.36	9.31	9.18	8.93	8.61
M-Dur	9.46	9.34	9.29	9.15	8.88	8.55
E-Dur	9.45	9.33	9.29	9.15	8.89	8.57
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 10 月の月末営業日から 2024 年 11 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 11 月の月末営業日までの投資収益率（年率換算、%）」を指す。
- 「前年未からの投資収益率」は、「2023 年 12 月の月末営業日から 2024 年 11 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 10 月の月末営業日から 2024 年 11 月の月末営業日までの投資収益率（年率換算、%）。
- 2024 年 10 月の月末営業日において、11 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 11 月ポートフォリオの、右ページには 12 月ポートフォリオの、2024 年 11 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 11 月末（暦上）における残存年数（至最終償還日）で区分。ただし 12 月ポートフォリオでは、2024 年 12 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