

月間投資収益率 (2023年10月末)

累積投資 収益指数	前月末からの投資収益率			過去からの期間投資収益率	
	トータル	キャピタル	インカム	前年度末	前年末
総合 359.310	-18.18	-18.96	0.78	-7.02	-2.38

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(%)

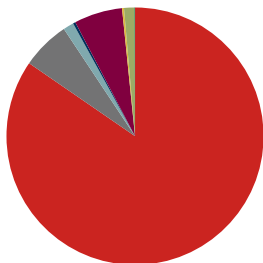
ポートフォリオ指標 (2023年10月末)

	翌月ポート (2023年11月)	当月ポート (2023年10月)	差
額面 [兆円]	1122.23	1111.51	10.71
デュレーション [年]	8.82	8.79	0.04
修正デュレーション	8.77	8.73	0.04
時価単価 [円]	96.81	96.80	0.00
利含単価 [円]	96.98	96.97	0.00
残存年数 [年]	10.20	10.15	0.04
利率 [%]	0.77	0.77	0.00
単利 [%]	0.86	0.86	0.00
複利 [%]	0.84	0.83	0.00
Tスプレッド [bp]	5	5	0

出所: NFRC

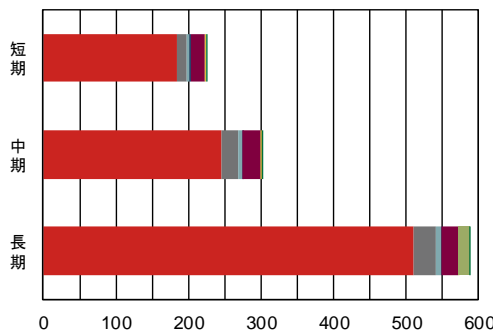
(注) デュレーション・修正デュレーションは経過利子込時価総額加重平均、単利・複利・Tスプレッドは時価総額加重平均、それ以外は額面加重平均。

銘柄別額面構成 (2023年10月末)



出所: NFRC

残存別額面構成 (2023年10月末)



出所: NFRC

(兆円)

	国債	地方債	政保債	金融債	事業債	円建外債	MBS	ABS
構成比	84.6%	6.1%	1.3%	0.3%	6.1%	0.2%	1.3%	0.1%
全体	940.24	67.53	14.80	3.44	67.54	2.76	14.49	0.73
短期	184.23	13.11	4.07	1.89	19.38	1.16	-	0.21
中期	245.16	23.80	4.42	1.32	24.68	1.36	-	0.28
長期	510.84	30.62	6.32	0.22	23.47	0.24	14.49	0.24

出所: NFRC

(兆円)

目次

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

銘柄別・投資収益率(2023年10月末)

	累積投資 収益指数	前月末からの投資収益率			過去からの投資収益率	
		トータル	キャピタル	インカム	前年度末	前年末
総合	359.310	-18.18	-18.96	0.78	-7.02	-2.38
国債	369.972	-19.11	-19.91	0.80	-7.53	-2.56
地方債	384.497	-12.73	-13.32	0.58	-4.33	-1.42
政保債	360.606	-15.62	-16.30	0.68	-5.87	-2.19
金融債	272.197	-3.53	-3.71	0.19	-1.14	-0.33
事業債	383.050	-13.58	-14.27	0.69	-4.04	-1.19
円建外債	349.978	-3.98	-5.07	1.09	0.16	1.56
MBS	123.591	-13.69	-14.35	0.65	-4.11	-1.86
ABS	112.207	-8.27	-8.98	0.71	-2.99	-0.84

出所:NFRC

投資収益率は年率換算(%)

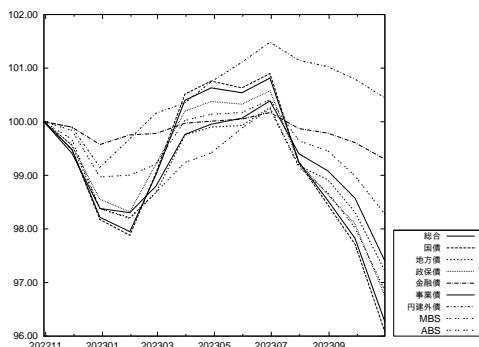
銘柄別・累積投資収益指数の推移

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
2022/10/31	373.249	385.073	395.507	372.720	274.111	393.270	348.433	127.615	114.178
2022/11/30	371.326	383.056	393.790	371.079	273.836	390.956	348.079	127.195	113.996
2022/12/30	366.595	378.048	389.098	367.323	272.941	386.908	345.470	125.543	113.002
2023/01/31	365.595	376.912	388.427	366.456	273.435	386.595	347.333	125.310	113.040
2023/02/28	369.572	381.409	390.292	369.789	273.512	388.552	348.992	125.933	113.274
2023/03/31	374.743	387.058	394.518	373.453	274.033	392.345	349.655	126.646	114.205
2023/04/28	375.608	387.993	395.109	374.132	274.139	393.086	351.030	126.871	114.337
2023/05/31	375.266	387.508	395.233	373.940	274.244	393.528	352.301	127.463	114.374
2023/06/30	376.290	388.532	396.555	374.873	274.584	394.798	353.603	127.918	114.648
2023/07/31	370.426	382.115	392.260	369.886	273.762	390.921	352.432	126.534	113.771
2023/08/31	367.761	379.098	391.224	367.657	273.527	389.661	352.004	125.918	113.558
2023/09/29	365.131	376.276	388.838	365.613	273.040	387.667	351.204	125.093	113.026
2023/10/02	364.546	375.631	388.471	365.116	272.985	387.281	351.034	124.962	112.962
2023/10/03	364.660	375.742	388.679	365.230	273.061	387.424	351.084	124.999	113.019
2023/10/04	363.314	374.292	387.540	364.088	272.874	386.389	350.613	124.634	112.777
2023/10/05	363.312	374.267	387.728	364.077	272.962	386.474	350.780	124.686	112.842
2023/10/06	363.313	374.260	387.827	364.099	272.956	386.462	351.022	124.725	112.869
2023/10/10	363.997	374.985	388.518	364.689	273.129	387.030	351.296	124.931	113.036
2023/10/11	364.364	375.393	388.738	364.979	273.157	387.225	351.589	124.993	113.080
2023/10/12	365.273	376.379	389.421	365.766	273.312	387.911	351.811	125.228	113.227
2023/10/13	364.933	376.005	389.216	365.497	273.302	387.658	351.663	125.180	113.189
2023/10/16	364.869	375.925	389.308	365.468	273.340	387.589	351.670	125.196	113.225
2023/10/17	363.874	374.835	388.618	364.606	273.208	386.896	351.497	124.985	113.088
2023/10/18	363.143	374.058	387.926	363.944	273.042	386.312	351.010	124.742	112.938
2023/10/19	362.163	373.001	387.091	363.115	272.868	385.582	350.701	124.479	112.762
2023/10/20	362.058	372.872	387.141	363.066	272.917	385.550	350.801	124.483	112.783
2023/10/23	361.016	371.731	386.448	362.188	272.836	384.793	350.601	124.234	112.660
2023/10/24	361.661	372.433	386.990	362.748	272.946	385.208	350.948	124.364	112.780
2023/10/25	361.790	372.592	386.938	362.828	272.930	385.239	350.861	124.341	112.763
2023/10/26	360.856	371.597	386.031	362.017	272.722	384.489	350.579	124.092	112.556
2023/10/27	361.085	371.848	386.234	362.223	272.760	384.624	350.553	124.119	112.608
2023/10/30	360.537	371.265	385.747	361.743	272.599	384.118	350.402	123.973	112.499
2023/10/31	359.310	369.972	384.497	360.606	272.197	383.050	349.978	123.591	112.207

出所:NFRC

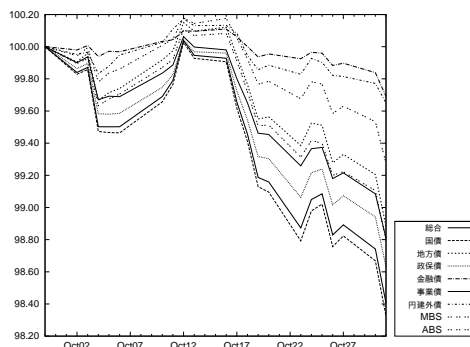
1983年12月末=100。MBSセクターは2003年3月末=100。ABSセクターは2008年3月末=100。

指数の推移(月次) 2022年10月末=100に補正。



出所:NFRC

指数の推移(日次) 2023年9月末=100に補正。



出所:NFRC

総合 残存別・投資収益率(2023年10月末)

	累積投資 収益指数	前月末からの投資収益率			過去からの投資収益率	
		トータル	キャピタル	インカム	前年度末	前年末
総合	359.310	-18.18	-18.96	0.78	-7.02	-2.38
短期 (1-3)	233.813	-1.67	-2.06	0.38	-0.58	-0.08
中期 (3-7)	334.547	-5.96	-6.54	0.58	-2.30	-0.49
長期 (7-)	525.066	-31.36	-32.40	1.04	-11.93	-4.30
長期 (7-11)	189.609	-15.13	-16.03	0.90	-6.21	-2.52
超長期 (11-)	233.049	-40.74	-41.86	1.12	-15.13	-5.33
(11-15)	219.298	-25.72	-26.83	1.10	-9.48	-3.60
(15-)	240.100	-46.31	-47.43	1.12	-17.15	-5.94

出所:NFRC

投資収益率は年率換算(%)

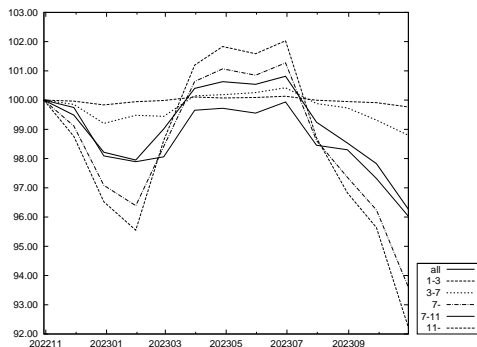
総合 残存別・投資収益指数の推移

総合 年/月/日	全体	短期 (1-3)	中期 (3-7)	長期 (7-)	長期*			
					(7-11)	超長期*	(11-15)*	(15-)*
2022/10/31	373.249	234.360	338.620	560.988	197.452	252.705	232.812	262.376
2022/11/30	371.326	234.277	338.118	556.003	196.951	249.563	231.108	258.589
2022/12/30	366.595	233.976	335.919	544.633	193.685	243.917	226.090	252.647
2023/01/31	365.595	234.236	336.863	540.734	193.291	241.459	223.712	250.144
2023/02/28	369.572	234.327	336.740	552.098	193.624	249.225	227.535	259.614
2023/03/31	374.743	234.609	339.117	564.562	196.768	255.728	232.205	266.940
2023/04/28	375.608	234.530	339.250	566.986	196.899	257.340	233.228	268.813
2023/05/31	375.266	234.572	339.493	565.767	196.576	256.715	232.893	268.060
2023/06/30	376.290	234.673	340.048	568.125	197.327	257.834	233.855	269.251
2023/07/31	370.426	234.353	338.216	553.224	194.403	249.447	228.461	259.576
2023/08/31	367.761	234.242	337.716	546.155	194.094	244.681	226.958	253.445
2023/09/29	365.131	234.156	336.305	539.912	192.157	241.681	224.358	250.261
2023/10/02	364.546	234.134	336.161	538.379	191.979	240.729	223.937	249.083
2023/10/03	364.660	234.160	336.320	538.547	192.205	240.683	224.151	248.929
2023/10/04	363.314	234.119	335.898	535.091	191.395	238.831	222.881	246.826
2023/10/05	363.312	234.136	336.136	534.862	191.599	238.521	222.898	246.379
2023/10/06	363.313	234.132	336.123	534.880	191.709	238.454	223.085	246.207
2023/10/10	363.997	234.186	336.510	536.458	192.209	239.204	223.843	246.958
2023/10/11	364.364	234.187	336.588	537.441	192.326	239.813	224.143	247.699
2023/10/12	365.273	234.244	336.915	539.710	192.700	241.144	224.880	249.283
2023/10/13	364.933	234.255	336.832	538.798	192.584	240.584	224.613	248.598
2023/10/16	364.869	234.256	336.948	538.513	192.698	240.301	224.704	248.158
2023/10/17	363.874	234.195	336.729	535.907	192.304	238.746	223.776	246.336
2023/10/18	363.143	234.143	336.343	534.195	191.850	237.867	223.064	245.383
2023/10/19	362.163	234.081	335.971	531.763	191.284	236.561	222.228	243.874
2023/10/20	362.058	234.105	336.058	531.365	191.341	236.239	222.263	243.402
2023/10/23	361.016	234.078	335.858	528.576	190.978	234.532	221.327	241.367
2023/10/24	361.661	234.108	336.123	530.168	191.334	235.398	221.913	242.353
2023/10/25	361.790	234.110	336.120	530.540	191.178	235.774	221.795	242.936
2023/10/26	360.856	234.043	335.597	528.376	190.534	234.714	220.793	241.846
2023/10/27	361.085	234.041	335.739	528.912	190.689	234.980	220.913	242.174
2023/10/30	360.537	233.960	335.389	527.720	190.417	234.336	220.436	241.456
2023/10/31	359.310	233.813	334.547	525.066	189.609	233.049	219.298	240.100

出所:NFRC

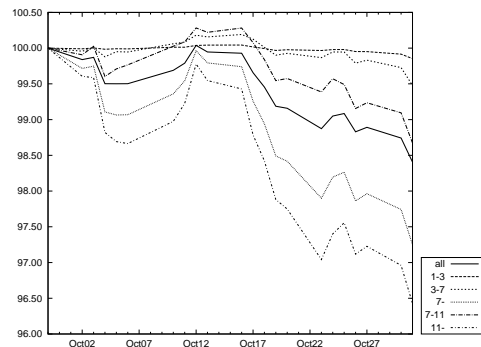
* は 1995年12月末=100。それ以外は、1983年12月末=100。

指数の推移(月次) 2022年10月末=100に補正。



出所:NFRC

指数の推移(日次) 2023年9月末=100に補正。



出所:NFRC

国債 残存別・投資収益率(2023年10月末)

	累積投資 収益指数	前月末からの投資収益率			過去からの投資収益率	
		トータル	キャピタル	インカム	前年度末	前年末
国債	369.972	-19.11	-19.91	0.80	-7.53	-2.56
短期(1-3)	221.219	-1.69	-2.08	0.38	-0.64	-0.13
中期(3-7)	333.693	-5.95	-6.54	0.59	-2.41	-0.56
長期(7-)	535.772	-32.30	-33.37	1.06	-12.48	-4.46
長期(7-11)	188.324	-15.11	-16.03	0.92	-6.44	-2.61
超長期(11-)	232.150	-42.15	-43.30	1.15	-15.82	-5.53
(11-15)	218.060	-25.53	-26.65	1.12	-9.56	-3.59
(15-)	239.413	-48.40	-49.55	1.15	-18.08	-6.21

出所:NFRC

投資収益率は年率換算(%)

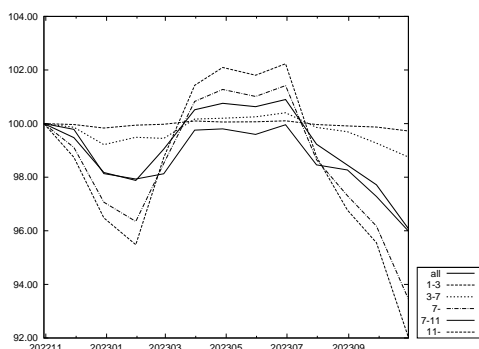
国債 残存別・投資収益指数の推移

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-)*
2022/10/31	385.073	221.832	337.907	573.331	196.192	252.275	231.389	262.467
2022/11/30	383.056	221.755	337.448	568.232	195.771	249.099	229.786	258.562
2022/12/30	378.048	221.465	335.254	556.512	192.531	243.401	224.804	252.526
2023/01/31	376.912	221.701	336.181	552.400	192.135	240.876	222.443	249.919
2023/02/28	381.409	221.778	336.044	564.797	192.519	249.082	226.298	260.054
2023/03/31	387.058	222.051	338.477	578.073	195.711	255.876	231.011	267.806
2023/04/28	387.993	221.963	338.580	580.635	195.804	257.564	232.036	269.795
2023/05/31	387.508	221.983	338.758	579.142	195.401	256.830	231.673	268.894
2023/06/30	388.532	222.065	339.276	581.457	196.110	257.907	232.618	270.034
2023/07/31	382.115	221.754	337.431	565.612	193.170	249.154	227.207	259.815
2023/08/31	379.098	221.638	336.877	557.899	192.799	244.125	225.661	253.299
2023/09/29	376.276	221.548	335.443	551.388	190.852	241.059	223.053	250.022
2023/10/02	375.631	221.527	335.299	549.751	190.672	240.063	222.633	248.778
2023/10/03	375.742	221.551	335.457	549.903	190.899	240.004	222.846	248.603
2023/10/04	374.292	221.513	335.042	546.286	190.095	238.098	221.588	246.414
2023/10/05	374.267	221.528	335.279	546.006	190.298	237.759	221.602	245.924
2023/10/06	374.260	221.523	335.261	546.004	190.406	237.679	221.790	245.731
2023/10/10	374.985	221.573	335.646	547.637	190.905	238.441	222.544	246.501
2023/10/11	375.393	221.573	335.725	548.697	191.025	239.084	222.847	247.290
2023/10/12	376.379	221.626	336.049	551.097	191.396	240.465	223.580	248.952
2023/10/13	376.005	221.636	335.966	550.123	191.283	239.878	223.318	248.224
2023/10/16	375.925	221.637	336.081	549.807	191.396	239.578	223.409	247.759
2023/10/17	374.835	221.579	335.861	547.039	191.001	237.960	222.484	245.840
2023/10/18	374.058	221.530	335.478	545.262	190.550	237.065	221.777	244.860
2023/10/19	373.001	221.472	335.109	542.708	189.988	235.716	220.946	243.285
2023/10/20	372.872	221.494	335.195	542.261	190.045	235.367	220.979	242.773
2023/10/23	371.731	221.468	334.994	539.308	189.682	233.599	220.061	240.637
2023/10/24	372.433	221.496	335.259	540.998	190.040	234.502	220.653	241.676
2023/10/25	372.592	221.497	335.257	541.436	189.885	234.915	220.535	242.315
2023/10/26	371.597	221.435	334.735	539.183	189.242	233.832	219.536	241.190
2023/10/27	371.848	221.432	334.878	539.758	189.397	234.115	219.660	241.542
2023/10/30	371.265	221.356	334.528	538.516	189.126	233.456	219.189	240.801
2023/10/31	369.972	221.219	333.693	535.772	188.324	232.150	218.060	239.413

出所:NFRC

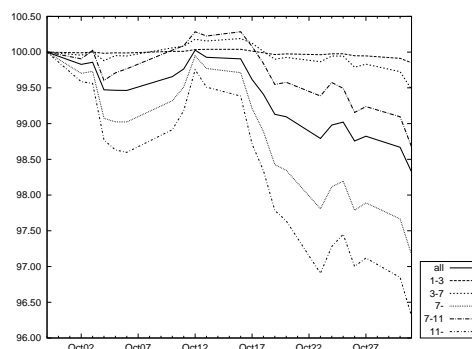
* は1995年12月末=100。それ以外は、1983年12月末=100。

指数の推移(月次) 2022年10月末=100に補正。



出所:NFRC

指数の推移(日次) 2023年9月末=100に補正。



出所:NFRC

このページは空白です。

「除くMBS」残存別・投資収益率(2023年10月末)

	累積投資 収益指数	前月末からの投資収益率			過去からの投資収益率	
		トータル	キャピタル	インカム	前年度末	前年末
除くMBS	359.183	-18.24	-19.02	0.78	-7.06	-2.38
短期(1-3)	233.813	-1.67	-2.06	0.38	-0.58	-0.08
中期(3-7)	334.547	-5.96	-6.54	0.58	-2.30	-0.49
長期(7-)	526.856	-31.82	-32.86	1.05	-12.13	-4.36
長期(7-11)	189.601	-15.14	-16.04	0.90	-6.21	-2.52
超長期(11-)	234.777	-41.83	-42.96	1.13	-15.55	-5.47
(11-15)	219.285	-25.72	-26.83	1.10	-9.48	-3.60
(15-)	242.183	-48.13	-49.28	1.14	-17.84	-6.16

出所:NFRC

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

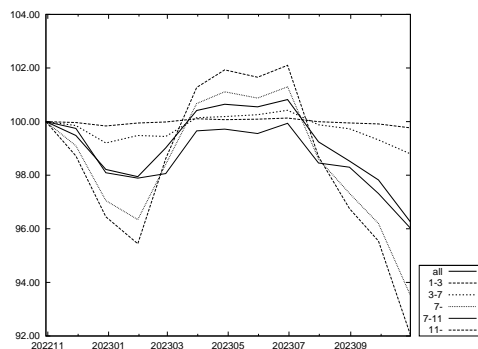
「除くMBS」残存別・投資収益指数の推移

除くMBS 年/月/日	全体	短期 (1-3)	中期 (3-7)	長期 (7-)	長期*			
					長期* (7-11)	超長期* (11-)	(11-15)*	(15-)*
2022/10/31	373.146	234.360	338.620	563.394	197.451	255.079	232.813	265.485
2022/11/30	371.214	234.277	338.118	558.306	196.950	251.813	231.105	261.486
2022/12/30	366.486	233.976	335.919	546.778	193.682	246.015	226.077	255.330
2023/01/31	365.481	234.236	336.863	542.786	193.287	243.452	223.693	252.683
2023/02/28	369.487	234.327	336.740	554.423	193.620	251.559	227.521	262.729
2023/03/31	374.698	234.609	339.117	567.185	196.766	258.332	232.196	270.476
2023/04/28	375.565	234.530	339.250	569.656	196.898	260.006	233.220	272.451
2023/05/31	375.196	234.572	339.493	568.335	196.574	259.302	232.885	271.578
2023/06/30	376.216	234.673	340.048	570.712	197.326	260.440	233.847	272.796
2023/07/31	370.329	234.353	338.216	555.520	194.399	251.747	228.449	262.626
2023/08/31	367.653	234.242	337.716	548.310	194.090	246.796	226.946	256.156
2023/09/29	365.021	234.156	336.305	541.973	192.152	243.713	224.345	252.853
2023/10/02	364.434	234.134	336.161	540.410	191.973	242.725	223.924	251.611
2023/10/03	364.548	234.160	336.320	540.578	192.200	242.673	224.138	251.442
2023/10/04	363.199	234.119	335.898	537.061	191.388	240.759	222.868	249.240
2023/10/05	363.194	234.136	336.136	536.819	191.593	240.430	222.885	248.757
2023/10/06	363.194	234.132	336.123	536.834	191.702	240.357	223.072	248.569
2023/10/10	363.879	234.186	336.510	538.435	192.204	241.127	223.830	249.346
2023/10/11	364.248	234.187	336.588	539.440	192.320	241.762	224.130	250.130
2023/10/12	365.160	234.244	336.915	541.750	192.694	243.140	224.867	251.794
2023/10/13	364.818	234.255	336.832	540.816	192.579	242.556	224.600	251.068
2023/10/16	364.752	234.256	336.948	540.521	192.692	242.257	224.691	250.597
2023/10/17	363.752	234.195	336.729	537.862	192.298	240.643	223.763	248.677
2023/10/18	363.022	234.143	336.343	536.126	191.843	239.740	223.052	247.687
2023/10/19	362.039	234.081	335.971	533.652	191.277	238.391	222.216	246.108
2023/10/20	361.932	234.105	336.058	533.242	191.334	238.052	222.250	245.604
2023/10/23	360.886	234.078	335.858	530.398	190.972	236.282	221.314	243.461
2023/10/24	361.535	234.108	336.123	532.023	191.328	237.180	221.900	244.499
2023/10/25	361.667	234.110	336.120	532.408	191.171	237.576	221.782	245.123
2023/10/26	360.730	234.043	335.597	530.207	190.527	236.484	220.780	243.988
2023/10/27	360.961	234.041	335.739	530.756	190.681	236.761	220.900	244.335
2023/10/30	360.412	233.960	335.389	529.545	190.410	236.096	220.423	243.586
2023/10/31	359.183	233.813	334.547	526.856	189.601	234.777	219.285	242.183

出所:NFRC

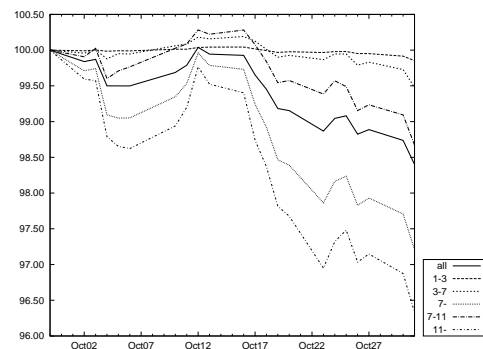
* は 1995年12月末=100。それ以外は、1983年12月末=100。

指数の推移(月次) 2022年10月末=100に補正。



出所:NFRC

指数の推移(日次) 2023年9月末=100に補正。



出所:NFRC

「除くABS」「SDGs」残存別・投資収益率(2023年10月末)

	累積投資 収益指数	前月末からの投資収益率			過去からの投資収益率	
		トータル	キャピタル	インカム	前年度末	前年末
除くABS	359.336	-18.19	-18.97	0.78	-7.03	-2.38
短期(1-3)	233.779	-1.67	-2.06	0.38	-0.58	-0.08
中期(3-7)	334.540	-5.96	-6.54	0.58	-2.30	-0.49
長期(7-)	525.066	-31.37	-32.40	1.04	-11.93	-4.30
長期(7-11)	189.603	-15.13	-16.03	0.90	-6.21	-2.52
超長期(11-)	233.047	-40.74	-41.86	1.12	-15.13	-5.33
(11-15)	219.290	-25.73	-26.83	1.10	-9.48	-3.60
(15-)	240.102	-46.31	-47.43	1.12	-17.15	-5.94
SDGs	97.885	-13.14	-13.57	0.43	-4.27	-1.13

出所:NFRC

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

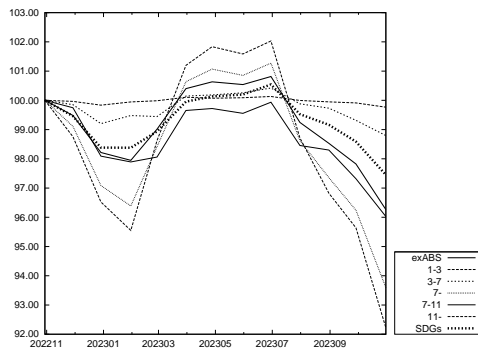
「除くABS」「SDGs」残存別投資収益指数の推移

除くABS 年/月/日	除くABS	短期 (1-3)	中期 (3-7)	長期 (7-)	長期*				超長期* (11-)	SDGs**
					(7-11)*	(11-15)*	(15-)*	(11-15)*		
2022/10/31	373.282	234.327	338.614	560.992	197.447	252.704	232.804	262.378	100.443	
2022/11/30	371.357	234.243	338.112	556.006	196.945	249.562	231.100	258.591	99.901	
2022/12/30	366.625	233.943	335.913	544.636	193.680	243.916	226.082	252.649	98.819	
2023/01/31	365.624	234.202	336.857	540.736	193.285	241.458	223.704	250.146	98.816	
2023/02/28	369.604	234.293	336.734	552.104	193.618	249.225	227.527	259.617	99.377	
2023/03/31	374.776	234.575	339.111	564.569	196.762	255.728	232.197	266.942	100.398	
2023/04/28	375.642	234.496	339.244	566.993	196.894	257.340	233.220	268.816	100.580	
2023/05/31	375.300	234.538	339.486	565.774	196.571	256.715	232.885	268.063	100.643	
2023/06/30	376.323	234.639	340.042	568.132	197.322	257.833	233.847	269.253	100.988	
2023/07/31	370.457	234.319	338.210	553.229	194.397	249.447	228.453	259.578	99.968	
2023/08/31	367.790	234.208	337.710	546.157	194.088	244.680	226.950	253.447	99.602	
2023/09/29	365.159	234.122	336.298	539.914	192.152	241.680	224.350	250.264	99.026	
2023/10/02	364.574	234.100	336.155	538.382	191.973	240.728	223.929	249.086	98.926	
2023/10/03	364.689	234.126	336.313	538.549	192.200	240.681	224.143	248.931	98.968	
2023/10/04	363.342	234.085	335.891	535.093	191.389	238.829	222.873	246.828	98.701	
2023/10/05	363.339	234.102	336.130	534.864	191.593	238.519	222.890	246.381	98.729	
2023/10/06	363.340	234.097	336.116	534.882	191.703	238.453	223.077	246.209	98.734	
2023/10/10	364.025	234.152	336.504	536.459	192.204	239.202	223.835	246.960	98.888	
2023/10/11	364.392	234.153	336.581	537.442	192.320	239.812	224.135	247.701	98.944	
2023/10/12	365.301	234.210	336.908	539.712	192.694	241.143	224.872	249.286	99.122	
2023/10/13	364.961	234.221	336.825	538.799	192.579	240.583	224.605	248.600	99.070	
2023/10/16	364.897	234.222	336.941	538.514	192.692	240.299	224.696	248.160	99.075	
2023/10/17	363.902	234.161	336.722	535.908	192.298	238.745	223.768	246.338	98.898	
2023/10/18	363.171	234.108	336.336	534.196	191.844	237.866	223.057	245.385	98.735	
2023/10/19	362.190	234.047	335.964	531.764	191.278	236.559	222.221	243.876	98.536	
2023/10/20	362.085	234.070	336.051	531.366	191.335	236.237	222.255	243.404	98.532	
2023/10/23	361.042	234.044	335.851	528.576	190.973	234.531	221.319	241.369	98.340	
2023/10/24	361.688	234.074	336.117	530.168	191.329	235.396	221.905	242.355	98.464	
2023/10/25	361.817	234.076	336.113	530.540	191.172	235.773	221.787	242.938	98.467	
2023/10/26	360.883	234.009	335.591	528.376	190.528	234.712	220.785	241.848	98.266	
2023/10/27	361.112	234.007	335.733	528.913	190.683	234.979	220.905	242.176	98.301	
2023/10/30	360.564	233.926	335.382	527.720	190.411	234.334	220.428	241.458	98.179	
2023/10/31	359.336	233.779	334.540	525.066	189.603	233.047	219.290	240.102	97.885	

出所:NFRC

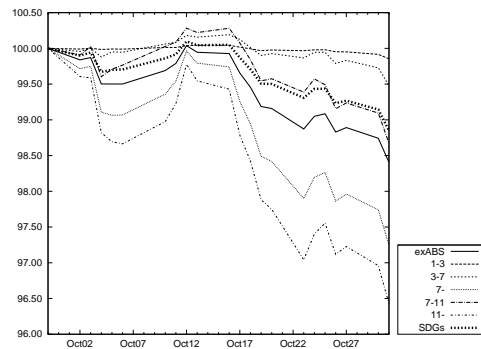
*は1995年12月末=100。**は2017年12月末=100。それ以外は、1983年12月末=100。

指数の推移(月次) 2022年10月末=100に補正。



出所:NFRC

指数の推移(日次) 2023年9月末=100に補正。



出所:NFRC

「除く国債」残存別・投資収益率(2023年10月末)

	累積投資 収益指数	前月末からの投資収益率			過去からの投資収益率	
		トータル	キャピタル	インカム	前年度末	前年末
除く国債	168.303	-13.05	-13.69	0.64	-4.19	-1.36
短期(1-3)	133.086	-1.56	-1.95	0.39	-0.30	0.14
中期(3-7)	165.085	-6.00	-6.56	0.56	-1.80	-0.18
長期(7-)	227.764	-24.91	-25.75	0.84	-8.11	-3.13
長期(7-11)	193.978	-15.26	-16.02	0.76	-4.70	-1.87
超長期(11-)	231.899	-30.81	-31.71	0.90	-10.16	-3.86

出所:NFRC

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

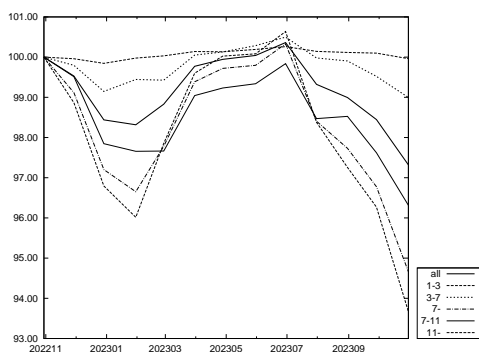
「除く国債」残存別・投資収益指数の推移

除く国債 年/月/日	全体	短期 (1-3)	中期 (3-7)	長期 (7-)	長期*	超長期*
					(7-11)	(11-)
2022/10/31	172.940	133.136	166.758	240.609	201.401	247.575
2022/11/30	172.127	133.084	166.418	238.485	200.421	244.766
2022/12/30	170.241	132.930	165.335	233.877	197.064	239.638
2023/01/31	170.030	133.103	165.831	232.552	196.681	237.710
2023/02/28	170.916	133.179	165.803	235.267	196.695	242.260
2023/03/31	172.545	133.323	166.841	239.133	199.475	246.587
2023/04/28	172.842	133.313	166.973	239.936	199.853	247.637
2023/05/31	173.012	133.391	167.234	240.119	200.067	247.779
2023/06/30	173.566	133.485	167.588	241.400	201.075	249.147
2023/07/31	171.766	133.327	166.723	236.776	198.319	243.560
2023/08/31	171.201	133.293	166.598	235.153	198.434	240.783
2023/09/29	170.251	133.269	165.958	232.849	196.608	238.336
2023/10/02	170.083	133.260	165.890	232.397	196.441	237.715
2023/10/03	170.155	133.275	165.969	232.524	196.658	237.763
2023/10/04	169.683	133.249	165.747	231.288	195.820	236.345
2023/10/05	169.739	133.262	165.867	231.322	196.032	236.244
2023/10/06	169.761	133.260	165.870	231.392	196.145	236.275
2023/10/10	170.032	133.297	166.065	232.006	196.649	236.915
2023/10/11	170.125	133.299	166.099	232.266	196.742	237.275
2023/10/12	170.425	133.335	166.265	233.007	197.125	238.213
2023/10/13	170.328	133.341	166.225	232.735	196.998	237.859
2023/10/16	170.334	133.344	166.284	232.686	197.110	237.694
2023/10/17	170.032	133.309	166.178	231.872	196.733	236.632
2023/10/18	169.750	133.275	165.983	231.217	196.267	235.896
2023/10/19	169.410	133.239	165.797	230.371	195.691	234.928
2023/10/20	169.413	133.255	165.841	230.318	195.743	234.802
2023/10/23	169.095	133.243	165.745	229.420	195.395	233.579
2023/10/24	169.303	133.262	165.877	229.920	195.726	234.158
2023/10/25	169.299	133.263	165.871	229.913	195.566	234.266
2023/10/26	168.945	133.223	165.615	229.102	194.930	233.398
2023/10/27	169.015	133.223	165.682	229.254	195.079	233.539
2023/10/30	168.804	133.177	165.510	228.811	194.806	233.011
2023/10/31	168.303	133.086	165.085	227.764	193.978	231.899

出所:NFRC

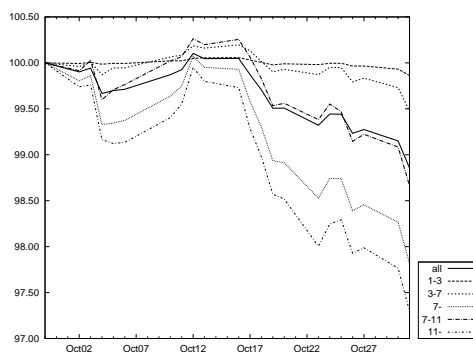
*は1995年12月末=100。それ以外は、1993年12月末=100。

指数の推移(月次) 2022年10月末=100に補正。



出所:NFRC

指数の推移(日次) 2023年9月末=100に補正。



出所:NFRC

銘柄 残存別・月間投資収益率(2023年10月末)

	全体	短期 (1-3)	中期 (3-7)	長期 (7-)	月間投資収益率	
					(7-11)	(11-)
総合	-18.18	-1.67	-5.96	-31.36	-15.13	-40.74
国債	-19.11	-1.69	-5.95	-32.30	-15.11	-42.15
30年国債	-43.02	-	-7.67	-43.29	-16.29	-45.51
20年国債	-20.09	-1.84	-6.39	-26.74	-15.43	-33.75
10年国債	-7.90	-1.82	-6.38	-14.67	-14.67	-
5年国債	-3.11	-1.89	-4.43	-	-	-
中期国債	-0.97	-0.97	-	-	-	-
地方債	-12.73	-1.69	-6.21	-22.98	-14.58	-32.00
東京都債	-11.91	-1.65	-6.23	-23.47	-14.26	-38.82
五大都市債	-14.49	-1.76	-5.94	-25.75	-14.29	-31.70
その他地方債	-12.00	-1.69	-6.20	-21.64	-14.59	-29.78
政保債	-15.62	-1.46	-5.63	-32.64	-15.66	-39.12
公営企業債券	-3.39	-1.50	-5.14	-	-	-
その他政保債	-17.60	-1.45	-5.79	-32.64	-15.66	-39.12
金融債	-3.53	-1.69	-4.57	-13.59	-13.59	-
特定金融債	-	-	-	-	-	-
事業債	-13.58	-1.56	-6.06	-32.90	-16.61	-46.08
円建外債	-3.98	-0.37	-4.07	-22.04	-15.81	-28.52
MBS	-13.69	-	-	-13.69	-3.11	-13.87
ABS	-8.27	-1.07	-5.50	-18.70	-12.91	-29.92

出所:NFRG

「除く(銘柄)」残存別・月間投資収益率(2023年10月末)

	全体	短期 (1-3)	中期 (3-7)	長期 (7-)	月間投資収益率	
					(7-11)	(11-)
除く国債	-13.05	-1.56	-6.00	-24.91	-15.26	-30.81
除く30年国債	-13.73	-1.67	-5.95	-26.43	-15.05	-37.20
除く20年国債	-17.49	-1.65	-5.84	-33.93	-14.95	-44.48
除く10年国債	-21.80	-1.60	-5.66	-34.52	-15.48	-40.74
除く5年国債	-19.96	-1.59	-6.31	-31.36	-15.13	-40.74
除く中期国債	-18.72	-1.79	-5.96	-31.36	-15.13	-40.74
除く地方債	-18.53	-1.67	-5.94	-31.82	-15.17	-41.10
除く東京都債	-18.21	-1.67	-5.96	-31.39	-15.13	-40.75
除く五大都市債	-18.20	-1.67	-5.96	-31.39	-15.13	-40.79
除くその他地方債	-18.45	-1.67	-5.95	-31.72	-15.16	-41.03
除く政保債	-18.22	-1.67	-5.97	-31.35	-15.12	-40.76
除く公営企業債券	-18.21	-1.67	-5.96	-31.36	-15.13	-40.74
除くその他政保債	-18.19	-1.67	-5.96	-31.35	-15.12	-40.76
除く金融債	-18.23	-1.67	-5.97	-31.37	-15.13	-40.74
除く特定金融債	-18.18	-1.67	-5.96	-31.36	-15.13	-40.74
除く事業債	-18.48	-1.68	-5.95	-31.30	-15.06	-40.56
除く円建外債	-18.22	-1.68	-5.97	-31.37	-15.13	-40.75
除くMBS	-18.24	-1.67	-5.96	-31.82	-15.14	-41.83
除くABS	-18.19	-1.67	-5.96	-31.37	-15.13	-40.74
除くMBS・ABS	-18.25	-1.67	-5.96	-31.82	-15.14	-41.83

出所:NFRG

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

事業債 業種別・月間投資収益率(2023年10月末)

	全体	短期 (1-3)	中期 (3-7)	長期 (7-)	月間投資収益率	
					(7-11)	(11-)
事業債 全体	-13.58	-1.56	-6.06	-32.90	-16.61	-46.08
水産・農林業	-	-	-	-	-	-
鉱業	-8.39	-2.16	-	-11.66	-11.66	-
建設業	-6.20	-1.49	-5.40	-21.67	-14.32	-31.82
食料品	-7.91	-1.90	-5.42	-24.76	-15.68	-36.15
繊維製品	-5.81	-1.19	-4.73	-30.65	-	-30.65
パルプ・紙	-7.43	-1.61	-5.64	-21.53	-11.73	-34.77
化学	-8.49	-1.31	-5.36	-22.38	-13.76	-34.64
医薬品	-10.95	-2.49	-5.91	-17.56	-12.98	-30.31
石油・石炭製品	-10.25	-1.53	-6.53	-17.60	-14.37	-34.72
ゴム製品	-5.82	-2.35	-5.86	-13.97	-13.97	-
ガラス・土石製品	-9.54	-1.81	-5.05	-20.17	-14.74	-35.02
鉄鋼	-4.33	-1.46	-5.78	-15.34	-15.34	-
非鉄金属	-6.12	-1.68	-5.11	-15.57	-15.57	-
金属製品	-4.56	-1.59	-5.14	-15.65	-15.65	-
機械	-6.15	-1.67	-5.25	-14.31	-14.31	-
電気機器	-4.55	-1.58	-5.82	-13.71	-13.71	-
輸送用機器	-6.20	-1.59	-4.85	-18.85	-13.94	-28.18
精密機器	-6.00	-1.11	-6.94	-13.98	-13.98	-
その他製品	-12.26	-0.77	-7.00	-27.69	-12.15	-33.43
電気・ガス業	-18.43	-1.47	-7.72	-37.46	-21.69	-53.56
陸運業	-24.87	-1.69	-6.72	-39.14	-16.40	-50.04
海運業	-6.59	-2.01	-6.00	-13.63	-13.63	-
空運業	-12.49	-1.78	-5.24	-26.67	-15.80	-29.67
倉庫・運輸関連業	-8.60	-0.73	-6.75	-33.10	-	-33.10
情報・通信業	-7.61	-1.73	-5.73	-24.39	-18.33	-41.32
卸売業	-11.24	-1.29	-6.47	-24.19	-16.09	-38.11
小売業	-5.13	-1.65	-5.25	-21.64	-15.69	-31.58
銀行業	-3.52	-1.22	-5.19	-10.97	-10.97	-
証券、商品先物取引業	-1.86	-1.23	-3.73	-14.74	-14.74	-
保険業	-5.41	-0.97	-3.69	-15.87	-15.87	-
その他金融業	-5.48	-1.60	-6.41	-17.78	-16.11	-31.19
不動産業	-11.76	-1.25	-5.54	-23.97	-14.86	-36.95
サービス業	-4.14	0.04	-4.71	-12.56	-9.89	-22.11
財投機関債	-17.01	-1.73	-5.57	-35.62	-14.51	-44.63

出所:NFRFC

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

事業債 円建外債 格付別・月間投資収益率(2023年10月末)

	全体	短期 (1-3)	中期 (3-7)	長期 (7-)	月間投資収益率	
					(7-11)	(11-)
事業債・円建外債 全体	-13.20	-1.49	-5.95	-32.79	-16.60	-45.92
AAA～AA 格	-15.01	-1.66	-6.10	-34.64	-16.07	-47.47
AAA 格	-8.65	-1.77	-5.98	-28.87	-15.13	-53.34
AA 格	-16.72	-1.61	-6.14	-35.36	-16.26	-47.04
A 格	-9.13	-1.19	-5.67	-26.60	-17.88	-38.61
事業債 全体	-13.58	-1.56	-6.06	-32.90	-16.61	-46.08
AAA～AA 格	-15.23	-1.67	-6.15	-34.68	-16.06	-47.47
AAA 格	-8.65	-1.77	-5.98	-28.87	-15.13	-53.34
AA 格	-17.04	-1.63	-6.20	-35.41	-16.26	-47.05
A 格	-9.60	-1.34	-5.86	-26.73	-17.94	-39.15
円建外債 全体	-3.98	-0.37	-4.07	-22.04	-15.81	-28.52
AAA～AA 格	-3.43	-1.18	-4.12	-17.72	-16.34	-31.88
AAA 格	-	-	-	-	-	-
AA 格	-3.43	-1.18	-4.12	-17.72	-16.34	-31.88
A 格	-4.24	0.07	-4.05	-23.10	-15.52	-28.40

出所:NFRFC

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

事業債 円建外債 最高格付別・月間投資収益率(2023年10月末)

	全体	短期 (1-3)	中期 (3-7)	長期 (7-)	月間投資収益率	
					(7-11)	(11-)
事業債						
AAA~AA格	-15.23	-1.67	-6.15	-34.68	-16.06	-47.47
AAA~A格	-13.58	-1.56	-6.06	-32.90	-16.61	-46.08
AAA~BBB格	-13.58	-1.56	-6.06	-32.90	-16.61	-46.08
AAA~BB格	-13.58	-1.56	-6.06	-32.90	-16.61	-46.08
AAA格	-8.65	-1.77	-5.98	-28.87	-15.13	-53.34
AA格	-17.04	-1.63	-6.20	-35.41	-16.26	-47.05
A格	-9.60	-1.34	-5.86	-26.73	-17.94	-39.15
BBB格	-	-	-	-	-	-
BB格	-	-	-	-	-	-
B格以下	-	-	-	-	-	-
格付なし	-	-	-	-	-	-
円建外債						
AAA~AA格	-3.43	-1.18	-4.12	-17.72	-16.34	-31.88
AAA~A格	-3.98	-0.37	-4.07	-22.04	-15.81	-28.52
AAA~BBB格	-3.98	-0.37	-4.07	-22.04	-15.81	-28.52
AAA~BB格	-3.98	-0.37	-4.07	-22.04	-15.81	-28.52
AAA格	-	-	-	-	-	-
AA格	-3.43	-1.18	-4.12	-17.72	-16.34	-31.88
A格	-4.24	0.07	-4.05	-23.10	-15.52	-28.40
BBB格	-	-	-	-	-	-
BB格	-	-	-	-	-	-
B格以下	-	-	-	-	-	-
格付なし	-	-	-	-	-	-

出所:NFRFC

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

事業債 円建外債 最低格付別・月間投資収益率(2023年10月末)

	全体	短期 (1-3)	中期 (3-7)	長期 (7-)	月間投資収益率	
					(7-11)	(11-)
事業債						
AAA~AA格	-12.92	-1.58	-5.57	-35.41	-15.61	-48.95
AAA~A格	-13.72	-1.57	-6.01	-32.80	-16.56	-45.87
AAA~BBB格	-13.60	-1.56	-6.04	-32.90	-16.61	-46.10
AAA~BB格	-13.58	-1.56	-6.06	-32.90	-16.61	-46.08
AAA格	-	-	-	-	-	-
AA格	-12.92	-1.58	-5.57	-35.41	-15.61	-48.95
A格	-13.85	-1.57	-6.09	-32.45	-16.67	-45.42
BBB格	-11.10	-1.46	-6.89	-35.99	-18.16	-54.51
BB格	-10.05	-	-7.18	-36.75	-	-36.75
B格以下	-	-	-	-	-	-
格付なし	-	-	-	-	-	-
円建外債						
AAA~AA格	-2.69	-0.80	-4.52	-14.46	-14.46	-
AAA~A格	-3.48	-0.52	-4.15	-21.02	-15.01	-27.65
AAA~BBB格	-3.98	-0.37	-4.07	-22.04	-15.81	-28.52
AAA~BB格	-3.98	-0.37	-4.07	-22.04	-15.81	-28.52
AAA格	-	-	-	-	-	-
AA格	-2.69	-0.80	-4.52	-14.46	-14.46	-
A格	-3.60	-0.47	-4.09	-21.44	-15.08	-27.65
BBB格	-4.63	-0.05	-4.00	-23.03	-16.62	-29.32
BB格	-	-	-	-	-	-
B格以下	-	-	-	-	-	-
格付なし	-	-	-	-	-	-

出所:NFRFC

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

事業債 円建外債 R&I 格付別・月間投資収益率(2023年10月末)

	全体	短期 (1-3)	中期 (3-7)	長期 (7-)	月間投資収益率	
					(7-11)	(11-)
事業債						
AAA~AA 格	-16.15	-1.69	-5.75	-35.53	-15.56	-46.93
AAA~A 格	-14.16	-1.60	-6.05	-33.70	-16.87	-46.75
AAA~BBB 格	-14.12	-1.59	-6.04	-33.66	-16.85	-46.67
AAA~BB 格	-14.12	-1.59	-6.04	-33.66	-16.85	-46.67
AAA 格	-5.81	-1.88	-4.63	-16.20	-14.06	-26.15
AA 格	-16.37	-1.68	-5.77	-35.75	-15.60	-47.00
A 格	-11.36	-1.50	-6.43	-30.09	-18.48	-46.21
BBB 格	-6.66	-0.34	-3.65	-23.45	-10.34	-28.52
BB 格	-	-	-	-	-	-
B 格以下	-	-	-	-	-	-
格付なし	-7.88	-1.28	-6.18	-20.86	-13.98	-32.18
円建外債						
AAA~AA 格	-0.76	-0.76	-	-	-	-
AAA~A 格	-2.66	-0.08	-4.32	-17.45	-17.45	-
AAA~BBB 格	-2.66	-0.08	-4.32	-17.45	-17.45	-
AAA~BB 格	-2.66	-0.08	-4.32	-17.45	-17.45	-
AAA 格	-	-	-	-	-	-
AA 格	-0.76	-0.76	-	-	-	-
A 格	-2.80	0.03	-4.32	-17.45	-17.45	-
BBB 格	-	-	-	-	-	-
BB 格	-	-	-	-	-	-
B 格以下	-	-	-	-	-	-
格付なし	-4.59	-0.54	-3.96	-22.67	-15.30	-28.52

出所:NFRFC

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

事業債 円建外債 JCR 格付別・月間投資収益率(2023年10月末)

	全体	短期 (1-3)	中期 (3-7)	長期 (7-)	月間投資収益率	
					(7-11)	(11-)
事業債						
AAA~AA 格	-10.88	-1.64	-6.27	-30.04	-16.37	-49.22
AAA~A 格	-10.58	-1.55	-6.13	-28.48	-16.87	-45.08
AAA~BBB 格	-10.58	-1.55	-6.13	-28.48	-16.87	-45.08
AAA~BB 格	-10.58	-1.55	-6.13	-28.48	-16.87	-45.08
AAA 格	-8.86	-1.78	-6.03	-28.87	-15.13	-53.34
AA 格	-12.06	-1.54	-6.43	-30.49	-16.91	-47.93
A 格	-9.93	-1.34	-5.81	-25.35	-17.86	-36.48
BBB 格	-	-	-	-	-	-
BB 格	-	-	-	-	-	-
B 格以下	-	-	-	-	-	-
格付なし	-17.75	-1.58	-5.94	-36.82	-16.19	-46.62
円建外債						
AAA~AA 格	-4.04	-0.94	-2.96	-18.02	-14.86	-31.88
AAA~A 格	-5.50	-0.22	-3.60	-24.13	-15.67	-29.12
AAA~BBB 格	-5.50	-0.22	-3.60	-24.13	-15.67	-29.12
AAA~BB 格	-5.50	-0.22	-3.60	-24.13	-15.67	-29.12
AAA 格	-	-	-	-	-	-
AA 格	-4.04	-0.94	-2.96	-18.02	-14.86	-31.88
A 格	-5.88	-0.14	-3.88	-25.06	-16.00	-29.01
BBB 格	-	-	-	-	-	-
BB 格	-	-	-	-	-	-
B 格以下	-	-	-	-	-	-
格付なし	-3.01	-0.44	-4.38	-16.97	-15.95	-22.60

出所:NFRFC

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

事業債 円建外債 Moody's 格付別・月間投資収益率(2023年10月末)

	全体	短期 (1-3)	中期 (3-7)	長期 (7-)	月間投資収益率	
					(7-11)	(11-)
事業債						
AAA~AA格	-	-	-	-	-	-
AAA~A格	-15.90	-1.68	-5.87	-35.57	-16.50	-46.23
AAA~BBB格	-15.61	-1.67	-6.08	-35.81	-16.72	-46.86
AAA~BB格	-15.61	-1.67	-6.08	-35.81	-16.72	-46.86
AAA格	-	-	-	-	-	-
AA格	-	-	-	-	-	-
A格	-15.90	-1.68	-5.87	-35.57	-16.50	-46.23
BBB格	-12.93	-1.60	-7.55	-39.45	-19.13	-58.91
BB格	-	-	-	-	-	-
B格以下	-	-	-	-	-	-
格付なし	-12.39	-1.50	-6.04	-30.89	-16.56	-45.39
円建外債						
AAA~AA格	-3.23	-1.19	-4.81	-16.77	-16.77	-
AAA~A格	-3.87	-0.65	-4.22	-21.25	-15.73	-26.83
AAA~BBB格	-4.45	-0.63	-4.15	-22.31	-15.93	-28.52
AAA~BB格	-4.45	-0.63	-4.15	-22.31	-15.93	-28.52
AAA格	-	-	-	-	-	-
AA格	-3.23	-1.19	-4.81	-16.77	-16.77	-
A格	-4.40	-0.02	-3.84	-22.64	-14.81	-26.83
BBB格	-5.60	-0.55	-4.05	-23.76	-16.21	-30.73
BB格	-	-	-	-	-	-
B格以下	-	-	-	-	-	-
格付なし	-1.11	0.66	-3.40	-13.97	-13.97	-

出所:NFRFC

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

事業債 円建外債 S&P 格付別・月間投資収益率(2023年10月末)

	全体	短期 (1-3)	中期 (3-7)	長期 (7-)	月間投資収益率	
					(7-11)	(11-)
事業債						
AAA~AA格	-36.97	-2.08	-7.21	-43.35	-17.50	-59.24
AAA~A格	-16.82	-1.75	-6.61	-34.11	-15.94	-48.87
AAA~BBB格	-16.28	-1.73	-6.55	-33.89	-15.93	-48.82
AAA~BB格	-16.19	-1.73	-6.58	-33.90	-15.93	-48.74
AAA格	-	-	-	-	-	-
AA格	-36.97	-2.08	-7.21	-43.35	-17.50	-59.24
A格	-15.84	-1.75	-6.60	-33.17	-15.81	-47.67
BBB格	-4.56	-1.58	-5.18	-17.01	-15.59	-28.36
BB格	-10.05	-	-7.18	-36.75	-	-36.75
B格以下	-	-	-	-	-	-
格付なし	-12.73	-1.51	-5.90	-32.48	-16.91	-44.97
円建外債						
AAA~AA格	-3.73	-1.02	-4.62	-14.46	-14.46	-
AAA~A格	-3.94	-0.70	-4.07	-21.14	-15.03	-27.65
AAA~BBB格	-4.30	-0.46	-4.06	-22.11	-15.83	-28.52
AAA~BB格	-4.30	-0.46	-4.06	-22.11	-15.83	-28.52
AAA格	-	-	-	-	-	-
AA格	-3.73	-1.02	-4.62	-14.46	-14.46	-
A格	-3.96	-0.67	-4.00	-21.58	-15.11	-27.65
BBB格	-4.73	-0.05	-4.05	-23.03	-16.62	-29.32
BB格	-	-	-	-	-	-
B格以下	-	-	-	-	-	-
格付なし	-0.38	0.04	-5.03	-14.50	-14.50	-

出所:NFRFC

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

このページは空白です。

銘柄 残存別・ポートフォリオ指標 (2023年10月末)

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
総合	1,111,513	96.80	96.97	10.15	0.77	0.86	0.83	8.79	8.73	8.75	5
短期 (1-3)	224,058	100.42	100.52	1.94	0.39	0.15	0.15	1.93	1.93	1.93	6
中期 (3-7)	301,024	100.57	100.71	4.77	0.59	0.47	0.47	4.69	4.68	4.69	6
長期 (7-)	586,431	93.49	93.70	16.05	1.00	1.36	1.31	13.86	13.76	13.79	4
長期 (7-11)	202,913	100.40	100.62	8.69	0.92	0.89	0.89	8.35	8.31	8.34	5
超長期 (11-)	383,518	89.83	90.04	19.95	1.04	1.63	1.56	17.12	16.98	17.00	4
(11-15)	96,209	98.21	98.45	12.93	1.11	1.25	1.24	12.01	11.94	11.99	4
(15-)	287,309	87.03	87.22	22.30	1.02	1.78	1.68	19.04	18.88	18.90	4
国債	940,238	96.87	97.05	10.63	0.79	0.85	0.82	9.16	9.10	9.12	1
短期 (1-3)	184,235	100.53	100.62	1.93	0.39	0.10	0.10	1.92	1.92	1.92	1
中期 (3-7)	245,159	100.89	101.03	4.76	0.60	0.42	0.42	4.68	4.67	4.68	0
長期 (7-)	510,843	93.62	93.84	16.58	1.03	1.36	1.30	14.28	14.17	14.20	1
長期 (7-11)	175,277	100.93	101.16	8.72	0.95	0.85	0.85	8.36	8.33	8.36	1
超長期 (11-)	335,567	89.81	90.02	20.69	1.07	1.66	1.57	17.74	17.60	17.63	1
(11-15)	84,475	98.91	99.16	12.97	1.14	1.22	1.21	12.03	11.96	12.01	1
(15-)	251,091	86.75	86.95	23.29	1.05	1.83	1.71	19.94	19.76	19.78	1
地方債	67,529	97.06	97.18	7.46	0.57	0.78	0.79	6.89	6.85	6.86	14
短期 (1-3)	13,111	100.24	100.32	2.01	0.39	0.24	0.24	2.00	2.00	2.00	13
中期 (3-7)	23,800	99.49	99.59	4.95	0.50	0.58	0.58	4.87	4.86	4.87	14
長期 (7-)	30,617	93.81	93.96	11.74	0.71	1.20	1.23	10.78	10.71	10.73	15
政保債	14,801	96.59	96.79	8.97	0.67	0.82	0.79	7.75	7.70	7.72	11
短期 (1-3)	4,069	100.02	100.08	1.82	0.24	0.18	0.18	1.82	1.81	1.82	10
中期 (3-7)	4,416	100.06	100.18	4.57	0.48	0.50	0.50	4.52	4.50	4.51	11
長期 (7-)	6,316	91.96	92.30	16.65	1.07	1.50	1.43	14.35	14.24	14.29	11
金融債	3,436	98.76	98.80	3.22	0.18	0.50	0.49	3.17	3.16	3.17	25
短期 (1-3)	1,894	99.49	99.52	2.06	0.12	0.35	0.35	2.06	2.05	2.06	23
中期 (3-7)	1,322	98.52	98.58	4.05	0.24	0.60	0.60	4.02	4.01	4.02	26
長期 (7-)	220	93.92	94.02	8.18	0.40	1.22	1.19	8.03	7.99	8.03	39
事業債	67,536	95.76	95.93	7.75	0.67	1.06	1.02	6.67	6.62	6.64	43
短期 (1-3)	19,384	99.77	99.87	2.07	0.40	0.50	0.50	2.06	2.06	2.06	38
中期 (3-7)	24,680	98.81	98.95	4.77	0.62	0.86	0.85	4.68	4.66	4.68	44
長期 (7-)	23,473	89.25	89.49	15.56	0.95	1.80	1.69	13.22	13.10	13.14	48
長期 (7-11)	9,962	95.47	95.67	8.59	0.83	1.43	1.39	8.27	8.21	8.26	56
超長期 (11-)	13,510	84.66	84.93	20.70	1.04	2.11	1.94	17.33	17.16	17.19	41
円建外債	2,756	98.12	98.43	3.90	1.08	1.47	1.45	3.68	3.65	3.68	115
短期 (1-3)	1,159	99.59	99.88	2.03	1.04	1.20	1.20	2.00	1.99	2.00	109
中期 (3-7)	1,362	97.78	98.06	4.19	0.97	1.49	1.47	4.09	4.06	4.09	112
長期 (7-)	236	92.93	93.48	11.37	1.87	2.73	2.63	9.97	9.83	9.93	159
長期 (7-11)	121	92.75	93.06	8.87	1.28	2.28	2.20	8.34	8.25	8.33	135
超長期 (11-)	114	93.11	93.93	14.03	2.50	3.21	3.09	11.68	11.50	11.62	184
MBS	14,490	95.57	95.61	7.18	0.63	0.80	1.16	6.73	6.69	6.76	17
ABS	727	95.90	96.06	5.92	0.69	1.18	1.15	5.48	5.44	5.47	65
短期 (1-3)	206	99.97	100.13	1.90	0.69	0.68	0.68	1.89	1.88	1.89	59
中期 (3-7)	285	97.87	98.03	4.88	0.68	1.09	1.08	4.78	4.76	4.78	65
長期 (7-)	237	89.98	90.15	10.66	0.71	1.78	1.68	9.85	9.76	9.83	71

出所:NFRIC

「除く」銘柄 残存別・ポートフォリオ指標 (2023年10月末)

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
除く MBS	1,097,023	96.82	96.99	10.19	0.77	0.86	0.83	8.81	8.76	8.78	5
短期 (1-3)	224,058	100.42	100.52	1.94	0.39	0.15	0.15	1.93	1.93	1.93	6
中期 (3-7)	301,024	100.57	100.71	4.77	0.59	0.47	0.47	4.69	4.68	4.69	6
長期 (7-)	571,942	93.43	93.65	16.28	1.01	1.37	1.32	14.04	13.94	13.97	4
長期 (7-11)	202,690	100.40	100.63	8.70	0.92	0.89	0.89	8.35	8.31	8.35	5
超長期 (11-)	369,252	89.61	89.82	20.44	1.06	1.67	1.58	17.54	17.40	17.42	3
(11-15)	96,209	98.21	98.45	12.93	1.11	1.25	1.24	12.01	11.94	11.99	4
(15-)	273,043	86.58	86.78	23.08	1.04	1.83	1.71	19.75	19.58	19.60	3
除く ABS	1,110,786	96.80	96.97	10.15	0.77	0.86	0.83	8.79	8.73	8.75	5
短期 (1-3)	223,852	100.43	100.52	1.94	0.39	0.15	0.15	1.93	1.93	1.93	6
中期 (3-7)	300,739	100.57	100.71	4.77	0.59	0.47	0.47	4.69	4.68	4.69	5
長期 (7-)	586,195	93.49	93.70	16.05	1.00	1.36	1.31	13.86	13.76	13.79	4
長期 (7-11)	202,762	100.40	100.63	8.69	0.92	0.89	0.89	8.35	8.31	8.34	5
超長期 (11-)	383,432	89.83	90.04	19.95	1.04	1.63	1.56	17.12	16.98	17.01	4
(11-15)	96,151	98.22	98.46	12.93	1.11	1.25	1.24	12.01	11.94	11.99	4
(15-)	287,281	87.03	87.22	22.30	1.02	1.78	1.68	19.04	18.88	18.90	4
除く MBS・ABS	1,096,296	96.82	96.99	10.19	0.77	0.86	0.83	8.82	8.76	8.78	5
短期 (1-3)	223,852	100.43	100.52	1.94	0.39	0.15	0.15	1.93	1.93	1.93	6
中期 (3-7)	300,739	100.57	100.71	4.77	0.59	0.47	0.47	4.69	4.68	4.69	5
長期 (7-)	571,705	93.44	93.65	16.28	1.01	1.37	1.32	14.04	13.94	13.97	4
長期 (7-11)	202,539	100.40	100.63	8.70	0.92	0.89	0.89	8.35	8.31	8.35	5
超長期 (11-)	369,166	89.61	89.83	20.44	1.06	1.67	1.58	17.54	17.40	17.42	3
(11-15)	96,151	98.22	98.46	12.93	1.11	1.25	1.24	12.01	11.94	11.99	4
(15-)	273,015	86.58	86.79	23.08	1.04	1.83	1.71	19.75	19.58	19.60	3
除く 国債	171,276	96.43	96.57	7.53	0.63	0.90	0.92	6.73	6.69	6.71	28
短期 (1-3)	39,823	99.94	100.03	2.02	0.39	0.39	0.39	2.01	2.01	2.01	29
中期 (3-7)	55,865	99.16	99.29	4.80	0.56	0.72	0.72	4.72	4.70	4.72	30
長期 (7-)	75,588	92.56	92.74	12.45	0.80	1.33	1.37	10.99	10.91	10.95	26
長期 (7-11)	27,637	97.03	97.20	8.51	0.75	1.15	1.13	8.22	8.18	8.22	31
超長期 (11-)	47,951	89.99	90.16	14.72	0.83	1.45	1.53	12.71	12.61	12.64	22

出所:NFR

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

銘柄 残存別・ポートフォリオ指標 (2023年10月末、11月ポートフォリオ)

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
総合	1,122,227	96.81	96.98	10.20	0.77	0.86	0.84	8.82	8.77	8.79	5
短期 (1-3)	224,234	100.42	100.51	1.97	0.39	0.16	0.16	1.96	1.96	1.96	6
中期 (3-7)	305,350	100.59	100.73	4.79	0.60	0.48	0.48	4.71	4.70	4.71	6
長期 (7-)	592,643	93.50	93.71	16.10	1.00	1.36	1.32	13.89	13.79	13.82	4
長期 (7-11)	205,397	100.32	100.54	8.73	0.91	0.89	0.89	8.38	8.34	8.37	5
超長期 (11-)	387,246	89.88	90.08	20.01	1.05	1.63	1.57	17.15	17.01	17.04	4
(11-15)	96,428	98.20	98.44	12.93	1.11	1.25	1.24	12.01	11.94	11.99	4
(15-)	290,818	87.12	87.31	22.35	1.02	1.78	1.69	19.08	18.91	18.93	4
国債	949,624	96.88	97.05	10.67	0.79	0.85	0.82	9.19	9.14	9.15	1
短期 (1-3)	184,239	100.53	100.62	1.94	0.39	0.10	0.11	1.93	1.93	1.93	1
中期 (3-7)	248,744	100.92	101.06	4.77	0.60	0.42	0.42	4.69	4.68	4.69	0
長期 (7-)	516,641	93.63	93.85	16.63	1.03	1.36	1.31	14.30	14.20	14.23	1
長期 (7-11)	177,658	100.84	101.07	8.75	0.94	0.85	0.85	8.39	8.36	8.39	1
超長期 (11-)	338,984	89.86	90.07	20.75	1.08	1.66	1.57	17.78	17.64	17.66	1
(11-15)	84,559	98.91	99.16	12.97	1.14	1.22	1.21	12.03	11.96	12.01	1
(15-)	254,425	86.85	87.04	23.34	1.05	1.83	1.71	19.96	19.79	19.80	1
地方債	67,630	97.04	97.16	7.54	0.58	0.79	0.80	6.97	6.93	6.94	14
短期 (1-3)	13,008	100.21	100.29	2.09	0.39	0.25	0.25	2.08	2.07	2.08	13
中期 (3-7)	23,957	99.44	99.55	5.02	0.50	0.59	0.59	4.95	4.94	4.95	14
長期 (7-)	30,664	93.81	93.95	11.82	0.72	1.21	1.23	10.85	10.78	10.79	15
政保債	14,651	96.52	96.72	9.16	0.68	0.84	0.81	7.92	7.87	7.90	11
短期 (1-3)	3,759	100.00	100.07	1.90	0.24	0.19	0.19	1.89	1.89	1.89	10
中期 (3-7)	4,531	100.07	100.19	4.62	0.49	0.51	0.51	4.56	4.55	4.56	11
長期 (7-)	6,361	91.93	92.27	16.68	1.07	1.50	1.43	14.39	14.28	14.33	11
金融債	3,431	98.74	98.79	3.28	0.19	0.51	0.50	3.23	3.22	3.23	25
短期 (1-3)	1,889	99.46	99.49	2.12	0.12	0.36	0.35	2.12	2.11	2.12	23
中期 (3-7)	1,322	98.52	98.58	4.11	0.25	0.61	0.61	4.08	4.07	4.08	26
長期 (7-)	220	93.92	94.02	8.18	0.40	1.22	1.19	8.03	7.99	8.03	39
事業債	68,673	95.80	95.96	7.75	0.68	1.06	1.02	6.68	6.64	6.66	43
短期 (1-3)	19,907	99.75	99.85	2.11	0.40	0.50	0.50	2.10	2.10	2.10	38
中期 (3-7)	25,042	98.79	98.93	4.82	0.63	0.87	0.86	4.74	4.72	4.74	44
長期 (7-)	23,725	89.32	89.55	15.58	0.96	1.80	1.69	13.24	13.12	13.16	48
長期 (7-11)	10,096	95.50	95.70	8.67	0.84	1.44	1.39	8.33	8.28	8.33	56
超長期 (11-)	13,629	84.74	85.00	20.69	1.04	2.11	1.94	17.33	17.16	17.19	41
円建外債	2,949	98.18	98.48	3.97	1.07	1.44	1.43	3.76	3.73	3.76	111
短期 (1-3)	1,245	99.80	100.13	2.11	1.10	1.19	1.19	2.08	2.07	2.08	107
中期 (3-7)	1,457	97.66	97.88	4.32	0.90	1.46	1.45	4.23	4.20	4.23	108
長期 (7-)	247	93.15	93.70	11.31	1.85	2.68	2.58	9.93	9.80	9.90	154
長期 (7-11)	133	93.19	93.49	8.96	1.29	2.22	2.15	8.42	8.33	8.41	129
超長期 (11-)	114	93.11	93.93	14.03	2.50	3.21	3.09	11.68	11.50	11.62	184
MBS	14,554	95.58	95.62	7.21	0.63	0.81	1.16	6.76	6.72	6.78	17
ABS	714	95.80	95.96	6.06	0.69	1.20	1.16	5.61	5.57	5.61	65
短期 (1-3)	187	99.90	100.05	2.01	0.69	0.71	0.71	2.00	1.99	2.00	60
中期 (3-7)	297	97.82	97.98	4.95	0.68	1.09	1.08	4.85	4.82	4.85	64
長期 (7-)	230	89.87	90.04	10.77	0.72	1.79	1.69	9.95	9.86	9.93	71

出所:NFRIC

「除く」銘柄残存別・ポートフォリオ指標(2023年10月末、11月ポートフォリオ)

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
除く MBS	1,107,673	96.82	96.99	10.23	0.77	0.86	0.83	8.85	8.80	8.81	5
短期 (1-3)	224,234	100.42	100.51	1.97	0.39	0.16	0.16	1.96	1.96	1.96	6
中期 (3-7)	305,350	100.59	100.73	4.79	0.60	0.48	0.48	4.71	4.70	4.71	6
長期 (7-)	578,088	93.44	93.66	16.32	1.01	1.37	1.32	14.07	13.97	14.00	4
長期 (7-11)	205,173	100.32	100.55	8.73	0.91	0.89	0.89	8.39	8.35	8.38	5
超長期 (11-)	372,916	89.66	89.87	20.49	1.06	1.67	1.58	17.58	17.43	17.46	3
(11-15)	96,403	98.20	98.44	12.93	1.11	1.25	1.24	12.01	11.94	11.99	4
(15-)	276,512	86.68	86.88	23.13	1.04	1.83	1.72	19.77	19.60	19.62	3
除く ABS	1,121,513	96.81	96.98	10.20	0.77	0.86	0.84	8.83	8.77	8.79	5
短期 (1-3)	224,047	100.42	100.51	1.97	0.39	0.16	0.16	1.96	1.96	1.96	6
中期 (3-7)	305,053	100.59	100.73	4.79	0.60	0.47	0.48	4.71	4.70	4.71	5
長期 (7-)	592,413	93.50	93.71	16.10	1.00	1.36	1.31	13.89	13.79	13.82	4
長期 (7-11)	205,252	100.33	100.55	8.73	0.91	0.89	0.89	8.38	8.34	8.37	5
超長期 (11-)	387,160	89.88	90.08	20.01	1.05	1.63	1.57	17.15	17.01	17.04	4
(11-15)	96,371	98.21	98.45	12.93	1.11	1.25	1.24	12.01	11.94	11.99	4
(15-)	290,790	87.12	87.31	22.35	1.02	1.78	1.69	19.08	18.91	18.93	4
除く MBS・ABS	1,106,959	96.82	96.99	10.24	0.77	0.86	0.83	8.85	8.80	8.82	5
短期 (1-3)	224,047	100.42	100.51	1.97	0.39	0.16	0.16	1.96	1.96	1.96	6
中期 (3-7)	305,053	100.59	100.73	4.79	0.60	0.47	0.48	4.71	4.70	4.71	5
長期 (7-)	577,858	93.44	93.66	16.32	1.01	1.37	1.32	14.08	13.97	14.00	4
長期 (7-11)	205,029	100.33	100.55	8.73	0.91	0.89	0.89	8.39	8.35	8.38	5
超長期 (11-)	372,830	89.66	89.87	20.50	1.06	1.67	1.58	17.58	17.43	17.46	3
(11-15)	96,346	98.21	98.45	12.93	1.11	1.25	1.24	12.01	11.94	11.99	4
(15-)	276,484	86.68	86.88	23.13	1.04	1.83	1.72	19.77	19.60	19.62	3
除く 国債	172,603	96.42	96.56	7.58	0.63	0.91	0.92	6.78	6.74	6.76	28
短期 (1-3)	39,995	99.92	100.01	2.08	0.39	0.41	0.40	2.07	2.07	2.07	29
中期 (3-7)	56,606	99.13	99.25	4.86	0.56	0.73	0.73	4.79	4.77	4.78	30
長期 (7-)	76,001	92.57	92.75	12.50	0.81	1.34	1.38	11.04	10.96	11.00	25
長期 (7-11)	27,739	97.03	97.20	8.60	0.76	1.16	1.14	8.30	8.25	8.29	31
超長期 (11-)	48,262	90.02	90.18	14.75	0.83	1.45	1.53	12.74	12.64	12.67	22

出所:NFRC

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

特定銘柄 残存別・ポートフォリオ指標 (2023年10月末)

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
30年国債	171,389	93.27	93.56	21.06	1.43	1.66	1.59	17.63	17.48	17.50	2
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	1,109	111.58	112.23	6.30	2.46	0.55	0.58	5.87	5.85	5.87	0
長期(7-)	170,280	93.15	93.44	21.15	1.42	1.67	1.60	17.72	17.58	17.60	2
長期(7-11)	11,079	111.01	111.67	9.49	2.15	0.87	0.92	8.64	8.60	8.62	2
超長期(11-)	159,201	91.90	92.17	21.97	1.37	1.73	1.65	18.49	18.33	18.35	2
20年国債	288,578	99.05	99.37	10.56	1.34	0.95	0.93	9.55	9.50	9.54	1
短期(1-3)	23,108	104.12	104.60	2.06	2.11	0.12	0.12	2.02	2.02	2.02	1
中期(3-7)	60,264	108.00	108.49	5.13	2.08	0.44	0.46	4.88	4.87	4.88	1
長期(7-)	205,207	95.85	96.10	13.11	1.04	1.22	1.19	12.03	11.95	12.00	1
長期(7-11)	70,992	106.84	107.24	9.02	1.70	0.85	0.88	8.39	8.35	8.38	2
超長期(11-)	134,215	90.03	90.20	15.27	0.69	1.46	1.38	14.31	14.21	14.28	0
10年国債	289,401	97.72	97.76	5.37	0.18	0.49	0.48	5.28	5.26	5.28	0
短期(1-3)	68,544	100.22	100.28	2.01	0.27	0.11	0.11	2.01	2.00	2.01	1
中期(3-7)	127,651	98.20	98.22	4.95	0.10	0.44	0.44	4.93	4.91	4.93	0
長期(7-)	93,206	95.23	95.28	8.40	0.23	0.84	0.82	8.31	8.27	8.31	0
5年国債	115,847	99.50	99.52	2.95	0.08	0.22	0.22	2.94	2.93	2.94	0
短期(1-3)	59,711	99.83	99.85	2.05	0.06	0.12	0.12	2.05	2.05	2.05	0
中期(3-7)	56,136	99.15	99.17	3.89	0.10	0.33	0.33	3.88	3.88	3.88	0
中期国債	32,872	99.93	99.93	1.41	0.01	0.05	0.05	1.41	1.41	1.41	2
短期(1-3)	32,872	99.93	99.93	1.41	0.01	0.05	0.05	1.41	1.41	1.41	2
中期(3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
地方公共団体	57,621	97.12	97.24	7.27	0.54	0.76	0.77	6.74	6.70	6.72	13
短期(1-3)	11,513	100.20	100.28	2.01	0.37	0.23	0.23	2.00	2.00	2.00	13
中期(3-7)	20,436	99.32	99.42	4.92	0.45	0.57	0.57	4.85	4.84	4.85	13
長期(7-)	25,672	93.99	94.15	11.49	0.69	1.17	1.21	10.59	10.52	10.53	14
東京都債	4,920	98.61	98.73	7.15	0.68	0.75	0.74	6.57	6.54	6.56	14
短期(1-3)	1,175	100.43	100.52	1.99	0.49	0.23	0.23	1.98	1.98	1.98	12
中期(3-7)	1,790	99.61	99.70	4.93	0.51	0.57	0.57	4.86	4.84	4.86	13
長期(7-)	1,955	96.60	96.78	12.29	0.95	1.24	1.22	11.06	10.98	11.02	15
五大都市債	6,308	97.78	97.97	8.32	0.81	0.82	0.86	7.48	7.44	7.44	14
短期(1-3)	1,119	100.65	100.79	2.05	0.57	0.24	0.24	2.04	2.04	2.04	12
中期(3-7)	2,154	101.12	101.31	4.81	0.79	0.55	0.56	4.71	4.70	4.71	13
長期(7-)	3,035	94.35	94.55	13.13	0.92	1.26	1.32	11.73	11.64	11.64	14
その他地方公共団体	46,392	96.87	96.99	7.13	0.49	0.75	0.77	6.66	6.62	6.63	13
短期(1-3)	9,219	100.12	100.19	2.01	0.33	0.23	0.23	2.00	2.00	2.00	13
中期(3-7)	16,492	99.05	99.14	4.93	0.40	0.57	0.57	4.87	4.86	4.87	13
長期(7-)	20,682	93.69	93.84	11.18	0.63	1.15	1.19	10.38	10.31	10.32	14
その他地方債	9,909	96.72	96.82	8.57	0.77	0.93	0.90	7.75	7.70	7.73	19
短期(1-3)	1,599	100.53	100.62	2.00	0.57	0.27	0.27	1.99	1.99	1.99	16
中期(3-7)	3,365	100.53	100.66	5.10	0.78	0.64	0.64	5.00	4.98	5.00	19
長期(7-)	4,945	92.89	92.99	13.05	0.83	1.37	1.32	11.78	11.70	11.75	19
特定金融債	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
政保地方公営企業債	2,035	99.24	99.26	3.13	0.19	0.34	0.33	3.11	3.11	3.11	10
短期(1-3)	970	100.04	100.06	1.88	0.25	0.19	0.19	1.87	1.87	1.87	10
中期(3-7)	1,065	98.52	98.53	4.28	0.14	0.47	0.47	4.26	4.25	4.26	10
長期(7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
その他政保債	12,766	96.17	96.40	9.90	0.74	0.90	0.86	8.51	8.46	8.48	11
短期(1-3)	3,099	100.01	100.09	1.80	0.24	0.18	0.18	1.80	1.80	1.80	10
中期(3-7)	3,351	100.55	100.71	4.66	0.59	0.51	0.52	4.59	4.58	4.59	11
長期(7-)	6,316	91.96	92.30	16.65	1.07	1.50	1.43	14.35	14.24	14.29	11
SDGs	11,881	95.44	95.55	7.63	0.42	0.93	0.90	6.83	6.79	6.81	29

出所:NFRC

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

特定銘柄 残存別・ポートフォリオ指標 (2023年10月末、11月ポートフォリオ)

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
30年国債	172,791	93.31	93.61	21.10	1.43	1.66	1.59	17.65	17.51	17.53	2
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	1,941	113.19	114.12	6.62	2.65	0.58	0.61	6.11	6.09	6.10	0
長期(7-)	170,850	93.09	93.37	21.26	1.42	1.67	1.60	17.81	17.67	17.68	2
長期(7-11)	10,379	110.67	111.28	9.68	2.09	0.89	0.94	8.81	8.77	8.80	2
超長期(11-)	160,472	91.95	92.22	22.01	1.38	1.73	1.66	18.52	18.36	18.38	2
20年国債	290,187	99.04	99.36	10.60	1.34	0.95	0.93	9.58	9.53	9.57	1
短期(1-3)	23,108	104.12	104.60	2.06	2.11	0.12	0.12	2.02	2.02	2.02	1
中期(3-7)	60,326	108.00	108.50	5.13	2.08	0.44	0.46	4.88	4.87	4.88	1
長期(7-)	206,754	95.86	96.11	13.15	1.04	1.22	1.19	12.05	11.98	12.03	1
長期(7-11)	71,179	106.84	107.24	9.02	1.70	0.85	0.88	8.39	8.35	8.38	2
超長期(11-)	135,574	90.10	90.27	15.31	0.70	1.46	1.38	14.34	14.24	14.31	0
10年国債	292,311	97.73	97.77	5.41	0.19	0.49	0.48	5.32	5.30	5.32	0
短期(1-3)	68,544	100.22	100.28	2.01	0.27	0.11	0.11	2.01	2.00	2.01	1
中期(3-7)	127,667	98.20	98.22	4.95	0.10	0.44	0.44	4.93	4.92	4.93	0
長期(7-)	96,100	95.33	95.39	8.44	0.25	0.85	0.83	8.34	8.31	8.34	0
5年国債	118,521	99.49	99.52	2.99	0.09	0.22	0.22	2.98	2.98	2.98	0
短期(1-3)	59,711	99.83	99.85	2.05	0.06	0.12	0.12	2.05	2.05	2.05	0
中期(3-7)	58,810	99.15	99.18	3.94	0.11	0.33	0.33	3.93	3.92	3.93	0
中期国債	32,876	99.91	99.91	1.50	0.01	0.06	0.06	1.50	1.50	1.50	2
短期(1-3)	32,876	99.91	99.91	1.50	0.01	0.06	0.06	1.50	1.50	1.50	2
中期(3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
地方公共団体	57,679	97.09	97.21	7.35	0.54	0.77	0.78	6.82	6.79	6.80	13
短期(1-3)	11,387	100.17	100.25	2.09	0.36	0.24	0.24	2.08	2.08	2.08	12
中期(3-7)	20,597	99.28	99.38	5.00	0.45	0.58	0.58	4.93	4.92	4.93	13
長期(7-)	25,695	93.98	94.13	11.57	0.69	1.18	1.22	10.66	10.59	10.60	14
東京都債	4,940	98.60	98.73	7.16	0.68	0.75	0.74	6.58	6.55	6.57	14
短期(1-3)	1,175	100.43	100.52	1.99	0.49	0.23	0.23	1.98	1.98	1.98	12
中期(3-7)	1,790	99.61	99.70	4.93	0.51	0.57	0.57	4.86	4.84	4.86	13
長期(7-)	1,975	96.61	96.79	12.26	0.95	1.24	1.22	11.04	10.96	11.00	15
五大都市債	6,313	97.77	97.96	8.35	0.81	0.82	0.86	7.50	7.46	7.46	14
短期(1-3)	1,179	100.55	100.68	2.14	0.53	0.24	0.25	2.12	2.12	2.12	12
中期(3-7)	2,114	101.11	101.30	4.91	0.81	0.56	0.57	4.81	4.79	4.81	13
長期(7-)	3,020	94.35	94.56	13.17	0.93	1.26	1.33	11.76	11.68	11.67	14
その他地方公共団体	46,426	96.84	96.95	7.24	0.49	0.76	0.78	6.75	6.72	6.73	13
短期(1-3)	9,033	100.09	100.16	2.10	0.32	0.24	0.24	2.09	2.08	2.09	13
中期(3-7)	16,694	99.01	99.11	5.02	0.40	0.58	0.58	4.96	4.94	4.96	13
長期(7-)	20,700	93.67	93.82	11.27	0.64	1.16	1.20	10.46	10.39	10.41	14
その他地方債	9,951	96.70	96.81	8.63	0.78	0.94	0.91	7.80	7.76	7.79	19
短期(1-3)	1,622	100.51	100.60	2.07	0.57	0.28	0.28	2.05	2.05	2.05	16
中期(3-7)	3,360	100.46	100.58	5.17	0.78	0.65	0.65	5.06	5.04	5.06	19
長期(7-)	4,969	92.92	93.02	13.11	0.84	1.38	1.32	11.84	11.75	11.80	19
特定金融債	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
政保地方公営企業債	2,005	99.22	99.24	3.16	0.19	0.34	0.34	3.14	3.14	3.14	10
短期(1-3)	960	100.01	100.03	1.93	0.24	0.20	0.20	1.92	1.92	1.92	10
中期(3-7)	1,045	98.51	98.52	4.30	0.14	0.47	0.47	4.28	4.27	4.28	10
長期(7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
その他政保債	12,646	96.09	96.32	10.11	0.75	0.92	0.88	8.70	8.65	8.67	11
短期(1-3)	2,799	100.00	100.08	1.89	0.24	0.19	0.19	1.88	1.88	1.88	10
中期(3-7)	3,486	100.54	100.69	4.71	0.59	0.52	0.52	4.64	4.62	4.64	11
長期(7-)	6,361	91.93	92.27	16.68	1.07	1.50	1.43	14.39	14.28	14.33	11
SDGs	12,387	95.48	95.59	7.81	0.45	0.95	0.92	7.00	6.95	6.98	29

出所:NFRG

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

事業債 業種別・ポートフォリオ指標 (1/4) (2023年10月末)

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
事業債 全体	67,536	95.76	95.93	7.75	0.67	1.06	1.02	6.67	6.62	6.64	43
短期 (1-3)	19,384	99.77	99.87	2.07	0.40	0.50	0.50	2.06	2.06	2.06	38
中期 (3-7)	24,680	98.81	98.95	4.77	0.62	0.86	0.85	4.68	4.66	4.68	44
長期 (7-)	23,473	89.25	89.49	15.56	0.95	1.80	1.69	13.22	13.10	13.14	48
長期 (7-11)	9,962	95.47	95.67	8.59	0.83	1.43	1.39	8.27	8.21	8.26	56
超長期 (11-)	13,510	84.66	84.93	20.70	1.04	2.11	1.94	17.33	17.16	17.19	41
水産・農林業	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
鉱業	30	95.41	95.42	5.90	0.21	0.94	0.92	5.78	5.75	5.78	38
短期 (1-3)	10	99.06	99.07	2.37	0.08	0.48	0.48	2.37	2.37	2.37	32
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	20	93.58	93.60	7.66	0.28	1.19	1.15	7.58	7.54	7.58	41
長期 (7-11)	20	93.58	93.60	7.66	0.28	1.19	1.15	7.58	7.54	7.58	41
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
建設業	1,137	97.52	97.63	4.72	0.39	0.78	0.77	4.52	4.50	4.52	38
短期 (1-3)	355	99.58	99.64	2.02	0.23	0.41	0.41	2.01	2.01	2.01	31
中期 (3-7)	631	98.02	98.13	4.67	0.41	0.82	0.81	4.61	4.59	4.61	40
長期 (7-)	151	90.60	90.82	11.24	0.64	1.59	1.51	10.60	10.52	10.58	47
長期 (7-11)	85	93.98	94.18	8.48	0.59	1.38	1.34	8.25	8.20	8.25	52
超長期 (11-)	66	86.24	86.51	14.80	0.71	1.88	1.75	13.89	13.76	13.86	40
食料品	1,315	97.37	97.46	5.23	0.40	0.80	0.78	4.97	4.94	4.96	34
短期 (1-3)	452	99.53	99.58	2.26	0.24	0.43	0.43	2.25	2.24	2.25	29
中期 (3-7)	600	98.01	98.10	4.62	0.35	0.77	0.76	4.57	4.55	4.57	36
長期 (7-)	263	92.19	92.35	11.74	0.79	1.56	1.50	10.97	10.88	10.95	41
長期 (7-11)	143	95.08	95.28	9.02	0.68	1.30	1.27	8.73	8.67	8.72	39
超長期 (11-)	120	88.74	88.86	14.99	0.92	1.89	1.79	13.83	13.71	13.79	43
繊維製品	235	97.56	97.67	4.57	0.38	0.79	0.78	4.35	4.33	4.35	41
短期 (1-3)	60	99.62	99.68	1.90	0.23	0.41	0.41	1.89	1.89	1.89	31
中期 (3-7)	155	98.20	98.31	4.29	0.39	0.80	0.80	4.25	4.23	4.25	43
長期 (7-)	20	86.41	86.65	14.71	0.83	2.03	1.89	13.76	13.63	13.73	55
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	20	86.41	86.65	14.71	0.83	2.03	1.89	13.76	13.63	13.73	55
パルプ・紙	355	96.57	96.70	5.20	0.42	0.90	0.88	4.89	4.86	4.89	45
短期 (1-3)	135	99.53	99.63	2.12	0.36	0.53	0.53	2.11	2.10	2.11	41
中期 (3-7)	140	97.75	97.88	4.72	0.39	0.86	0.85	4.65	4.63	4.65	43
長期 (7-)	80	89.52	89.68	11.26	0.58	1.70	1.61	10.56	10.47	10.54	58
長期 (7-11)	45	92.35	92.41	7.71	0.35	1.44	1.39	7.60	7.55	7.60	64
超長期 (11-)	35	85.87	86.16	15.82	0.88	2.06	1.91	14.63	14.50	14.59	48
化学	2,281	95.70	95.80	5.79	0.41	0.99	0.95	5.36	5.32	5.35	48
短期 (1-3)	674	99.54	99.59	1.91	0.21	0.45	0.44	1.91	1.90	1.91	35
中期 (3-7)	984	97.53	97.61	4.67	0.37	0.89	0.88	4.62	4.59	4.62	47
長期 (7-)	623	88.65	88.83	11.73	0.69	1.82	1.71	10.83	10.73	10.81	64
長期 (7-11)	350	93.37	93.54	8.36	0.57	1.48	1.43	8.14	8.08	8.14	62
超長期 (11-)	273	82.59	82.80	16.05	0.83	2.31	2.10	14.74	14.58	14.69	67
医薬品	705	95.32	95.40	6.99	0.48	1.06	1.03	6.56	6.52	6.56	42
短期 (1-3)	160	99.62	99.68	2.60	0.30	0.45	0.45	2.59	2.59	2.59	27
中期 (3-7)	180	98.66	98.76	4.82	0.49	0.78	0.78	4.76	4.74	4.76	35
長期 (7-)	365	91.78	91.87	9.98	0.56	1.51	1.44	9.41	9.34	9.39	52
長期 (7-11)	265	93.36	93.39	8.00	0.43	1.35	1.31	7.87	7.82	7.87	53
超長期 (11-)	100	87.60	87.85	15.23	0.91	1.95	1.83	13.75	13.62	13.69	50

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) (2023年10月末、11月ポートフォリオ)

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
事業債 全体	68,673	95.80	95.96	7.75	0.68	1.06	1.02	6.68	6.64	6.66	43
短期 (1-3)	19,907	99.75	99.85	2.11	0.40	0.50	0.50	2.10	2.10	2.10	38
中期 (3-7)	25,042	98.79	98.93	4.82	0.63	0.87	0.86	4.74	4.72	4.74	44
長期 (7-)	23,725	89.32	89.55	15.58	0.96	1.80	1.69	13.24	13.12	13.16	48
長期 (7-11)	10,096	95.50	95.70	8.67	0.84	1.44	1.39	8.33	8.28	8.33	56
超長期 (11-)	13,629	84.74	85.00	20.69	1.04	2.11	1.94	17.33	17.16	17.19	41
水産・農林業	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
鉱業	30	95.41	95.42	5.90	0.21	0.94	0.92	5.78	5.75	5.78	38
短期 (1-3)	10	99.06	99.07	2.37	0.08	0.48	0.48	2.37	2.37	2.37	32
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	20	93.58	93.60	7.66	0.28	1.19	1.15	7.58	7.54	7.58	41
長期 (7-11)	20	93.58	93.60	7.66	0.28	1.19	1.15	7.58	7.54	7.58	41
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
建設業	1,247	97.64	97.75	4.74	0.40	0.78	0.76	4.55	4.53	4.55	37
短期 (1-3)	395	99.58	99.64	2.11	0.24	0.42	0.42	2.10	2.09	2.10	30
中期 (3-7)	687	98.07	98.18	4.70	0.42	0.81	0.80	4.64	4.62	4.64	39
長期 (7-)	165	91.22	91.44	11.21	0.68	1.57	1.49	10.57	10.48	10.55	45
長期 (7-11)	99	94.54	94.73	8.82	0.67	1.38	1.34	8.54	8.49	8.54	48
超長期 (11-)	66	86.24	86.51	14.80	0.71	1.88	1.75	13.89	13.76	13.86	40
食料品	1,365	97.38	97.48	5.33	0.42	0.81	0.79	5.06	5.03	5.06	34
短期 (1-3)	457	99.52	99.57	2.26	0.24	0.43	0.43	2.26	2.25	2.26	29
中期 (3-7)	615	98.04	98.13	4.64	0.36	0.77	0.76	4.59	4.57	4.59	36
長期 (7-)	293	92.69	92.84	11.55	0.82	1.54	1.48	10.80	10.71	10.78	41
長期 (7-11)	173	95.42	95.61	9.16	0.74	1.31	1.28	8.84	8.78	8.83	39
超長期 (11-)	120	88.74	88.86	14.99	0.92	1.89	1.79	13.83	13.71	13.79	43
繊維製品	235	97.56	97.67	4.57	0.38	0.79	0.78	4.35	4.33	4.35	41
短期 (1-3)	60	99.62	99.68	1.90	0.23	0.41	0.41	1.89	1.89	1.89	31
中期 (3-7)	155	98.20	98.31	4.29	0.39	0.80	0.80	4.25	4.23	4.25	43
長期 (7-)	20	86.41	86.65	14.71	0.83	2.03	1.89	13.76	13.63	13.73	55
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	20	86.41	86.65	14.71	0.83	2.03	1.89	13.76	13.63	13.73	55
パルプ・紙	370	96.70	96.82	5.11	0.42	0.89	0.86	4.81	4.78	4.80	45
短期 (1-3)	150	99.54	99.64	2.20	0.36	0.53	0.52	2.19	2.18	2.19	40
中期 (3-7)	140	97.75	97.88	4.72	0.39	0.86	0.85	4.65	4.63	4.65	43
長期 (7-)	80	89.52	89.68	11.26	0.58	1.70	1.61	10.56	10.47	10.54	58
長期 (7-11)	45	92.35	92.41	7.71	0.35	1.44	1.39	7.60	7.55	7.60	64
超長期 (11-)	35	85.87	86.16	15.82	0.88	2.06	1.91	14.63	14.50	14.59	48
化学	2,281	95.70	95.80	5.79	0.41	0.99	0.95	5.36	5.32	5.35	48
短期 (1-3)	679	99.52	99.58	1.92	0.21	0.45	0.45	1.91	1.91	1.91	35
中期 (3-7)	989	97.50	97.58	4.71	0.37	0.89	0.88	4.65	4.63	4.65	47
長期 (7-)	613	88.56	88.74	11.80	0.69	1.83	1.71	10.90	10.80	10.88	64
長期 (7-11)	340	93.35	93.51	8.39	0.58	1.48	1.44	8.17	8.11	8.17	62
超長期 (11-)	273	82.59	82.80	16.05	0.83	2.31	2.10	14.74	14.58	14.69	67
医薬品	705	95.32	95.40	6.99	0.48	1.06	1.03	6.56	6.52	6.56	42
短期 (1-3)	160	99.62	99.68	2.60	0.30	0.45	0.45	2.59	2.59	2.59	27
中期 (3-7)	180	98.66	98.76	4.82	0.49	0.78	0.78	4.76	4.74	4.76	35
長期 (7-)	365	91.78	91.87	9.98	0.56	1.51	1.44	9.41	9.34	9.39	52
長期 (7-11)	265	93.36	93.39	8.00	0.43	1.35	1.31	7.87	7.82	7.87	53
超長期 (11-)	100	87.60	87.85	15.23	0.91	1.95	1.83	13.75	13.62	13.69	50

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) (2023年10月末)

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
石油・石炭製品	320	95.92	96.10	6.52	0.56	1.10	1.07	6.14	6.10	6.13	50
短期 (1-3)	85	99.53	99.61	2.04	0.29	0.45	0.45	2.03	2.03	2.03	34
中期 (3-7)	85	97.13	97.24	5.35	0.42	0.94	0.93	5.27	5.24	5.27	45
長期 (7-)	150	93.19	93.47	9.72	0.79	1.59	1.54	9.14	9.07	9.12	62
長期 (7-11)	125	94.38	94.64	8.41	0.72	1.48	1.44	8.14	8.08	8.14	62
超長期 (11-)	25	87.26	87.65	16.27	1.13	2.21	2.07	14.54	14.38	14.46	63
ゴム製品	315	97.83	97.88	4.60	0.37	0.80	0.79	4.53	4.51	4.53	39
短期 (1-3)	70	99.40	99.42	2.54	0.26	0.50	0.50	2.53	2.52	2.53	33
中期 (3-7)	215	97.86	97.90	4.76	0.37	0.81	0.80	4.71	4.69	4.71	38
長期 (7-)	30	93.98	94.14	8.32	0.62	1.43	1.39	8.09	8.04	8.09	58
長期 (7-11)	30	93.98	94.14	8.32	0.62	1.43	1.39	8.09	8.04	8.09	58
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
ガラス・土石製品	230	95.58	95.72	6.26	0.45	1.04	1.00	5.84	5.80	5.84	47
短期 (1-3)	60	99.34	99.40	2.26	0.21	0.49	0.49	2.25	2.25	2.25	35
中期 (3-7)	85	97.70	97.80	4.45	0.35	0.86	0.86	4.41	4.39	4.41	47
長期 (7-)	85	90.81	91.04	10.88	0.71	1.64	1.56	10.15	10.07	10.13	55
長期 (7-11)	60	94.62	94.88	8.75	0.68	1.39	1.35	8.47	8.41	8.47	50
超長期 (11-)	25	81.67	81.83	16.00	0.80	2.35	2.13	14.82	14.66	14.77	69
鉄鋼	530	98.75	98.89	3.77	0.45	0.70	0.70	3.69	3.67	3.69	39
短期 (1-3)	270	99.67	99.78	2.06	0.33	0.46	0.46	2.05	2.05	2.05	34
中期 (3-7)	217	98.13	98.29	4.87	0.50	0.87	0.86	4.80	4.78	4.80	43
長期 (7-)	43	96.12	96.29	8.98	0.94	1.43	1.41	8.60	8.54	8.60	54
長期 (7-11)	43	96.12	96.29	8.98	0.94	1.43	1.41	8.60	8.54	8.60	54
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
非鉄金属	365	97.81	97.92	4.71	0.37	0.80	0.79	4.59	4.57	4.59	38
短期 (1-3)	100	99.31	99.35	2.07	0.16	0.46	0.46	2.06	2.05	2.06	35
中期 (3-7)	195	98.14	98.24	4.48	0.37	0.78	0.78	4.43	4.41	4.43	39
長期 (7-)	70	94.78	94.98	9.14	0.67	1.33	1.30	8.84	8.79	8.84	41
長期 (7-11)	70	94.78	94.98	9.14	0.67	1.33	1.30	8.84	8.79	8.84	41
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
金属製品	155	98.24	98.32	4.03	0.36	0.74	0.73	3.96	3.94	3.96	40
短期 (1-3)	50	99.45	99.50	2.13	0.19	0.44	0.44	2.13	2.12	2.13	31
中期 (3-7)	96	98.01	98.10	4.57	0.41	0.83	0.82	4.51	4.50	4.51	42
長期 (7-)	9	93.87	93.99	8.82	0.70	1.49	1.45	8.55	8.49	8.54	59
長期 (7-11)	9	93.87	93.99	8.82	0.70	1.49	1.45	8.55	8.49	8.54	59
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
機械	1,248	97.52	97.60	4.76	0.38	0.84	0.83	4.64	4.62	4.64	42
短期 (1-3)	355	99.39	99.44	2.18	0.25	0.51	0.51	2.17	2.17	2.17	38
中期 (3-7)	620	97.75	97.83	4.59	0.36	0.84	0.83	4.53	4.51	4.53	43
長期 (7-)	273	94.55	94.66	8.48	0.59	1.32	1.28	8.26	8.21	8.25	46
長期 (7-11)	273	94.55	94.66	8.48	0.59	1.32	1.28	8.26	8.21	8.25	46
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
電気機器	1,715	98.04	98.13	3.99	0.39	0.76	0.75	3.90	3.88	3.90	43
短期 (1-3)	735	99.71	99.78	2.11	0.38	0.47	0.47	2.10	2.09	2.10	35
中期 (3-7)	850	97.32	97.43	4.94	0.39	0.92	0.90	4.88	4.85	4.88	47
長期 (7-)	130	93.25	93.43	8.35	0.56	1.48	1.44	8.14	8.08	8.13	63
長期 (7-11)	130	93.25	93.43	8.35	0.56	1.48	1.44	8.14	8.08	8.13	63
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
輸送用機器	1,180	97.36	97.46	4.61	0.35	0.78	0.77	4.40	4.38	4.40	39
短期 (1-3)	521	99.40	99.48	2.11	0.30	0.55	0.55	2.10	2.10	2.10	43
中期 (3-7)	410	98.18	98.27	4.31	0.31	0.73	0.72	4.27	4.25	4.27	35
長期 (7-)	249	91.74	91.90	10.32	0.52	1.41	1.35	9.85	9.78	9.84	38
長期 (7-11)	159	94.56	94.71	8.37	0.44	1.17	1.14	8.19	8.14	8.19	32
超長期 (11-)	90	86.75	86.94	13.76	0.67	1.87	1.75	13.03	12.92	13.01	47

出所:NFRC

- 東証 33 業種分類を参考に NFRC で分類

事業債 業種別・ポートフォリオ指標 (2/4) (2023年10月末、11月ポートフォリオ)

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
石油・石炭製品	320	95.92	96.10	6.52	0.56	1.10	1.07	6.14	6.10	6.13	50
短期 (1-3)	85	99.53	99.61	2.04	0.29	0.45	0.45	2.03	2.03	2.03	34
中期 (3-7)	85	97.13	97.24	5.35	0.42	0.94	0.93	5.27	5.24	5.27	45
長期 (7-)	150	93.19	93.47	9.72	0.79	1.59	1.54	9.14	9.07	9.12	62
長期 (7-11)	125	94.38	94.64	8.41	0.72	1.48	1.44	8.14	8.08	8.14	62
超長期 (11-)	25	87.26	87.65	16.27	1.13	2.21	2.07	14.54	14.38	14.46	63
ゴム製品	330	97.86	97.91	4.69	0.39	0.81	0.80	4.61	4.59	4.61	39
短期 (1-3)	70	99.40	99.42	2.54	0.26	0.50	0.50	2.53	2.52	2.53	33
中期 (3-7)	225	97.91	97.95	4.76	0.38	0.81	0.80	4.71	4.69	4.71	38
長期 (7-)	35	94.47	94.63	8.54	0.70	1.44	1.40	8.27	8.21	8.27	57
長期 (7-11)	35	94.47	94.63	8.54	0.70	1.44	1.40	8.27	8.21	8.27	57
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
ガラス・土石製品	250	95.84	95.97	6.19	0.46	1.02	0.99	5.79	5.75	5.78	46
短期 (1-3)	73	99.39	99.44	2.36	0.23	0.49	0.49	2.36	2.35	2.36	33
中期 (3-7)	85	97.70	97.80	4.45	0.35	0.86	0.86	4.41	4.39	4.41	47
長期 (7-)	92	91.34	91.56	10.80	0.75	1.63	1.55	10.08	9.99	10.06	55
長期 (7-11)	67	94.93	95.18	8.87	0.74	1.40	1.37	8.56	8.50	8.56	51
超長期 (11-)	25	81.67	81.83	16.00	0.80	2.35	2.13	14.82	14.66	14.77	69
鉄鋼	530	98.75	98.89	3.77	0.45	0.70	0.70	3.69	3.67	3.69	39
短期 (1-3)	270	99.67	99.78	2.06	0.33	0.46	0.46	2.05	2.05	2.05	34
中期 (3-7)	217	98.13	98.29	4.87	0.50	0.87	0.86	4.80	4.78	4.80	43
長期 (7-)	43	96.12	96.29	8.98	0.94	1.43	1.41	8.60	8.54	8.60	54
長期 (7-11)	43	96.12	96.29	8.98	0.94	1.43	1.41	8.60	8.54	8.60	54
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
非鉄金属	355	97.76	97.86	4.81	0.38	0.81	0.80	4.69	4.67	4.69	38
短期 (1-3)	90	99.25	99.29	2.18	0.15	0.48	0.47	2.17	2.16	2.17	35
中期 (3-7)	195	98.14	98.24	4.48	0.37	0.78	0.78	4.43	4.41	4.43	39
長期 (7-)	70	94.78	94.98	9.14	0.67	1.33	1.30	8.84	8.79	8.84	41
長期 (7-11)	70	94.78	94.98	9.14	0.67	1.33	1.30	8.84	8.79	8.84	41
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
金属製品	155	98.24	98.32	4.03	0.36	0.74	0.73	3.96	3.94	3.96	40
短期 (1-3)	50	99.45	99.50	2.13	0.19	0.44	0.44	2.13	2.12	2.13	31
中期 (3-7)	96	98.01	98.10	4.57	0.41	0.83	0.82	4.51	4.50	4.51	42
長期 (7-)	9	93.87	93.99	8.82	0.70	1.49	1.45	8.55	8.49	8.54	59
長期 (7-11)	9	93.87	93.99	8.82	0.70	1.49	1.45	8.55	8.49	8.54	59
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
機械	1,283	97.54	97.62	4.80	0.39	0.85	0.83	4.68	4.66	4.68	42
短期 (1-3)	370	99.36	99.41	2.22	0.25	0.52	0.51	2.21	2.20	2.21	38
中期 (3-7)	670	97.63	97.72	4.78	0.37	0.85	0.84	4.72	4.70	4.72	42
長期 (7-)	243	94.52	94.63	8.77	0.64	1.35	1.32	8.52	8.47	8.52	47
長期 (7-11)	243	94.52	94.63	8.77	0.64	1.35	1.32	8.52	8.47	8.52	47
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
電気機器	1,965	98.06	98.16	4.40	0.47	0.83	0.82	4.29	4.27	4.29	45
短期 (1-3)	725	99.68	99.74	2.18	0.38	0.48	0.48	2.17	2.16	2.17	35
中期 (3-7)	1,025	97.58	97.69	5.02	0.46	0.93	0.92	4.95	4.93	4.95	48
長期 (7-)	215	94.91	95.10	8.95	0.87	1.55	1.51	8.59	8.52	8.58	64
長期 (7-11)	215	94.91	95.10	8.95	0.87	1.55	1.51	8.59	8.52	8.58	64
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
輸送用機器	1,180	97.36	97.46	4.61	0.35	0.78	0.77	4.40	4.38	4.40	39
短期 (1-3)	521	99.40	99.48	2.11	0.30	0.55	0.55	2.10	2.10	2.10	43
中期 (3-7)	410	98.18	98.27	4.31	0.31	0.73	0.72	4.27	4.25	4.27	35
長期 (7-)	249	91.74	91.90	10.32	0.52	1.41	1.35	9.85	9.78	9.84	38
長期 (7-11)	159	94.56	94.71	8.37	0.44	1.17	1.14	8.19	8.14	8.19	32
超長期 (11-)	90	86.75	86.94	13.76	0.67	1.87	1.75	13.03	12.92	13.01	47

出所:NFRG

- 東証 33 業種分類を参考に NFRG で分類

事業債 業種別・ポートフォリオ指標 (3/4) (2023年10月末)

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
精密機器	205	97.38	97.46	4.71	0.46	0.94	0.92	4.55	4.52	4.55	52
短期 (1-3)	85	99.61	99.69	1.80	0.25	0.46	0.46	1.79	1.79	1.79	38
中期 (3-7)	75	96.31	96.41	5.67	0.47	1.14	1.12	5.57	5.54	5.57	60
長期 (7-)	45	94.94	95.00	8.61	0.86	1.54	1.50	8.28	8.22	8.27	67
長期 (7-11)	45	94.94	95.00	8.61	0.86	1.54	1.50	8.28	8.22	8.27	67
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
その他製品	190	94.72	94.83	7.51	0.46	1.05	1.01	7.01	6.96	7.00	36
短期 (1-3)	25	99.64	99.71	1.69	0.22	0.44	0.43	1.68	1.68	1.68	37
中期 (3-7)	105	97.74	97.88	5.56	0.42	0.86	0.85	5.49	5.46	5.49	34
長期 (7-)	60	87.38	87.47	13.35	0.61	1.71	1.60	12.52	12.42	12.50	38
長期 (7-11)	15	95.58	95.66	7.85	0.55	1.17	1.14	7.68	7.64	7.68	38
超長期 (11-)	45	84.64	84.74	15.18	0.63	1.92	1.77	14.34	14.22	14.32	38
電気・ガス業	12,274	94.20	94.36	8.04	0.72	1.25	1.20	7.05	6.99	7.03	56
短期 (1-3)	2,517	99.91	100.01	2.01	0.47	0.47	0.47	2.00	1.99	2.00	36
中期 (3-7)	4,513	98.55	98.71	4.86	0.70	0.99	0.98	4.76	4.73	4.76	56
長期 (7-)	5,244	87.72	87.91	13.67	0.85	1.94	1.81	12.02	11.90	11.97	67
長期 (7-11)	2,507	94.06	94.21	8.66	0.76	1.56	1.51	8.35	8.29	8.35	67
超長期 (11-)	2,738	81.92	82.14	18.26	0.92	2.34	2.12	15.87	15.70	15.78	66
陸運業	5,936	91.16	91.33	13.71	0.98	1.40	1.30	10.67	10.58	10.59	39
短期 (1-3)	773	100.50	100.61	2.02	0.60	0.40	0.40	2.00	2.00	2.00	29
中期 (3-7)	1,505	101.51	101.69	5.22	1.16	0.81	0.82	5.06	5.04	5.06	35
長期 (7-)	3,658	84.93	85.11	19.67	0.98	1.94	1.77	15.60	15.44	15.46	43
長期 (7-11)	1,047	98.20	98.40	8.76	1.03	1.28	1.27	8.36	8.31	8.35	42
超長期 (11-)	2,611	79.61	79.78	24.05	0.96	2.26	2.02	19.18	18.97	18.97	43
海運業	88	99.18	99.42	5.19	0.94	1.01	1.00	5.00	4.97	5.00	54
短期 (1-3)	25	101.69	102.12	2.50	1.26	0.62	0.62	2.45	2.45	2.45	45
中期 (3-7)	43	97.52	97.63	5.08	0.49	1.00	0.99	5.01	4.99	5.01	54
長期 (7-)	20	99.60	99.88	8.79	1.52	1.51	1.51	8.23	8.17	8.22	67
長期 (7-11)	20	99.60	99.88	8.79	1.52	1.51	1.51	8.23	8.17	8.22	67
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
空運業	245	91.63	91.85	7.82	0.70	1.62	1.52	6.96	6.89	6.95	87
短期 (1-3)	80	99.33	99.50	2.47	0.60	0.90	0.90	2.45	2.44	2.45	74
中期 (3-7)	60	96.08	96.18	4.76	0.43	1.24	1.21	4.68	4.65	4.68	80
長期 (7-)	105	83.22	83.55	13.65	0.92	2.51	2.29	12.54	12.40	12.52	105
長期 (7-11)	20	95.43	95.87	9.63	1.20	1.76	1.72	9.06	8.99	9.06	79
超長期 (11-)	85	80.35	80.65	14.59	0.86	2.73	2.45	13.52	13.35	13.49	112
倉庫・運輸関連業	124	95.30	95.41	5.88	0.47	1.04	1.00	5.45	5.42	5.45	52
短期 (1-3)	39	100.03	100.13	1.52	0.46	0.44	0.45	1.51	1.51	1.51	40
中期 (3-7)	65	95.99	96.08	5.61	0.39	1.12	1.10	5.53	5.50	5.53	59
長期 (7-)	20	83.84	84.00	15.25	0.72	2.12	1.95	14.33	14.19	14.29	55
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	20	83.84	84.00	15.25	0.72	2.12	1.95	14.33	14.19	14.29	55
情報・通信業	2,029	96.20	96.39	4.96	0.73	1.33	1.29	4.58	4.54	4.57	89
短期 (1-3)	840	99.22	99.34	2.29	0.56	0.87	0.87	2.27	2.26	2.27	73
中期 (3-7)	771	97.33	97.50	4.87	0.64	1.18	1.17	4.78	4.75	4.78	74
長期 (7-)	418	88.05	88.39	10.48	1.22	2.67	2.50	9.38	9.26	9.35	154
長期 (7-11)	300	90.83	91.09	8.59	1.02	2.31	2.20	8.15	8.06	8.15	138
超長期 (11-)	118	80.93	81.49	15.32	1.73	3.70	3.35	12.89	12.67	12.80	201
卸売業	1,171	97.46	97.67	6.55	0.85	1.06	1.04	6.12	6.08	6.11	47
短期 (1-3)	223	100.48	100.67	1.91	0.73	0.48	0.48	1.89	1.89	1.89	39
中期 (3-7)	553	99.41	99.59	5.17	0.83	0.93	0.93	5.05	5.02	5.05	47
長期 (7-)	395	93.01	93.28	11.11	0.94	1.59	1.53	10.30	10.22	10.28	51
長期 (7-11)	240	97.49	97.79	8.62	1.02	1.34	1.32	8.24	8.19	8.24	49
超長期 (11-)	155	86.08	86.29	14.96	0.83	2.04	1.90	13.91	13.78	13.87	54

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) (2023年10月末、11月ポートフォリオ)

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
精密機器	215	97.46	97.54	4.72	0.47	0.93	0.91	4.56	4.53	4.56	51
短期 (1-3)	85	99.61	99.69	1.80	0.25	0.46	0.46	1.79	1.79	1.79	38
中期 (3-7)	85	96.65	96.74	5.57	0.48	1.10	1.08	5.48	5.45	5.48	57
長期 (7-)	45	94.94	95.00	8.61	0.86	1.54	1.50	8.28	8.22	8.27	67
長期 (7-11)	45	94.94	95.00	8.61	0.86	1.54	1.50	8.28	8.22	8.27	67
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
その他製品	190	94.72	94.83	7.51	0.46	1.05	1.01	7.01	6.96	7.00	36
短期 (1-3)	25	99.64	99.71	1.69	0.22	0.44	0.43	1.68	1.68	1.68	37
中期 (3-7)	105	97.74	97.88	5.56	0.42	0.86	0.85	5.49	5.46	5.49	34
長期 (7-)	60	87.38	87.47	13.35	0.61	1.71	1.60	12.52	12.42	12.50	38
長期 (7-11)	15	95.58	95.66	7.85	0.55	1.17	1.14	7.68	7.64	7.68	38
超長期 (11-)	45	84.64	84.74	15.18	0.63	1.92	1.77	14.34	14.22	14.32	38
電気・ガス業	12,364	94.21	94.37	8.06	0.72	1.26	1.20	7.06	7.01	7.05	56
短期 (1-3)	2,587	99.88	99.98	2.03	0.46	0.47	0.47	2.02	2.02	2.02	36
中期 (3-7)	4,483	98.54	98.70	4.90	0.71	1.00	0.99	4.80	4.77	4.80	56
長期 (7-)	5,294	87.77	87.96	13.67	0.85	1.94	1.81	12.02	11.90	11.97	67
長期 (7-11)	2,537	94.07	94.22	8.68	0.76	1.56	1.51	8.37	8.30	8.36	67
超長期 (11-)	2,758	81.98	82.20	18.26	0.93	2.34	2.12	15.87	15.70	15.78	66
陸運業	5,936	91.16	91.33	13.71	0.98	1.40	1.30	10.67	10.58	10.59	39
短期 (1-3)	773	100.50	100.61	2.02	0.60	0.40	0.40	2.00	2.00	2.00	29
中期 (3-7)	1,510	101.48	101.66	5.23	1.16	0.82	0.82	5.07	5.05	5.07	35
長期 (7-)	3,653	84.92	85.10	19.69	0.98	1.94	1.77	15.61	15.46	15.47	43
長期 (7-11)	1,062	98.24	98.44	8.81	1.04	1.28	1.27	8.40	8.35	8.40	42
超長期 (11-)	2,591	79.46	79.63	24.15	0.96	2.27	2.02	19.26	19.06	19.05	43
海運業	96	99.16	99.39	5.16	0.93	1.00	1.00	4.98	4.95	4.98	54
短期 (1-3)	25	101.69	102.12	2.50	1.26	0.62	0.62	2.45	2.45	2.45	45
中期 (3-7)	51	97.75	97.86	5.05	0.53	1.00	0.98	4.97	4.95	4.97	54
長期 (7-)	20	99.60	99.88	8.79	1.52	1.51	1.51	8.23	8.17	8.22	67
長期 (7-11)	20	99.60	99.88	8.79	1.52	1.51	1.51	8.23	8.17	8.22	67
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
空運業	245	91.63	91.85	7.82	0.70	1.62	1.52	6.96	6.89	6.95	87
短期 (1-3)	80	99.33	99.50	2.47	0.60	0.90	0.90	2.45	2.44	2.45	74
中期 (3-7)	60	96.08	96.18	4.76	0.43	1.24	1.21	4.68	4.65	4.68	80
長期 (7-)	105	83.22	83.55	13.65	0.92	2.51	2.29	12.54	12.40	12.52	105
長期 (7-11)	20	95.43	95.87	9.63	1.20	1.76	1.72	9.06	8.99	9.06	79
超長期 (11-)	85	80.35	80.65	14.59	0.86	2.73	2.45	13.52	13.35	13.49	112
倉庫・運輸関連業	131	95.41	95.52	6.08	0.51	1.07	1.04	5.65	5.61	5.64	53
短期 (1-3)	39	100.03	100.13	1.52	0.46	0.44	0.45	1.51	1.51	1.51	40
中期 (3-7)	65	95.99	96.08	5.61	0.39	1.12	1.10	5.53	5.50	5.53	59
長期 (7-)	27	87.18	87.35	13.93	0.89	2.00	1.87	12.93	12.81	12.90	60
長期 (7-11)	7	97.46	97.64	9.87	1.40	1.70	1.68	9.23	9.15	9.22	73
超長期 (11-)	20	83.84	84.00	15.25	0.72	2.12	1.95	14.33	14.19	14.29	55
情報・通信業	2,029	96.20	96.39	4.96	0.73	1.33	1.29	4.58	4.54	4.57	89
短期 (1-3)	850	99.21	99.32	2.30	0.56	0.87	0.87	2.28	2.27	2.28	73
中期 (3-7)	761	97.32	97.50	4.89	0.65	1.19	1.17	4.80	4.77	4.80	74
長期 (7-)	418	88.05	88.39	10.48	1.22	2.67	2.50	9.38	9.26	9.35	154
長期 (7-11)	300	90.83	91.09	8.59	1.02	2.31	2.20	8.15	8.06	8.15	138
超長期 (11-)	118	80.93	81.49	15.32	1.73	3.70	3.35	12.89	12.67	12.80	201
卸売業	1,196	97.46	97.67	6.56	0.85	1.06	1.04	6.13	6.09	6.13	47
短期 (1-3)	223	100.48	100.67	1.91	0.73	0.48	0.48	1.89	1.89	1.89	39
中期 (3-7)	568	99.40	99.57	5.16	0.83	0.93	0.93	5.04	5.02	5.04	47
長期 (7-)	405	93.09	93.36	11.08	0.95	1.59	1.53	10.27	10.19	10.26	51
長期 (7-11)	250	97.45	97.74	8.67	1.02	1.34	1.32	8.29	8.23	8.28	49
超長期 (11-)	155	86.08	86.29	14.96	0.83	2.04	1.90	13.91	13.78	13.87	54

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) (2023年10月末)

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
小売業	890	98.23	98.37	3.99	0.48	0.75	0.74	3.82	3.81	3.82	43
短期 (1-3)	470	99.81	99.95	2.13	0.44	0.47	0.47	2.12	2.11	2.12	35
中期 (3-7)	316	98.12	98.25	4.48	0.44	0.87	0.86	4.43	4.42	4.43	48
長期 (7-)	104	91.44	91.64	10.87	0.77	1.71	1.64	10.25	10.17	10.24	62
長期 (7-11)	64	93.47	93.59	8.54	0.70	1.59	1.55	8.27	8.21	8.27	72
超長期 (11-)	40	88.20	88.52	14.59	0.88	1.92	1.80	13.60	13.48	13.57	47
銀行業	1,550	100.42	100.73	3.62	1.18	0.99	0.99	3.51	3.49	3.51	70
短期 (1-3)	736	100.83	101.12	2.09	1.13	0.80	0.80	2.06	2.05	2.06	69
中期 (3-7)	757	99.88	100.19	4.80	1.17	1.14	1.14	4.65	4.62	4.65	72
長期 (7-)	57	102.26	103.00	7.81	1.87	1.48	1.49	7.26	7.21	7.25	76
長期 (7-11)	57	102.26	103.00	7.81	1.87	1.48	1.49	7.26	7.21	7.25	76
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
証券、商品先物取引業	982	99.47	99.77	2.61	0.90	1.02	1.01	2.57	2.55	2.57	84
短期 (1-3)	751	99.81	100.10	2.15	0.91	0.94	0.94	2.13	2.12	2.13	81
中期 (3-7)	227	98.50	98.79	4.01	0.88	1.26	1.25	3.94	3.91	3.94	92
長期 (7-)	5	92.26	92.39	8.84	0.90	1.93	1.85	8.49	8.41	8.48	100
長期 (7-11)	5	92.26	92.39	8.84	0.90	1.93	1.85	8.49	8.41	8.48	100
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
保険業	335	98.18	98.23	4.36	0.38	0.77	0.76	4.27	4.25	4.27	39
短期 (1-3)	5	99.50	99.54	1.86	0.30	0.57	0.57	1.86	1.85	1.86	48
中期 (3-7)	280	98.85	98.91	3.59	0.31	0.65	0.65	3.56	3.55	3.56	35
長期 (7-)	50	94.26	94.29	8.95	0.75	1.48	1.44	8.66	8.60	8.66	56
長期 (7-11)	50	94.26	94.29	8.95	0.75	1.48	1.44	8.66	8.60	8.66	56
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
その他金融業	5,447	97.78	97.88	4.14	0.36	0.82	0.81	4.01	3.99	4.01	47
短期 (1-3)	2,500	99.39	99.45	2.09	0.24	0.54	0.54	2.09	2.08	2.09	42
中期 (3-7)	2,291	97.53	97.65	4.88	0.42	0.93	0.92	4.81	4.78	4.81	49
長期 (7-)	656	92.53	92.69	9.32	0.64	1.56	1.49	8.92	8.86	8.92	60
長期 (7-11)	578	93.55	93.71	8.55	0.60	1.47	1.41	8.32	8.26	8.32	58
超長期 (11-)	78	85.00	85.12	15.03	0.96	2.29	2.11	13.82	13.67	13.78	75
不動産業	2,525	95.10	95.27	7.78	0.66	1.13	1.09	6.80	6.75	6.78	48
短期 (1-3)	469	99.82	99.92	1.91	0.43	0.48	0.48	1.90	1.89	1.90	39
中期 (3-7)	1,045	98.18	98.29	4.78	0.54	0.89	0.88	4.71	4.68	4.71	46
長期 (7-)	1,011	89.74	89.99	13.61	0.89	1.73	1.63	11.69	11.59	11.64	53
長期 (7-11)	558	96.32	96.61	8.77	0.90	1.38	1.36	8.41	8.35	8.40	51
超長期 (11-)	453	81.63	81.83	19.57	0.88	2.25	2.03	16.46	16.29	16.35	57
サービス業	850	87.02	87.20	5.03	0.54	3.16	2.76	4.37	4.30	4.37	239
短期 (1-3)	330	97.65	97.73	1.82	0.26	1.78	1.74	1.81	1.80	1.81	166
中期 (3-7)	305	91.58	91.71	4.98	0.43	2.62	2.40	4.95	4.90	4.95	195
長期 (7-)	215	64.21	64.66	10.02	1.12	7.46	5.90	9.13	8.88	9.12	496
長期 (7-11)	165	65.60	66.00	8.92	1.02	7.43	5.93	8.31	8.07	8.30	508
超長期 (11-)	50	59.64	60.21	13.66	1.45	7.54	5.79	12.11	11.79	12.06	452
財投機関債	20,580	96.38	96.59	9.68	0.76	0.94	0.91	8.13	8.07	8.08	20
短期 (1-3)	5,424	99.99	100.07	2.06	0.31	0.29	0.29	2.06	2.05	2.06	18
中期 (3-7)	6,307	100.28	100.44	4.62	0.67	0.60	0.60	4.54	4.53	4.54	20
長期 (7-)	8,849	91.39	91.70	17.95	1.10	1.64	1.56	14.99	14.86	14.88	22
長期 (7-11)	2,485	99.29	99.55	8.53	0.95	1.06	1.06	8.18	8.14	8.18	23
超長期 (11-)	6,364	88.31	88.63	21.62	1.15	1.89	1.78	17.98	17.81	17.82	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) (2023年10月末、11月ポートフォリオ)

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
小売業	890	98.23	98.37	3.99	0.48	0.75	0.74	3.82	3.81	3.82	43
短期 (1-3)	470	99.81	99.95	2.13	0.44	0.47	0.47	2.12	2.11	2.12	35
中期 (3-7)	316	98.12	98.25	4.48	0.44	0.87	0.86	4.43	4.42	4.43	48
長期 (7-)	104	91.44	91.64	10.87	0.77	1.71	1.64	10.25	10.17	10.24	62
長期 (7-11)	64	93.47	93.59	8.54	0.70	1.59	1.55	8.27	8.21	8.27	72
超長期 (11-)	40	88.20	88.52	14.59	0.88	1.92	1.80	13.60	13.48	13.57	47
銀行業	1,565	100.40	100.72	3.64	1.17	0.99	0.99	3.53	3.51	3.52	70
短期 (1-3)	776	100.89	101.20	2.13	1.15	0.80	0.81	2.11	2.10	2.11	68
中期 (3-7)	755	99.90	100.20	4.97	1.17	1.16	1.16	4.80	4.78	4.80	72
長期 (7-)	34	100.54	101.06	8.34	1.60	1.44	1.45	7.81	7.75	7.80	66
長期 (7-11)	34	100.54	101.06	8.34	1.60	1.44	1.45	7.81	7.75	7.80	66
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
証券、商品先物取引業	1,032	99.47	99.75	2.66	0.89	1.01	1.01	2.62	2.60	2.62	83
短期 (1-3)	781	99.80	100.09	2.18	0.90	0.93	0.93	2.15	2.14	2.15	81
中期 (3-7)	247	98.55	98.82	4.08	0.88	1.25	1.24	4.00	3.98	4.00	90
長期 (7-)	5	92.26	92.39	8.84	0.90	1.93	1.85	8.49	8.41	8.48	100
長期 (7-11)	5	92.26	92.39	8.84	0.90	1.93	1.85	8.49	8.41	8.48	100
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
保険業	335	98.18	98.23	4.36	0.38	0.77	0.76	4.27	4.25	4.27	39
短期 (1-3)	155	98.87	98.96	3.00	0.19	0.57	0.57	2.99	2.98	2.99	35
中期 (3-7)	130	98.85	98.87	4.22	0.45	0.73	0.73	4.19	4.17	4.19	37
長期 (7-)	50	94.26	94.29	8.95	0.75	1.48	1.44	8.66	8.60	8.66	56
長期 (7-11)	50	94.26	94.29	8.95	0.75	1.48	1.44	8.66	8.60	8.66	56
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
その他金融業	5,626	97.82	97.91	4.13	0.37	0.82	0.80	4.01	3.99	4.00	47
短期 (1-3)	2,612	99.39	99.45	2.13	0.24	0.54	0.54	2.12	2.12	2.12	42
中期 (3-7)	2,359	97.54	97.66	4.89	0.43	0.94	0.92	4.82	4.80	4.82	49
長期 (7-)	655	92.55	92.70	9.37	0.65	1.56	1.49	8.96	8.89	8.95	60
長期 (7-11)	577	93.57	93.73	8.60	0.61	1.47	1.42	8.36	8.30	8.36	58
超長期 (11-)	78	85.00	85.12	15.03	0.96	2.29	2.11	13.82	13.67	13.78	75
不動産業	2,625	95.15	95.31	8.03	0.69	1.15	1.11	7.02	6.97	7.00	47
短期 (1-3)	489	99.74	99.84	1.95	0.42	0.50	0.50	1.94	1.94	1.94	40
中期 (3-7)	1,025	98.18	98.29	4.82	0.55	0.89	0.88	4.74	4.72	4.74	46
長期 (7-)	1,111	90.33	90.57	13.68	0.94	1.74	1.64	11.78	11.67	11.72	52
長期 (7-11)	608	96.41	96.70	8.86	0.91	1.38	1.36	8.49	8.43	8.48	50
超長期 (11-)	503	82.97	83.17	19.50	0.97	2.24	2.04	16.40	16.23	16.28	56
サービス業	840	86.86	87.05	5.08	0.54	3.19	2.80	4.42	4.34	4.41	241
短期 (1-3)	320	97.58	97.66	1.84	0.27	1.82	1.78	1.83	1.82	1.83	170
中期 (3-7)	305	91.58	91.71	4.98	0.43	2.62	2.40	4.95	4.90	4.95	195
長期 (7-)	215	64.21	64.66	10.02	1.12	7.46	5.90	9.13	8.88	9.12	496
長期 (7-11)	165	65.60	66.00	8.92	1.02	7.43	5.93	8.31	8.07	8.30	508
超長期 (11-)	50	59.64	60.21	13.66	1.45	7.54	5.79	12.11	11.79	12.06	452
財投機関債	20,758	96.38	96.58	9.71	0.76	0.94	0.91	8.17	8.11	8.12	20
短期 (1-3)	5,452	99.97	100.04	2.11	0.30	0.30	0.30	2.10	2.09	2.10	18
中期 (3-7)	6,444	100.21	100.37	4.70	0.67	0.61	0.61	4.61	4.60	4.61	20
長期 (7-)	8,863	91.39	91.69	18.04	1.11	1.64	1.57	15.07	14.94	14.96	22
長期 (7-11)	2,430	99.38	99.64	8.62	0.98	1.07	1.06	8.26	8.21	8.25	23
超長期 (11-)	6,433	88.37	88.69	21.60	1.16	1.89	1.78	17.96	17.80	17.81	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 (2023年10月末)

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
AAA~AA 格	48,688	95.69	95.85	8.51	0.68	1.00	0.96	7.19	7.14	7.15	33
短期 (1-3)	13,295	99.85	99.94	2.09	0.35	0.41	0.41	2.08	2.08	2.08	29
中期 (3-7)	17,155	99.29	99.43	4.74	0.62	0.76	0.76	4.66	4.64	4.66	34
長期 (7-)	18,238	89.27	89.51	16.74	0.96	1.72	1.62	13.99	13.86	13.89	36
長期 (7-11)	7,000	96.68	96.89	8.56	0.81	1.25	1.23	8.25	8.20	8.25	41
超長期 (11-)	11,238	84.65	84.92	21.83	1.05	2.06	1.89	18.06	17.89	17.90	33
AAA~A 格	70,292	95.86	96.03	7.59	0.69	1.07	1.03	6.55	6.50	6.52	46
短期 (1-3)	20,542	99.76	99.87	2.07	0.44	0.54	0.54	2.06	2.05	2.06	42
中期 (3-7)	26,042	98.75	98.90	4.74	0.64	0.89	0.89	4.65	4.63	4.65	47
長期 (7-)	23,708	89.29	89.53	15.52	0.96	1.81	1.70	13.19	13.07	13.11	49
長期 (7-11)	10,084	95.44	95.64	8.60	0.83	1.44	1.40	8.27	8.21	8.27	57
超長期 (11-)	13,625	84.73	85.00	20.64	1.05	2.12	1.95	17.28	17.11	17.14	43
AAA~BBB 格	70,292	95.86	96.03	7.59	0.69	1.07	1.03	6.55	6.50	6.52	46
短期 (1-3)	20,542	99.76	99.87	2.07	0.44	0.54	0.54	2.06	2.05	2.06	42
中期 (3-7)	26,042	98.75	98.90	4.74	0.64	0.89	0.89	4.65	4.63	4.65	47
長期 (7-)	23,708	89.29	89.53	15.52	0.96	1.81	1.70	13.19	13.07	13.11	49
長期 (7-11)	10,084	95.44	95.64	8.60	0.83	1.44	1.40	8.27	8.21	8.27	57
超長期 (11-)	13,625	84.73	85.00	20.64	1.05	2.12	1.95	17.28	17.11	17.14	43
AAA~BB 格	70,292	95.86	96.03	7.59	0.69	1.07	1.03	6.55	6.50	6.52	46
短期 (1-3)	20,542	99.76	99.87	2.07	0.44	0.54	0.54	2.06	2.05	2.06	42
中期 (3-7)	26,042	98.75	98.90	4.74	0.64	0.89	0.89	4.65	4.63	4.65	47
長期 (7-)	23,708	89.29	89.53	15.52	0.96	1.81	1.70	13.19	13.07	13.11	49
長期 (7-11)	10,084	95.44	95.64	8.60	0.83	1.44	1.40	8.27	8.21	8.27	57
超長期 (11-)	13,625	84.73	85.00	20.64	1.05	2.12	1.95	17.28	17.11	17.14	43
AAA 格	10,239	96.98	97.07	5.94	0.33	0.68	0.66	5.16	5.14	5.15	23
短期 (1-3)	3,852	99.56	99.59	2.11	0.13	0.32	0.32	2.11	2.10	2.11	20
中期 (3-7)	4,340	98.46	98.54	4.67	0.33	0.65	0.64	4.61	4.60	4.61	23
長期 (7-)	2,047	89.01	89.18	15.84	0.71	1.51	1.41	12.87	12.77	12.78	29
長期 (7-11)	1,240	95.35	95.50	8.43	0.51	1.13	1.10	8.23	8.18	8.22	28
超長期 (11-)	807	79.26	79.49	27.21	1.02	2.22	1.97	21.45	21.23	21.20	30
AA 格	38,449	95.35	95.53	9.20	0.77	1.08	1.04	7.74	7.68	7.70	36
短期 (1-3)	9,443	99.97	100.08	2.08	0.45	0.44	0.44	2.07	2.07	2.07	33
中期 (3-7)	12,815	99.57	99.73	4.77	0.72	0.80	0.80	4.67	4.65	4.67	38
長期 (7-)	16,191	89.30	89.55	16.85	0.99	1.75	1.65	14.13	14.00	14.03	37
長期 (7-11)	5,760	96.97	97.19	8.59	0.88	1.28	1.26	8.26	8.20	8.25	43
超長期 (11-)	10,431	85.07	85.34	21.42	1.05	2.04	1.89	17.82	17.65	17.67	33
A 格	21,604	96.23	96.41	5.53	0.72	1.25	1.21	5.11	5.07	5.11	75
短期 (1-3)	7,247	99.60	99.75	2.04	0.59	0.78	0.78	2.02	2.02	2.02	67
中期 (3-7)	8,887	97.72	97.89	4.73	0.67	1.16	1.14	4.64	4.61	4.64	72
長期 (7-)	5,471	89.33	89.58	11.45	0.96	2.10	1.96	10.51	10.41	10.49	91
長期 (7-11)	3,084	92.60	92.82	8.68	0.88	1.89	1.78	8.31	8.24	8.31	94
超長期 (11-)	2,387	85.12	85.40	15.01	1.07	2.41	2.21	13.60	13.45	13.56	87
BBB 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
BB 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
B 格以下	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
格付なし	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

出所:NFRC

- 格付は、格付会社 4 社の最高格付をもとに分類

事業債 円建外債 格付別・ポートフォリオ指標 (2023年10月末、11月ポートフォリオ)

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
AAA~AA 格	49,632	95.73	95.90	8.50	0.68	1.00	0.96	7.19	7.14	7.16	34
短期 (1-3)	13,783	99.85	99.94	2.14	0.37	0.42	0.42	2.13	2.12	2.13	30
中期 (3-7)	17,442	99.26	99.40	4.80	0.63	0.77	0.77	4.72	4.70	4.72	35
長期 (7-)	18,408	89.32	89.56	16.77	0.96	1.73	1.62	14.02	13.90	13.93	36
長期 (7-11)	7,051	96.69	96.89	8.64	0.82	1.26	1.24	8.32	8.27	8.32	41
超長期 (11-)	11,357	84.74	85.00	21.82	1.05	2.06	1.89	18.05	17.88	17.90	33
AAA~A 格	71,622	95.89	96.06	7.60	0.69	1.08	1.04	6.56	6.51	6.54	46
短期 (1-3)	21,152	99.76	99.87	2.11	0.44	0.54	0.54	2.10	2.09	2.10	42
中期 (3-7)	26,499	98.72	98.87	4.80	0.64	0.90	0.89	4.71	4.69	4.71	47
長期 (7-)	23,972	89.36	89.60	15.53	0.97	1.81	1.70	13.20	13.08	13.13	49
長期 (7-11)	10,229	95.47	95.67	8.67	0.85	1.45	1.40	8.34	8.28	8.33	57
超長期 (11-)	13,743	84.81	85.07	20.64	1.06	2.12	1.95	17.28	17.11	17.14	43
AAA~BBB 格	71,622	95.89	96.06	7.60	0.69	1.08	1.04	6.56	6.51	6.54	46
短期 (1-3)	21,152	99.76	99.87	2.11	0.44	0.54	0.54	2.10	2.09	2.10	42
中期 (3-7)	26,499	98.72	98.87	4.80	0.64	0.90	0.89	4.71	4.69	4.71	47
長期 (7-)	23,972	89.36	89.60	15.53	0.97	1.81	1.70	13.20	13.08	13.13	49
長期 (7-11)	10,229	95.47	95.67	8.67	0.85	1.45	1.40	8.34	8.28	8.33	57
超長期 (11-)	13,743	84.81	85.07	20.64	1.06	2.12	1.95	17.28	17.11	17.14	43
AAA~BB 格	71,622	95.89	96.06	7.60	0.69	1.08	1.04	6.56	6.51	6.54	46
短期 (1-3)	21,152	99.76	99.87	2.11	0.44	0.54	0.54	2.10	2.09	2.10	42
中期 (3-7)	26,499	98.72	98.87	4.80	0.64	0.90	0.89	4.71	4.69	4.71	47
長期 (7-)	23,972	89.36	89.60	15.53	0.97	1.81	1.70	13.20	13.08	13.13	49
長期 (7-11)	10,229	95.47	95.67	8.67	0.85	1.45	1.40	8.34	8.28	8.33	57
超長期 (11-)	13,743	84.81	85.07	20.64	1.06	2.12	1.95	17.28	17.11	17.14	43
AAA 格	10,284	96.99	97.07	5.96	0.34	0.68	0.66	5.18	5.16	5.17	23
短期 (1-3)	3,897	99.54	99.57	2.16	0.13	0.32	0.32	2.15	2.15	2.15	20
中期 (3-7)	4,390	98.42	98.51	4.74	0.34	0.66	0.65	4.68	4.67	4.68	24
長期 (7-)	1,997	88.85	89.03	16.05	0.73	1.52	1.42	13.03	12.92	12.94	29
長期 (7-11)	1,190	95.36	95.51	8.48	0.53	1.13	1.11	8.28	8.23	8.27	29
超長期 (11-)	807	79.26	79.49	27.21	1.02	2.22	1.97	21.45	21.23	21.20	30
AA 格	39,348	95.41	95.59	9.17	0.77	1.09	1.04	7.72	7.66	7.68	37
短期 (1-3)	9,886	99.97	100.08	2.13	0.46	0.46	0.46	2.12	2.11	2.12	33
中期 (3-7)	13,052	99.54	99.70	4.82	0.73	0.81	0.81	4.73	4.71	4.73	38
長期 (7-)	16,411	89.37	89.62	16.86	0.99	1.75	1.65	14.14	14.01	14.05	37
長期 (7-11)	5,862	96.96	97.17	8.67	0.88	1.29	1.27	8.33	8.28	8.33	43
超長期 (11-)	10,550	85.16	85.43	21.41	1.05	2.04	1.89	17.81	17.64	17.66	33
A 格	21,991	96.25	96.43	5.56	0.71	1.24	1.20	5.15	5.11	5.14	74
短期 (1-3)	7,369	99.59	99.74	2.06	0.58	0.78	0.77	2.05	2.04	2.05	66
中期 (3-7)	9,057	97.70	97.86	4.79	0.66	1.15	1.13	4.70	4.67	4.70	71
長期 (7-)	5,564	89.48	89.73	11.43	0.97	2.09	1.96	10.50	10.40	10.48	91
長期 (7-11)	3,178	92.76	92.98	8.74	0.90	1.88	1.78	8.37	8.29	8.36	93
超長期 (11-)	2,387	85.12	85.40	15.01	1.07	2.41	2.21	13.60	13.45	13.56	87
BBB 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
BB 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
B 格以下	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
格付なし	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

出所:NFRC

- 格付は、格付会社4社の最高格付をもとに分類

事業債 最高格付別・ポートフォリオ指標 (2023年10月末)

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
AAA~AA格	47,800	95.64	95.80	8.60	0.67	0.99	0.95	7.26	7.21	7.22	32
短期(1-3)	12,883	99.87	99.96	2.09	0.35	0.39	0.39	2.08	2.07	2.08	27
中期(3-7)	16,726	99.32	99.46	4.76	0.62	0.75	0.74	4.67	4.65	4.67	33
長期(7-)	18,191	89.26	89.50	16.76	0.96	1.72	1.62	14.00	13.88	13.91	36
長期(7-11)	6,958	96.71	96.91	8.56	0.81	1.25	1.23	8.25	8.20	8.25	40
超長期(11-)	11,234	84.65	84.92	21.84	1.05	2.06	1.89	18.07	17.89	17.91	33
AAA~A格	67,536	95.76	95.93	7.75	0.67	1.06	1.02	6.67	6.62	6.64	43
短期(1-3)	19,384	99.77	99.87	2.07	0.40	0.50	0.50	2.06	2.06	2.06	38
中期(3-7)	24,680	98.81	98.95	4.77	0.62	0.86	0.85	4.68	4.66	4.68	44
長期(7-)	23,473	89.25	89.49	15.56	0.95	1.80	1.69	13.22	13.10	13.14	48
長期(7-11)	9,962	95.47	95.67	8.59	0.83	1.43	1.39	8.27	8.21	8.26	56
超長期(11-)	13,510	84.66	84.93	20.70	1.04	2.11	1.94	17.33	17.16	17.19	41
AAA~BBB格	67,536	95.76	95.93	7.75	0.67	1.06	1.02	6.67	6.62	6.64	43
短期(1-3)	19,384	99.77	99.87	2.07	0.40	0.50	0.50	2.06	2.06	2.06	38
中期(3-7)	24,680	98.81	98.95	4.77	0.62	0.86	0.85	4.68	4.66	4.68	44
長期(7-)	23,473	89.25	89.49	15.56	0.95	1.80	1.69	13.22	13.10	13.14	48
長期(7-11)	9,962	95.47	95.67	8.59	0.83	1.43	1.39	8.27	8.21	8.26	56
超長期(11-)	13,510	84.66	84.93	20.70	1.04	2.11	1.94	17.33	17.16	17.19	41
AAA~BB格	67,536	95.76	95.93	7.75	0.67	1.06	1.02	6.67	6.62	6.64	43
短期(1-3)	19,384	99.77	99.87	2.07	0.40	0.50	0.50	2.06	2.06	2.06	38
中期(3-7)	24,680	98.81	98.95	4.77	0.62	0.86	0.85	4.68	4.66	4.68	44
長期(7-)	23,473	89.25	89.49	15.56	0.95	1.80	1.69	13.22	13.10	13.14	48
長期(7-11)	9,962	95.47	95.67	8.59	0.83	1.43	1.39	8.27	8.21	8.26	56
超長期(11-)	13,510	84.66	84.93	20.70	1.04	2.11	1.94	17.33	17.16	17.19	41
AAA格	10,239	96.98	97.07	5.94	0.33	0.68	0.66	5.16	5.14	5.15	23
短期(1-3)	3,852	99.56	99.59	2.11	0.13	0.32	0.32	2.11	2.10	2.11	20
中期(3-7)	4,340	98.46	98.54	4.67	0.33	0.65	0.64	4.61	4.60	4.61	23
長期(7-)	2,047	89.01	89.18	15.84	0.71	1.51	1.41	12.87	12.77	12.78	29
長期(7-11)	1,240	95.35	95.50	8.43	0.51	1.13	1.10	8.23	8.18	8.22	28
超長期(11-)	807	79.26	79.49	27.21	1.02	2.22	1.97	21.45	21.23	21.20	30
AA格	37,562	95.27	95.46	9.33	0.77	1.08	1.04	7.84	7.78	7.80	35
短期(1-3)	9,031	100.01	100.11	2.07	0.44	0.42	0.42	2.06	2.06	2.06	31
中期(3-7)	12,386	99.62	99.78	4.79	0.72	0.78	0.78	4.69	4.67	4.69	36
長期(7-)	16,145	89.29	89.54	16.88	0.99	1.75	1.64	14.14	14.02	14.05	37
長期(7-11)	5,718	97.00	97.22	8.59	0.88	1.28	1.26	8.26	8.20	8.25	43
超長期(11-)	10,427	85.07	85.34	21.42	1.05	2.04	1.89	17.82	17.65	17.67	33
A格	19,736	96.06	96.22	5.67	0.67	1.21	1.17	5.24	5.20	5.24	70
短期(1-3)	6,501	99.58	99.71	2.05	0.51	0.71	0.71	2.04	2.03	2.04	60
中期(3-7)	7,954	97.73	97.88	4.79	0.62	1.11	1.09	4.70	4.68	4.70	67
長期(7-)	5,282	89.21	89.44	11.43	0.93	2.07	1.93	10.52	10.42	10.50	88
長期(7-11)	3,005	92.60	92.81	8.67	0.87	1.87	1.76	8.31	8.24	8.31	93
超長期(11-)	2,277	84.72	84.98	15.06	1.00	2.36	2.17	13.71	13.56	13.66	82
BBB格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
BB格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
B格以下	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
格付なし	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

出所:NFRC

- 格付は、格付会社4社の最高格付をもとに分類

事業債 最高格付別・ポートフォリオ指標 (2023年10月末、11月ポートフォリオ)

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
AAA~AA 格	48,551	95.67	95.84	8.61	0.68	1.00	0.96	7.27	7.22	7.24	33
短期 (1-3)	13,344	99.87	99.95	2.13	0.36	0.40	0.40	2.12	2.12	2.12	28
中期 (3-7)	16,857	99.29	99.43	4.82	0.63	0.76	0.75	4.73	4.71	4.73	33
長期 (7-)	18,350	89.30	89.54	16.79	0.96	1.73	1.62	14.04	13.91	13.94	36
長期 (7-11)	6,998	96.71	96.91	8.64	0.82	1.26	1.24	8.32	8.27	8.32	40
超長期 (11-)	11,352	84.74	85.00	21.82	1.05	2.06	1.89	18.06	17.88	17.90	33
AAA~A 格	68,673	95.80	95.96	7.75	0.68	1.06	1.02	6.68	6.64	6.66	43
短期 (1-3)	19,907	99.75	99.85	2.11	0.40	0.50	0.50	2.10	2.10	2.10	38
中期 (3-7)	25,042	98.79	98.93	4.82	0.63	0.87	0.86	4.74	4.72	4.74	44
長期 (7-)	23,725	89.32	89.55	15.58	0.96	1.80	1.69	13.24	13.12	13.16	48
長期 (7-11)	10,096	95.50	95.70	8.67	0.84	1.44	1.39	8.33	8.28	8.33	56
超長期 (11-)	13,629	84.74	85.00	20.69	1.04	2.11	1.94	17.33	17.16	17.19	41
AAA~BBB 格	68,673	95.80	95.96	7.75	0.68	1.06	1.02	6.68	6.64	6.66	43
短期 (1-3)	19,907	99.75	99.85	2.11	0.40	0.50	0.50	2.10	2.10	2.10	38
中期 (3-7)	25,042	98.79	98.93	4.82	0.63	0.87	0.86	4.74	4.72	4.74	44
長期 (7-)	23,725	89.32	89.55	15.58	0.96	1.80	1.69	13.24	13.12	13.16	48
長期 (7-11)	10,096	95.50	95.70	8.67	0.84	1.44	1.39	8.33	8.28	8.33	56
超長期 (11-)	13,629	84.74	85.00	20.69	1.04	2.11	1.94	17.33	17.16	17.19	41
AAA~BB 格	68,673	95.80	95.96	7.75	0.68	1.06	1.02	6.68	6.64	6.66	43
短期 (1-3)	19,907	99.75	99.85	2.11	0.40	0.50	0.50	2.10	2.10	2.10	38
中期 (3-7)	25,042	98.79	98.93	4.82	0.63	0.87	0.86	4.74	4.72	4.74	44
長期 (7-)	23,725	89.32	89.55	15.58	0.96	1.80	1.69	13.24	13.12	13.16	48
長期 (7-11)	10,096	95.50	95.70	8.67	0.84	1.44	1.39	8.33	8.28	8.33	56
超長期 (11-)	13,629	84.74	85.00	20.69	1.04	2.11	1.94	17.33	17.16	17.19	41
AAA 格	10,284	96.99	97.07	5.96	0.34	0.68	0.66	5.18	5.16	5.17	23
短期 (1-3)	3,897	99.54	99.57	2.16	0.13	0.32	0.32	2.15	2.15	2.15	20
中期 (3-7)	4,390	98.42	98.51	4.74	0.34	0.66	0.65	4.68	4.67	4.68	24
長期 (7-)	1,997	88.85	89.03	16.05	0.73	1.52	1.42	13.03	12.92	12.94	29
長期 (7-11)	1,190	95.36	95.51	8.48	0.53	1.13	1.11	8.28	8.23	8.27	29
超長期 (11-)	807	79.26	79.49	27.21	1.02	2.22	1.97	21.45	21.23	21.20	30
AA 格	38,267	95.32	95.51	9.32	0.77	1.08	1.04	7.84	7.78	7.80	35
短期 (1-3)	9,447	100.00	100.11	2.12	0.45	0.44	0.44	2.11	2.11	2.11	32
中期 (3-7)	12,467	99.60	99.76	4.84	0.72	0.79	0.79	4.75	4.73	4.75	36
長期 (7-)	16,353	89.36	89.60	16.88	0.99	1.75	1.65	14.16	14.03	14.07	37
長期 (7-11)	5,808	96.98	97.19	8.67	0.88	1.28	1.26	8.33	8.28	8.32	43
超長期 (11-)	10,545	85.16	85.42	21.41	1.05	2.04	1.89	17.81	17.64	17.66	33
A 格	20,122	96.09	96.25	5.69	0.66	1.21	1.16	5.27	5.24	5.27	69
短期 (1-3)	6,563	99.53	99.65	2.07	0.49	0.71	0.70	2.06	2.05	2.06	59
中期 (3-7)	8,184	97.75	97.90	4.84	0.63	1.10	1.09	4.75	4.72	4.75	66
長期 (7-)	5,375	89.36	89.59	11.42	0.94	2.07	1.92	10.51	10.41	10.49	88
長期 (7-11)	3,099	92.77	92.98	8.74	0.89	1.86	1.76	8.37	8.29	8.36	92
超長期 (11-)	2,277	84.72	84.98	15.06	1.00	2.36	2.17	13.71	13.56	13.66	82
BBB 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
BB 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
B 格以下	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
格付なし	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

出所:NFRG

- 格付は、格付会社4社の最高格付をもとに分類

事業債 最低格付別・ポートフォリオ指標 (2023年10月末)

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
AAA~AA格	9,123	94.98	95.10	8.12	0.55	0.95	0.90	6.69	6.65	6.66	34
短期(1-3)	2,511	99.88	99.95	2.01	0.35	0.39	0.39	2.00	2.00	2.00	28
中期(3-7)	3,798	98.61	98.72	4.67	0.47	0.76	0.76	4.60	4.59	4.60	35
長期(7-)	2,814	85.72	85.89	18.24	0.82	1.81	1.67	14.81	14.67	14.69	39
長期(7-11)	1,050	95.10	95.27	8.75	0.65	1.29	1.26	8.49	8.43	8.48	41
超長期(11-)	1,764	80.13	80.31	23.89	0.92	2.18	1.96	19.27	19.07	19.07	37
AAA~A格	64,264	95.74	95.90	7.84	0.67	1.05	1.01	6.73	6.69	6.71	42
短期(1-3)	18,183	99.78	99.88	2.07	0.39	0.49	0.49	2.06	2.05	2.06	37
中期(3-7)	23,356	98.84	98.98	4.75	0.61	0.84	0.83	4.67	4.65	4.67	42
長期(7-)	22,725	89.32	89.56	15.62	0.95	1.79	1.68	13.25	13.13	13.17	47
長期(7-11)	9,615	95.54	95.74	8.60	0.83	1.43	1.38	8.27	8.21	8.26	55
超長期(11-)	13,110	84.77	85.03	20.77	1.04	2.10	1.93	17.37	17.20	17.23	40
AAA~BBB格	67,296	95.75	95.91	7.75	0.67	1.05	1.01	6.67	6.62	6.64	43
短期(1-3)	19,384	99.77	99.87	2.07	0.40	0.50	0.50	2.06	2.06	2.06	38
中期(3-7)	24,465	98.79	98.93	4.76	0.61	0.85	0.84	4.68	4.66	4.68	43
長期(7-)	23,448	89.25	89.49	15.56	0.95	1.80	1.69	13.22	13.10	13.14	48
長期(7-11)	9,962	95.47	95.67	8.59	0.83	1.43	1.39	8.27	8.21	8.26	56
超長期(11-)	13,485	84.65	84.91	20.70	1.04	2.10	1.94	17.34	17.17	17.20	41
AAA~BB格	67,536	95.76	95.93	7.75	0.67	1.06	1.02	6.67	6.62	6.64	43
短期(1-3)	19,384	99.77	99.87	2.07	0.40	0.50	0.50	2.06	2.06	2.06	38
中期(3-7)	24,680	98.81	98.95	4.77	0.62	0.86	0.85	4.68	4.66	4.68	44
長期(7-)	23,473	89.25	89.49	15.56	0.95	1.80	1.69	13.22	13.10	13.14	48
長期(7-11)	9,962	95.47	95.67	8.59	0.83	1.43	1.39	8.27	8.21	8.26	56
超長期(11-)	13,510	84.66	84.93	20.70	1.04	2.11	1.94	17.33	17.16	17.19	41
AAA格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA格	9,123	94.98	95.10	8.12	0.55	0.95	0.90	6.69	6.65	6.66	34
短期(1-3)	2,511	99.88	99.95	2.01	0.35	0.39	0.39	2.00	2.00	2.00	28
中期(3-7)	3,798	98.61	98.72	4.67	0.47	0.76	0.76	4.60	4.59	4.60	35
長期(7-)	2,814	85.72	85.89	18.24	0.82	1.81	1.67	14.81	14.67	14.69	39
長期(7-11)	1,050	95.10	95.27	8.75	0.65	1.29	1.26	8.49	8.43	8.48	41
超長期(11-)	1,764	80.13	80.31	23.89	0.92	2.18	1.96	19.27	19.07	19.07	37
A格	55,141	95.87	96.04	7.79	0.69	1.07	1.03	6.74	6.69	6.72	43
短期(1-3)	15,672	99.76	99.86	2.08	0.40	0.51	0.50	2.07	2.06	2.07	39
中期(3-7)	19,558	98.88	99.03	4.76	0.63	0.85	0.85	4.68	4.66	4.68	43
長期(7-)	19,911	89.83	90.08	15.25	0.97	1.79	1.68	13.04	12.93	12.97	48
長期(7-11)	8,565	95.59	95.80	8.58	0.85	1.44	1.40	8.24	8.19	8.24	57
超長期(11-)	11,346	85.49	85.76	20.29	1.06	2.08	1.92	17.09	16.93	16.96	41
BBB格	3,032	95.90	96.06	5.92	0.62	1.11	1.07	5.32	5.28	5.31	60
短期(1-3)	1,201	99.72	99.84	2.13	0.52	0.64	0.64	2.12	2.11	2.12	52
中期(3-7)	1,109	97.66	97.81	5.03	0.58	1.09	1.07	4.95	4.92	4.95	62
長期(7-)	723	86.85	87.08	13.59	0.83	2.02	1.87	12.07	11.95	12.03	72
長期(7-11)	348	93.55	93.76	8.56	0.75	1.62	1.55	8.26	8.20	8.26	72
超長期(11-)	375	80.64	80.90	18.26	0.90	2.46	2.21	16.16	15.98	16.07	71
BB格	240	99.98	100.59	6.57	2.26	2.12	2.12	5.89	5.82	5.87	155
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	215	101.10	101.67	5.41	2.25	2.01	2.01	5.09	5.04	5.09	153
長期(7-)	25	90.33	91.34	16.57	2.37	3.27	3.12	13.48	13.27	13.37	168
長期(7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期(11-)	25	90.33	91.34	16.57	2.37	3.27	3.12	13.48	13.27	13.37	168
B格以下	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
格付なし	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

出所:NFRC

- 格付は、格付会社4社の最低格付をもとに分類

事業債 最低格付別・ポートフォリオ指標 (2023年10月末、11月ポートフォリオ)

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
AAA~AA 格	9,299	95.04	95.16	8.10	0.55	0.95	0.90	6.69	6.64	6.66	34
短期 (1-3)	2,711	99.80	99.88	2.11	0.34	0.40	0.40	2.10	2.10	2.10	28
中期 (3-7)	3,722	98.61	98.72	4.75	0.49	0.77	0.77	4.68	4.66	4.68	35
長期 (7-)	2,866	85.91	86.09	18.11	0.83	1.80	1.67	14.72	14.58	14.60	39
長期 (7-11)	1,095	95.18	95.35	8.80	0.66	1.29	1.26	8.53	8.47	8.52	41
超長期 (11-)	1,771	80.19	80.36	23.87	0.92	2.18	1.96	19.26	19.06	19.06	37
AAA~A 格	65,071	95.76	95.92	7.85	0.67	1.05	1.01	6.75	6.70	6.73	42
短期 (1-3)	18,665	99.76	99.85	2.11	0.39	0.49	0.49	2.10	2.09	2.10	37
中期 (3-7)	23,523	98.82	98.96	4.81	0.61	0.85	0.84	4.72	4.70	4.72	42
長期 (7-)	22,883	89.36	89.60	15.66	0.96	1.80	1.68	13.29	13.17	13.21	47
長期 (7-11)	9,654	95.55	95.75	8.66	0.84	1.43	1.39	8.33	8.27	8.32	55
超長期 (11-)	13,229	84.84	85.10	20.77	1.05	2.10	1.93	17.37	17.20	17.23	40
AAA~BBB 格	68,433	95.78	95.94	7.76	0.67	1.06	1.02	6.69	6.64	6.66	43
短期 (1-3)	19,907	99.75	99.85	2.11	0.40	0.50	0.50	2.10	2.10	2.10	38
中期 (3-7)	24,827	98.77	98.91	4.82	0.61	0.86	0.85	4.73	4.71	4.73	43
長期 (7-)	23,700	89.31	89.55	15.57	0.96	1.80	1.69	13.24	13.12	13.16	48
長期 (7-11)	10,096	95.50	95.70	8.67	0.84	1.44	1.39	8.33	8.28	8.33	56
超長期 (11-)	13,604	84.73	84.99	20.70	1.04	2.11	1.94	17.34	17.17	17.20	41
AAA~BB 格	68,673	95.80	95.96	7.75	0.68	1.06	1.02	6.68	6.64	6.66	43
短期 (1-3)	19,907	99.75	99.85	2.11	0.40	0.50	0.50	2.10	2.10	2.10	38
中期 (3-7)	25,042	98.79	98.93	4.82	0.63	0.87	0.86	4.74	4.72	4.74	44
長期 (7-)	23,725	89.32	89.55	15.58	0.96	1.80	1.69	13.24	13.12	13.16	48
長期 (7-11)	10,096	95.50	95.70	8.67	0.84	1.44	1.39	8.33	8.28	8.33	56
超長期 (11-)	13,629	84.74	85.00	20.69	1.04	2.11	1.94	17.33	17.16	17.19	41
AAA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA 格	9,299	95.04	95.16	8.10	0.55	0.95	0.90	6.69	6.64	6.66	34
短期 (1-3)	2,711	99.80	99.88	2.11	0.34	0.40	0.40	2.10	2.10	2.10	28
中期 (3-7)	3,722	98.61	98.72	4.75	0.49	0.77	0.77	4.68	4.66	4.68	35
長期 (7-)	2,866	85.91	86.09	18.11	0.83	1.80	1.67	14.72	14.58	14.60	39
長期 (7-11)	1,095	95.18	95.35	8.80	0.66	1.29	1.26	8.53	8.47	8.52	41
超長期 (11-)	1,771	80.19	80.36	23.87	0.92	2.18	1.96	19.26	19.06	19.06	37
A 格	55,772	95.88	96.05	7.81	0.69	1.07	1.03	6.76	6.71	6.74	43
短期 (1-3)	15,955	99.75	99.85	2.11	0.40	0.51	0.51	2.10	2.09	2.10	39
中期 (3-7)	19,801	98.86	99.01	4.82	0.64	0.86	0.85	4.73	4.71	4.73	43
長期 (7-)	20,017	89.85	90.10	15.31	0.98	1.79	1.69	13.10	12.98	13.02	48
長期 (7-11)	8,559	95.60	95.80	8.64	0.86	1.45	1.40	8.30	8.24	8.30	57
超長期 (11-)	11,458	85.56	85.84	20.29	1.06	2.08	1.93	17.10	16.93	16.96	41
BBB 格	3,362	96.15	96.31	5.96	0.65	1.11	1.08	5.39	5.36	5.38	60
短期 (1-3)	1,241	99.72	99.84	2.16	0.53	0.65	0.65	2.14	2.14	2.14	52
中期 (3-7)	1,304	97.83	97.97	5.06	0.61	1.08	1.06	4.98	4.95	4.98	61
長期 (7-)	818	88.07	88.30	13.16	0.88	1.97	1.83	11.71	11.60	11.67	71
長期 (7-11)	443	94.37	94.57	8.84	0.87	1.62	1.56	8.48	8.42	8.48	70
超長期 (11-)	375	80.64	80.90	18.26	0.90	2.46	2.21	16.16	15.98	16.07	71
BB 格	240	99.98	100.59	6.57	2.26	2.12	2.12	5.89	5.82	5.87	155
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	215	101.10	101.67	5.41	2.25	2.01	2.01	5.09	5.04	5.09	153
長期 (7-)	25	90.33	91.34	16.57	2.37	3.27	3.12	13.48	13.27	13.37	168
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	25	90.33	91.34	16.57	2.37	3.27	3.12	13.48	13.27	13.37	168
B 格以下	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
格付なし	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

出所:NFRC

- 格付は、格付会社 4 社の最低格付をもとに分類

事業債 R&I 格付別・ポートフォリオ指標 (2023年10月末)

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
AAA~AA 格	35,922	95.61	95.78	9.35	0.71	0.98	0.94	7.75	7.69	7.71	27
短期 (1-3)	9,293	99.88	99.95	2.06	0.29	0.34	0.34	2.05	2.05	2.05	23
中期 (3-7)	12,089	99.79	99.94	4.70	0.65	0.69	0.69	4.61	4.60	4.61	28
長期 (7-)	14,540	89.40	89.66	17.88	1.02	1.71	1.61	14.71	14.58	14.60	30
長期 (7-11)	4,918	97.89	98.12	8.67	0.90	1.18	1.16	8.32	8.27	8.32	33
超長期 (11-)	9,622	85.07	85.34	22.59	1.08	2.02	1.87	18.47	18.29	18.29	29
AAA~A 格	61,353	95.78	95.95	7.97	0.68	1.03	0.99	6.82	6.77	6.79	40
短期 (1-3)	17,341	99.82	99.91	2.08	0.38	0.45	0.45	2.07	2.06	2.07	34
中期 (3-7)	22,045	99.05	99.19	4.75	0.64	0.83	0.82	4.66	4.64	4.66	41
長期 (7-)	21,967	89.33	89.56	15.86	0.95	1.77	1.66	13.41	13.29	13.33	44
長期 (7-11)	9,072	95.96	96.16	8.59	0.82	1.35	1.33	8.27	8.22	8.27	50
超長期 (11-)	12,895	84.66	84.92	20.98	1.04	2.10	1.93	17.51	17.33	17.36	40
AAA~BBB 格	61,715	95.76	95.93	7.96	0.68	1.04	1.00	6.81	6.76	6.78	40
短期 (1-3)	17,486	99.80	99.90	2.08	0.38	0.46	0.46	2.07	2.06	2.07	35
中期 (3-7)	22,171	99.02	99.17	4.75	0.64	0.83	0.83	4.66	4.64	4.66	41
長期 (7-)	22,058	89.29	89.53	15.85	0.95	1.77	1.67	13.41	13.28	13.32	44
長期 (7-11)	9,098	95.92	96.11	8.59	0.82	1.36	1.33	8.27	8.22	8.27	50
超長期 (11-)	12,960	84.64	84.90	20.94	1.04	2.10	1.93	17.49	17.31	17.34	40
AAA~BB 格	61,715	95.76	95.93	7.96	0.68	1.04	1.00	6.81	6.76	6.78	40
短期 (1-3)	17,486	99.80	99.90	2.08	0.38	0.46	0.46	2.07	2.06	2.07	35
中期 (3-7)	22,171	99.02	99.17	4.75	0.64	0.83	0.83	4.66	4.64	4.66	41
長期 (7-)	22,058	89.29	89.53	15.85	0.95	1.77	1.67	13.41	13.28	13.32	44
長期 (7-11)	9,098	95.92	96.11	8.59	0.82	1.36	1.33	8.27	8.22	8.27	50
超長期 (11-)	12,960	84.64	84.90	20.94	1.04	2.10	1.93	17.49	17.31	17.34	40
AAA 格	755	97.80	97.87	4.40	0.23	0.63	0.62	4.27	4.26	4.27	26
短期 (1-3)	320	99.38	99.39	2.20	0.11	0.37	0.37	2.20	2.20	2.20	24
中期 (3-7)	275	98.53	98.60	4.13	0.26	0.62	0.61	4.11	4.09	4.11	26
長期 (7-)	160	93.41	93.57	9.26	0.44	1.21	1.17	8.99	8.93	8.98	29
長期 (7-11)	130	94.79	94.94	8.41	0.43	1.13	1.10	8.24	8.19	8.23	28
超長期 (11-)	30	87.44	87.62	12.92	0.45	1.63	1.52	12.51	12.41	12.50	30
AA 格	35,167	95.57	95.74	9.46	0.72	0.99	0.95	7.82	7.77	7.78	27
短期 (1-3)	8,973	99.90	99.97	2.06	0.30	0.34	0.34	2.05	2.05	2.05	23
中期 (3-7)	11,814	99.82	99.97	4.71	0.66	0.69	0.69	4.62	4.61	4.62	28
長期 (7-)	14,380	89.36	89.62	17.98	1.03	1.71	1.61	14.78	14.65	14.66	30
長期 (7-11)	4,788	97.98	98.20	8.67	0.91	1.18	1.17	8.32	8.27	8.32	33
超長期 (11-)	9,592	85.06	85.33	22.62	1.09	2.02	1.87	18.48	18.31	18.31	29
A 格	25,431	96.03	96.18	6.02	0.63	1.10	1.07	5.52	5.48	5.51	57
短期 (1-3)	8,048	99.74	99.86	2.09	0.49	0.58	0.58	2.08	2.08	2.08	46
中期 (3-7)	9,956	98.14	98.29	4.81	0.62	1.00	0.99	4.72	4.70	4.72	57
長期 (7-)	7,428	89.17	89.37	11.90	0.81	1.88	1.77	10.86	10.76	10.83	71
長期 (7-11)	4,154	93.68	93.85	8.50	0.72	1.58	1.53	8.21	8.15	8.21	71
超長期 (11-)	3,274	83.45	83.68	16.22	0.92	2.32	2.13	14.63	14.48	14.58	72
BBB 格	362	92.50	92.72	5.50	0.69	2.25	2.14	4.98	4.92	4.97	170
短期 (1-3)	145	98.46	98.64	2.04	0.53	1.74	1.73	2.03	2.02	2.03	162
中期 (3-7)	126	94.16	94.38	4.45	0.78	2.38	2.28	4.38	4.33	4.38	190
長期 (7-)	91	80.69	81.01	12.47	0.81	3.05	2.71	11.67	11.52	11.65	155
長期 (7-11)	26	79.81	80.01	7.97	0.65	3.96	3.41	7.72	7.59	7.72	263
超長期 (11-)	65	81.04	81.40	14.27	0.87	2.69	2.43	13.23	13.07	13.20	112
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	5,821	95.74	95.90	5.49	0.61	1.27	1.20	5.13	5.10	5.13	74
短期 (1-3)	1,898	99.50	99.62	2.05	0.56	0.83	0.82	2.04	2.03	2.04	71
中期 (3-7)	2,509	96.93	97.05	4.95	0.45	1.10	1.07	4.88	4.85	4.88	63
長期 (7-)	1,414	88.59	88.89	11.08	0.96	2.25	2.02	10.29	10.18	10.27	100
長期 (7-11)	864	90.74	91.04	8.67	0.94	2.23	2.00	8.26	8.18	8.26	116
超長期 (11-)	550	85.22	85.51	14.88	0.98	2.28	2.06	13.68	13.54	13.64	72

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 (2023年10月末、11月ポートフォリオ)

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
AAA~AA 格	36,379	95.63	95.80	9.37	0.71	0.98	0.94	7.77	7.72	7.73	27
短期 (1-3)	9,561	99.85	99.92	2.11	0.29	0.35	0.35	2.11	2.10	2.11	23
中期 (3-7)	12,127	99.77	99.92	4.76	0.66	0.69	0.69	4.68	4.66	4.68	28
長期 (7-)	14,691	89.47	89.73	17.89	1.03	1.71	1.61	14.73	14.60	14.62	30
長期 (7-11)	4,971	97.91	98.13	8.74	0.91	1.18	1.17	8.39	8.34	8.38	33
超長期 (11-)	9,720	85.15	85.43	22.57	1.09	2.02	1.87	18.46	18.28	18.28	29
AAA~A 格	62,456	95.82	95.98	7.98	0.68	1.03	1.00	6.84	6.79	6.81	40
短期 (1-3)	17,869	99.79	99.89	2.12	0.38	0.46	0.46	2.11	2.10	2.11	34
中期 (3-7)	22,374	99.02	99.17	4.81	0.64	0.83	0.83	4.72	4.70	4.72	41
長期 (7-)	22,213	89.39	89.63	15.88	0.96	1.77	1.67	13.43	13.31	13.35	44
長期 (7-11)	9,199	95.99	96.18	8.67	0.83	1.36	1.33	8.34	8.28	8.34	50
超長期 (11-)	13,014	84.73	85.00	20.97	1.05	2.10	1.93	17.51	17.33	17.36	40
AAA~BBB 格	62,818	95.80	95.96	7.96	0.68	1.04	1.00	6.83	6.78	6.80	40
短期 (1-3)	18,014	99.78	99.88	2.12	0.38	0.47	0.47	2.11	2.10	2.11	35
中期 (3-7)	22,500	98.99	99.14	4.81	0.65	0.84	0.84	4.72	4.70	4.72	42
長期 (7-)	22,304	89.36	89.59	15.86	0.96	1.78	1.67	13.43	13.30	13.34	45
長期 (7-11)	9,225	95.94	96.13	8.67	0.83	1.37	1.34	8.34	8.28	8.33	50
超長期 (11-)	13,079	84.72	84.98	20.94	1.05	2.10	1.93	17.48	17.31	17.34	40
AAA~BB 格	62,818	95.80	95.96	7.96	0.68	1.04	1.00	6.83	6.78	6.80	40
短期 (1-3)	18,014	99.78	99.88	2.12	0.38	0.47	0.47	2.11	2.10	2.11	35
中期 (3-7)	22,500	98.99	99.14	4.81	0.65	0.84	0.84	4.72	4.70	4.72	42
長期 (7-)	22,304	89.36	89.59	15.86	0.96	1.78	1.67	13.43	13.30	13.34	45
長期 (7-11)	9,225	95.94	96.13	8.67	0.83	1.37	1.34	8.34	8.28	8.33	50
超長期 (11-)	13,079	84.72	84.98	20.94	1.05	2.10	1.93	17.48	17.31	17.34	40
AAA 格	755	97.80	97.87	4.40	0.23	0.63	0.62	4.27	4.26	4.27	26
短期 (1-3)	320	99.38	99.39	2.20	0.11	0.37	0.37	2.20	2.20	2.20	24
中期 (3-7)	275	98.53	98.60	4.13	0.26	0.62	0.61	4.11	4.09	4.11	26
長期 (7-)	160	93.41	93.57	9.26	0.44	1.21	1.17	8.99	8.93	8.98	29
長期 (7-11)	130	94.79	94.94	8.41	0.43	1.13	1.10	8.24	8.19	8.23	28
超長期 (11-)	30	87.44	87.62	12.92	0.45	1.63	1.52	12.51	12.41	12.50	30
AA 格	35,624	95.58	95.76	9.47	0.72	0.99	0.95	7.85	7.79	7.81	27
短期 (1-3)	9,241	99.86	99.93	2.11	0.30	0.35	0.35	2.10	2.10	2.10	23
中期 (3-7)	11,852	99.80	99.95	4.78	0.67	0.70	0.69	4.69	4.67	4.69	28
長期 (7-)	14,531	89.43	89.68	17.99	1.04	1.72	1.62	14.80	14.66	14.68	30
長期 (7-11)	4,841	97.99	98.22	8.75	0.93	1.19	1.18	8.39	8.34	8.38	33
超長期 (11-)	9,690	85.15	85.42	22.60	1.09	2.02	1.87	18.47	18.30	18.30	29
A 格	26,076	96.08	96.23	6.03	0.64	1.10	1.07	5.54	5.50	5.53	57
短期 (1-3)	8,308	99.73	99.86	2.12	0.49	0.59	0.58	2.11	2.10	2.11	46
中期 (3-7)	10,247	98.13	98.28	4.87	0.63	1.00	1.00	4.78	4.75	4.78	57
長期 (7-)	7,522	89.25	89.44	11.93	0.82	1.89	1.78	10.89	10.79	10.86	71
長期 (7-11)	4,228	93.72	93.88	8.58	0.74	1.58	1.53	8.28	8.22	8.28	70
超長期 (11-)	3,294	83.50	83.72	16.24	0.93	2.32	2.13	14.64	14.49	14.58	72
BBB 格	362	92.50	92.72	5.50	0.69	2.25	2.14	4.98	4.92	4.97	170
短期 (1-3)	145	98.46	98.64	2.04	0.53	1.74	1.73	2.03	2.02	2.03	162
中期 (3-7)	126	94.16	94.38	4.45	0.78	2.38	2.28	4.38	4.33	4.38	190
長期 (7-)	91	80.69	81.01	12.47	0.81	3.05	2.71	11.67	11.52	11.65	155
長期 (7-11)	26	79.81	80.01	7.97	0.65	3.96	3.41	7.72	7.59	7.72	263
超長期 (11-)	65	81.04	81.40	14.27	0.87	2.69	2.43	13.23	13.07	13.20	112
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	5,856	95.76	95.92	5.51	0.61	1.27	1.20	5.15	5.11	5.14	74
短期 (1-3)	1,893	99.50	99.61	2.06	0.56	0.83	0.83	2.05	2.04	2.05	71
中期 (3-7)	2,542	96.95	97.07	4.96	0.45	1.10	1.07	4.88	4.86	4.88	63
長期 (7-)	1,421	88.64	88.94	11.09	0.96	2.25	2.02	10.29	10.19	10.27	100
長期 (7-11)	871	90.80	91.10	8.69	0.95	2.23	2.00	8.28	8.20	8.28	116
超長期 (11-)	550	85.22	85.51	14.88	0.98	2.28	2.06	13.68	13.54	13.64	72

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 (2023年10月末)

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
AAA~AA 格	26,889	96.20	96.32	6.30	0.48	0.89	0.86	5.61	5.57	5.60	37
短期 (1-3)	8,839	99.72	99.80	2.09	0.31	0.42	0.42	2.08	2.08	2.08	30
中期 (3-7)	10,631	98.38	98.49	4.72	0.45	0.78	0.77	4.65	4.63	4.65	36
長期 (7-)	7,419	88.87	89.05	13.59	0.72	1.68	1.58	11.84	11.74	11.79	48
長期 (7-11)	4,120	94.62	94.79	8.42	0.60	1.32	1.29	8.19	8.14	8.19	47
超長期 (11-)	3,299	81.69	81.89	20.05	0.87	2.21	2.00	17.12	16.94	17.00	48
AAA~A 格	39,274	95.98	96.11	6.18	0.55	1.03	0.99	5.56	5.53	5.55	50
短期 (1-3)	12,603	99.65	99.74	2.09	0.37	0.53	0.53	2.08	2.08	2.08	41
中期 (3-7)	15,537	98.15	98.28	4.76	0.53	0.91	0.90	4.68	4.66	4.68	48
長期 (7-)	11,135	88.78	88.98	12.79	0.79	1.85	1.73	11.34	11.24	11.30	65
長期 (7-11)	6,286	93.55	93.73	8.52	0.70	1.56	1.49	8.24	8.18	8.23	67
超長期 (11-)	4,849	82.61	82.83	18.32	0.92	2.29	2.08	15.90	15.73	15.81	62
AAA~BBB 格	39,274	95.98	96.11	6.18	0.55	1.03	0.99	5.56	5.53	5.55	50
短期 (1-3)	12,603	99.65	99.74	2.09	0.37	0.53	0.53	2.08	2.08	2.08	41
中期 (3-7)	15,537	98.15	98.28	4.76	0.53	0.91	0.90	4.68	4.66	4.68	48
長期 (7-)	11,135	88.78	88.98	12.79	0.79	1.85	1.73	11.34	11.24	11.30	65
長期 (7-11)	6,286	93.55	93.73	8.52	0.70	1.56	1.49	8.24	8.18	8.23	67
超長期 (11-)	4,849	82.61	82.83	18.32	0.92	2.29	2.08	15.90	15.73	15.81	62
AAA~BB 格	39,274	95.98	96.11	6.18	0.55	1.03	0.99	5.56	5.53	5.55	50
短期 (1-3)	12,603	99.65	99.74	2.09	0.37	0.53	0.53	2.08	2.08	2.08	41
中期 (3-7)	15,537	98.15	98.28	4.76	0.53	0.91	0.90	4.68	4.66	4.68	48
長期 (7-)	11,135	88.78	88.98	12.79	0.79	1.85	1.73	11.34	11.24	11.30	65
長期 (7-11)	6,286	93.55	93.73	8.52	0.70	1.56	1.49	8.24	8.18	8.23	67
超長期 (11-)	4,849	82.61	82.83	18.32	0.92	2.29	2.08	15.90	15.73	15.81	62
AAA 格	9,894	96.91	96.99	6.05	0.34	0.69	0.66	5.25	5.22	5.23	23
短期 (1-3)	3,642	99.57	99.60	2.11	0.13	0.32	0.32	2.11	2.10	2.11	20
中期 (3-7)	4,205	98.45	98.53	4.69	0.34	0.65	0.64	4.63	4.62	4.63	23
長期 (7-)	2,047	89.01	89.18	15.84	0.71	1.51	1.41	12.87	12.77	12.78	29
長期 (7-11)	1,240	95.35	95.50	8.43	0.51	1.13	1.10	8.23	8.18	8.22	28
超長期 (11-)	807	79.26	79.49	27.21	1.02	2.22	1.97	21.45	21.23	21.20	30
AA 格	16,996	95.79	95.93	6.45	0.56	1.00	0.97	5.82	5.79	5.81	45
短期 (1-3)	5,197	99.84	99.95	2.07	0.44	0.49	0.49	2.06	2.06	2.06	37
中期 (3-7)	6,426	98.34	98.46	4.74	0.53	0.86	0.86	4.66	4.64	4.66	44
長期 (7-)	5,372	88.81	89.00	12.74	0.72	1.75	1.64	11.45	11.35	11.41	55
長期 (7-11)	2,880	94.31	94.48	8.42	0.64	1.41	1.37	8.18	8.12	8.18	55
超長期 (11-)	2,492	82.47	82.67	17.73	0.82	2.21	2.01	15.77	15.61	15.69	54
A 格	12,385	95.49	95.66	5.91	0.71	1.35	1.30	5.46	5.42	5.46	80
短期 (1-3)	3,764	99.47	99.59	2.10	0.52	0.80	0.80	2.09	2.08	2.09	68
中期 (3-7)	4,906	97.66	97.82	4.84	0.69	1.21	1.18	4.74	4.71	4.74	76
長期 (7-)	3,716	88.62	88.84	11.18	0.94	2.20	2.03	10.34	10.24	10.32	100
長期 (7-11)	2,166	91.51	91.71	8.70	0.88	2.03	1.90	8.32	8.24	8.32	106
超長期 (11-)	1,550	84.57	84.82	14.64	1.02	2.45	2.24	13.40	13.25	13.36	91
BBB 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
BB 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
B 格以下	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
格付なし	28,262	95.47	95.67	9.92	0.84	1.09	1.05	8.21	8.15	8.16	33
短期 (1-3)	6,781	100.01	100.12	2.04	0.46	0.44	0.44	2.03	2.02	2.03	33
中期 (3-7)	9,143	99.92	100.09	4.79	0.77	0.77	0.77	4.69	4.67	4.69	35
長期 (7-)	12,338	89.67	89.94	18.06	1.09	1.75	1.65	14.89	14.76	14.78	32
長期 (7-11)	3,676	98.75	99.00	8.73	1.05	1.22	1.21	8.32	8.27	8.32	37
超長期 (11-)	8,662	85.82	86.10	22.02	1.11	2.01	1.86	18.10	17.93	17.94	30

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 (2023年10月末、11月ポートフォリオ)

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
AAA~AA 格	27,506	96.24	96.37	6.33	0.49	0.89	0.86	5.64	5.60	5.63	37
短期 (1-3)	9,147	99.74	99.82	2.14	0.33	0.43	0.43	2.13	2.12	2.13	31
中期 (3-7)	10,838	98.36	98.47	4.78	0.46	0.79	0.78	4.71	4.69	4.71	36
長期 (7-)	7,521	88.94	89.13	13.67	0.74	1.69	1.59	11.91	11.81	11.86	48
長期 (7-11)	4,152	94.63	94.79	8.51	0.61	1.33	1.30	8.27	8.22	8.27	47
超長期 (11-)	3,369	81.94	82.14	20.03	0.89	2.21	2.00	17.09	16.91	16.97	49
AAA~A 格	39,903	96.00	96.14	6.21	0.56	1.04	1.00	5.59	5.56	5.58	50
短期 (1-3)	12,885	99.64	99.73	2.13	0.37	0.54	0.53	2.12	2.11	2.12	41
中期 (3-7)	15,787	98.14	98.27	4.81	0.53	0.92	0.91	4.73	4.71	4.73	48
長期 (7-)	11,231	88.84	89.03	12.85	0.80	1.86	1.73	11.40	11.30	11.36	65
長期 (7-11)	6,312	93.57	93.74	8.58	0.71	1.57	1.50	8.30	8.24	8.29	67
超長期 (11-)	4,919	82.77	82.99	18.33	0.93	2.28	2.08	15.90	15.73	15.81	62
AAA~BBB 格	39,903	96.00	96.14	6.21	0.56	1.04	1.00	5.59	5.56	5.58	50
短期 (1-3)	12,885	99.64	99.73	2.13	0.37	0.54	0.53	2.12	2.11	2.12	41
中期 (3-7)	15,787	98.14	98.27	4.81	0.53	0.92	0.91	4.73	4.71	4.73	48
長期 (7-)	11,231	88.84	89.03	12.85	0.80	1.86	1.73	11.40	11.30	11.36	65
長期 (7-11)	6,312	93.57	93.74	8.58	0.71	1.57	1.50	8.30	8.24	8.29	67
超長期 (11-)	4,919	82.77	82.99	18.33	0.93	2.28	2.08	15.90	15.73	15.81	62
AAA~BB 格	39,903	96.00	96.14	6.21	0.56	1.04	1.00	5.59	5.56	5.58	50
短期 (1-3)	12,885	99.64	99.73	2.13	0.37	0.54	0.53	2.12	2.11	2.12	41
中期 (3-7)	15,787	98.14	98.27	4.81	0.53	0.92	0.91	4.73	4.71	4.73	48
長期 (7-)	11,231	88.84	89.03	12.85	0.80	1.86	1.73	11.40	11.30	11.36	65
長期 (7-11)	6,312	93.57	93.74	8.58	0.71	1.57	1.50	8.30	8.24	8.29	67
超長期 (11-)	4,919	82.77	82.99	18.33	0.93	2.28	2.08	15.90	15.73	15.81	62
AAA 格	9,939	96.91	97.00	6.06	0.34	0.69	0.67	5.27	5.24	5.25	23
短期 (1-3)	3,687	99.54	99.57	2.16	0.13	0.32	0.32	2.16	2.15	2.16	20
中期 (3-7)	4,255	98.41	98.50	4.76	0.34	0.66	0.65	4.70	4.69	4.70	23
長期 (7-)	1,997	88.85	89.03	16.05	0.73	1.52	1.42	13.03	12.92	12.94	29
長期 (7-11)	1,190	95.36	95.51	8.48	0.53	1.13	1.11	8.28	8.23	8.27	29
超長期 (11-)	807	79.26	79.49	27.21	1.02	2.22	1.97	21.45	21.23	21.20	30
AA 格	17,568	95.87	96.01	6.48	0.58	1.01	0.98	5.85	5.81	5.84	45
短期 (1-3)	5,460	99.87	99.99	2.12	0.47	0.50	0.50	2.11	2.10	2.11	38
中期 (3-7)	6,583	98.33	98.46	4.79	0.54	0.87	0.87	4.71	4.69	4.71	45
長期 (7-)	5,524	88.98	89.16	12.81	0.74	1.75	1.65	11.51	11.41	11.47	54
長期 (7-11)	2,962	94.34	94.50	8.52	0.65	1.41	1.37	8.27	8.22	8.27	54
超長期 (11-)	2,562	82.78	82.98	17.76	0.85	2.21	2.01	15.77	15.61	15.69	54
A 格	12,397	95.47	95.64	5.94	0.70	1.35	1.30	5.49	5.45	5.49	79
短期 (1-3)	3,738	99.39	99.50	2.12	0.48	0.79	0.79	2.10	2.10	2.10	67
中期 (3-7)	4,949	97.65	97.81	4.88	0.69	1.21	1.18	4.78	4.75	4.78	75
長期 (7-)	3,710	88.62	88.85	11.20	0.94	2.20	2.04	10.36	10.25	10.34	100
長期 (7-11)	2,160	91.53	91.73	8.73	0.89	2.04	1.90	8.35	8.27	8.34	106
超長期 (11-)	1,550	84.57	84.82	14.64	1.02	2.45	2.24	13.40	13.25	13.36	91
BBB 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
BB 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
B 格以下	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
格付なし	28,771	95.50	95.71	9.90	0.84	1.09	1.05	8.20	8.14	8.15	34
短期 (1-3)	7,021	99.97	100.08	2.08	0.45	0.44	0.44	2.07	2.06	2.07	33
中期 (3-7)	9,255	99.89	100.07	4.85	0.78	0.78	0.78	4.75	4.73	4.75	36
長期 (7-)	12,495	89.75	90.02	18.02	1.10	1.75	1.65	14.87	14.74	14.76	33
長期 (7-11)	3,784	98.71	98.96	8.81	1.07	1.24	1.23	8.39	8.34	8.39	38
超長期 (11-)	8,710	85.85	86.13	22.03	1.11	2.01	1.86	18.11	17.93	17.94	30

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 (2023年10月末)

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
AAA~AA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AAA~A 格	22,493	96.35	96.53	8.83	0.73	0.97	0.94	7.48	7.42	7.44	29
短期 (1-3)	6,233	99.95	100.04	2.08	0.35	0.36	0.36	2.07	2.07	2.07	24
中期 (3-7)	7,435	99.74	99.88	4.59	0.63	0.68	0.68	4.51	4.49	4.51	28
長期 (7-)	8,826	90.94	91.24	17.17	1.07	1.71	1.62	14.40	14.27	14.30	33
長期 (7-11)	3,011	97.27	97.49	8.63	0.84	1.22	1.20	8.30	8.25	8.30	37
超長期 (11-)	5,814	87.67	88.01	21.60	1.20	1.99	1.87	17.89	17.72	17.74	30
AAA~BBB 格	24,941	96.33	96.52	8.60	0.73	0.98	0.95	7.31	7.26	7.27	31
短期 (1-3)	7,002	99.93	100.01	2.08	0.36	0.37	0.37	2.07	2.07	2.07	25
中期 (3-7)	8,511	99.59	99.74	4.67	0.66	0.74	0.74	4.58	4.56	4.58	33
長期 (7-)	9,428	90.71	91.01	16.98	1.06	1.73	1.64	14.28	14.15	14.18	35
長期 (7-11)	3,288	97.05	97.27	8.62	0.83	1.24	1.22	8.30	8.25	8.30	38
超長期 (11-)	6,139	87.32	87.66	21.46	1.19	2.02	1.89	17.83	17.66	17.68	32
AAA~BB 格	24,941	96.33	96.52	8.60	0.73	0.98	0.95	7.31	7.26	7.27	31
短期 (1-3)	7,002	99.93	100.01	2.08	0.36	0.37	0.37	2.07	2.07	2.07	25
中期 (3-7)	8,511	99.59	99.74	4.67	0.66	0.74	0.74	4.58	4.56	4.58	33
長期 (7-)	9,428	90.71	91.01	16.98	1.06	1.73	1.64	14.28	14.15	14.18	35
長期 (7-11)	3,288	97.05	97.27	8.62	0.83	1.24	1.22	8.30	8.25	8.30	38
超長期 (11-)	6,139	87.32	87.66	21.46	1.19	2.02	1.89	17.83	17.66	17.68	32
AAA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
A 格	22,493	96.35	96.53	8.83	0.73	0.97	0.94	7.48	7.42	7.44	29
短期 (1-3)	6,233	99.95	100.04	2.08	0.35	0.36	0.36	2.07	2.07	2.07	24
中期 (3-7)	7,435	99.74	99.88	4.59	0.63	0.68	0.68	4.51	4.49	4.51	28
長期 (7-)	8,826	90.94	91.24	17.17	1.07	1.71	1.62	14.40	14.27	14.30	33
長期 (7-11)	3,011	97.27	97.49	8.63	0.84	1.22	1.20	8.30	8.25	8.30	37
超長期 (11-)	5,814	87.67	88.01	21.60	1.20	1.99	1.87	17.89	17.72	17.74	30
BBB 格	2,448	96.19	96.38	6.45	0.72	1.10	1.07	5.76	5.72	5.75	55
短期 (1-3)	770	99.78	99.85	2.10	0.38	0.44	0.44	2.09	2.08	2.09	32
中期 (3-7)	1,076	98.59	98.81	5.23	0.87	1.14	1.14	5.09	5.06	5.09	67
長期 (7-)	602	87.33	87.58	14.22	0.89	1.97	1.83	12.45	12.33	12.40	65
長期 (7-11)	277	94.65	94.87	8.56	0.74	1.44	1.40	8.26	8.21	8.26	58
超長期 (11-)	325	81.08	81.38	19.05	1.02	2.50	2.26	16.62	16.43	16.51	72
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	42,596	95.43	95.58	7.25	0.64	1.10	1.06	6.29	6.24	6.27	50
短期 (1-3)	12,381	99.68	99.79	2.07	0.43	0.57	0.57	2.06	2.05	2.06	46
中期 (3-7)	16,169	98.39	98.53	4.82	0.60	0.93	0.92	4.74	4.71	4.73	49
長期 (7-)	14,045	88.27	88.47	14.60	0.87	1.85	1.72	12.49	12.37	12.42	57
長期 (7-11)	6,674	94.69	94.89	8.58	0.83	1.53	1.47	8.25	8.19	8.25	64
超長期 (11-)	7,371	82.45	82.65	20.05	0.92	2.19	1.99	16.89	16.72	16.76	49

出所:NFRFC

- 格付は、Moody's の格付をもとに NFRFC で分類

事業債 Moody's 格付別・ポートフォリオ指標 (2023年10月末、11月ポートフォリオ)

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
AAA~AA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AAA~A 格	22,773	96.34	96.53	8.89	0.73	0.98	0.95	7.53	7.48	7.50	29
短期 (1-3)	6,331	99.94	100.03	2.12	0.36	0.37	0.37	2.11	2.11	2.11	24
中期 (3-7)	7,474	99.69	99.83	4.65	0.63	0.69	0.69	4.57	4.55	4.57	28
長期 (7-)	8,968	91.00	91.30	17.20	1.09	1.72	1.63	14.43	14.30	14.33	33
長期 (7-11)	3,052	97.29	97.52	8.71	0.86	1.23	1.21	8.38	8.33	8.37	37
超長期 (11-)	5,916	87.76	88.10	21.58	1.20	2.00	1.87	17.88	17.71	17.73	31
AAA~BBB 格	25,490	96.35	96.53	8.63	0.73	0.99	0.96	7.35	7.30	7.32	32
短期 (1-3)	7,110	99.92	100.01	2.12	0.36	0.37	0.37	2.11	2.11	2.11	25
中期 (3-7)	8,715	99.54	99.69	4.73	0.66	0.75	0.75	4.65	4.63	4.65	33
長期 (7-)	9,665	90.84	91.13	16.95	1.08	1.73	1.64	14.26	14.13	14.16	35
長期 (7-11)	3,424	97.08	97.30	8.73	0.86	1.26	1.24	8.39	8.34	8.39	40
超長期 (11-)	6,241	87.41	87.75	21.45	1.19	2.02	1.89	17.82	17.65	17.67	33
AAA~BB 格	25,490	96.35	96.53	8.63	0.73	0.99	0.96	7.35	7.30	7.32	32
短期 (1-3)	7,110	99.92	100.01	2.12	0.36	0.37	0.37	2.11	2.11	2.11	25
中期 (3-7)	8,715	99.54	99.69	4.73	0.66	0.75	0.75	4.65	4.63	4.65	33
長期 (7-)	9,665	90.84	91.13	16.95	1.08	1.73	1.64	14.26	14.13	14.16	35
長期 (7-11)	3,424	97.08	97.30	8.73	0.86	1.26	1.24	8.39	8.34	8.39	40
超長期 (11-)	6,241	87.41	87.75	21.45	1.19	2.02	1.89	17.82	17.65	17.67	33
AAA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
A 格	22,773	96.34	96.53	8.89	0.73	0.98	0.95	7.53	7.48	7.50	29
短期 (1-3)	6,331	99.94	100.03	2.12	0.36	0.37	0.37	2.11	2.11	2.11	24
中期 (3-7)	7,474	99.69	99.83	4.65	0.63	0.69	0.69	4.57	4.55	4.57	28
長期 (7-)	8,968	91.00	91.30	17.20	1.09	1.72	1.63	14.43	14.30	14.33	33
長期 (7-11)	3,052	97.29	97.52	8.71	0.86	1.23	1.21	8.38	8.33	8.37	37
超長期 (11-)	5,916	87.76	88.10	21.58	1.20	2.00	1.87	17.88	17.71	17.73	31
BBB 格	2,718	96.40	96.58	6.49	0.74	1.11	1.08	5.84	5.80	5.83	55
短期 (1-3)	780	99.77	99.84	2.11	0.38	0.44	0.44	2.10	2.09	2.10	32
中期 (3-7)	1,241	98.61	98.82	5.24	0.86	1.13	1.12	5.11	5.08	5.11	66
長期 (7-)	697	88.69	88.94	13.63	0.95	1.92	1.80	11.98	11.86	11.93	65
長期 (7-11)	372	95.34	95.55	8.89	0.89	1.49	1.46	8.52	8.46	8.52	60
超長期 (11-)	325	81.08	81.38	19.05	1.02	2.50	2.26	16.62	16.43	16.51	72
BB 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
B 格以下	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
格付なし	43,183	95.47	95.62	7.23	0.64	1.10	1.06	6.28	6.24	6.26	50
短期 (1-3)	12,796	99.66	99.77	2.11	0.42	0.58	0.57	2.10	2.09	2.10	45
中期 (3-7)	16,327	98.39	98.53	4.87	0.61	0.93	0.92	4.79	4.76	4.79	49
長期 (7-)	14,060	88.27	88.47	14.63	0.88	1.85	1.73	12.52	12.40	12.45	57
長期 (7-11)	6,672	94.69	94.88	8.63	0.83	1.53	1.47	8.30	8.24	8.30	64
超長期 (11-)	7,388	82.48	82.68	20.05	0.92	2.19	1.99	16.89	16.72	16.76	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 (2023年10月末)

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
AAA~AA 格	800	85.15	85.43	18.54	0.95	1.75	1.59	14.50	14.37	14.40	37
短期 (1-3)	30	102.16	102.56	2.23	1.52	0.38	0.39	2.19	2.19	2.19	26
中期 (3-7)	90	98.67	98.92	5.23	0.69	0.78	0.78	5.12	5.10	5.12	31
長期 (7-)	680	82.61	82.89	21.02	0.96	1.98	1.78	16.66	16.49	16.53	39
長期 (7-11)	222	98.60	98.88	9.05	1.05	1.25	1.25	8.61	8.56	8.61	37
超長期 (11-)	458	74.85	75.14	26.82	0.92	2.44	2.12	21.79	21.56	21.58	40
AAA~A 格	15,871	94.75	94.91	9.43	0.70	1.03	0.98	7.82	7.77	7.79	29
短期 (1-3)	3,693	99.94	100.02	2.10	0.35	0.36	0.36	2.10	2.09	2.10	24
中期 (3-7)	5,252	99.46	99.62	4.98	0.67	0.74	0.73	4.89	4.87	4.88	29
長期 (7-)	6,926	88.40	88.61	16.70	0.92	1.68	1.56	13.77	13.65	13.69	33
長期 (7-11)	2,842	98.14	98.38	8.57	0.93	1.18	1.17	8.22	8.18	8.22	34
超長期 (11-)	4,084	81.63	81.82	22.35	0.90	2.10	1.89	18.42	18.24	18.26	32
AAA~BBB 格	16,574	94.93	95.09	9.19	0.71	1.02	0.97	7.64	7.59	7.61	30
短期 (1-3)	4,079	99.95	100.04	2.11	0.39	0.38	0.38	2.10	2.10	2.10	26
中期 (3-7)	5,484	99.44	99.60	4.97	0.67	0.74	0.74	4.87	4.85	4.87	30
長期 (7-)	7,011	88.48	88.69	16.61	0.92	1.68	1.56	13.71	13.59	13.62	34
長期 (7-11)	2,917	98.08	98.31	8.58	0.93	1.19	1.18	8.23	8.18	8.23	35
超長期 (11-)	4,094	81.64	81.83	22.33	0.90	2.10	1.89	18.41	18.22	18.25	33
AAA~BB 格	16,814	95.00	95.17	9.15	0.73	1.03	0.99	7.62	7.56	7.58	32
短期 (1-3)	4,079	99.95	100.04	2.11	0.39	0.38	0.38	2.10	2.10	2.10	26
中期 (3-7)	5,699	99.50	99.68	4.99	0.73	0.79	0.79	4.88	4.86	4.88	35
長期 (7-)	7,036	88.49	88.70	16.61	0.92	1.68	1.57	13.71	13.59	13.62	34
長期 (7-11)	2,917	98.08	98.31	8.58	0.93	1.19	1.18	8.23	8.18	8.23	35
超長期 (11-)	4,119	81.69	81.89	22.30	0.91	2.10	1.90	18.37	18.19	18.21	33
AAA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA 格	800	85.15	85.43	18.54	0.95	1.75	1.59	14.50	14.37	14.40	37
短期 (1-3)	30	102.16	102.56	2.23	1.52	0.38	0.39	2.19	2.19	2.19	26
中期 (3-7)	90	98.67	98.92	5.23	0.69	0.78	0.78	5.12	5.10	5.12	31
長期 (7-)	680	82.61	82.89	21.02	0.96	1.98	1.78	16.66	16.49	16.53	39
長期 (7-11)	222	98.60	98.88	9.05	1.05	1.25	1.25	8.61	8.56	8.61	37
超長期 (11-)	458	74.85	75.14	26.82	0.92	2.44	2.12	21.79	21.56	21.58	40
A 格	15,071	95.26	95.41	8.94	0.69	0.99	0.95	7.51	7.45	7.47	29
短期 (1-3)	3,663	99.92	100.00	2.10	0.34	0.36	0.36	2.09	2.09	2.09	24
中期 (3-7)	5,162	99.47	99.63	4.98	0.67	0.73	0.73	4.88	4.86	4.88	29
長期 (7-)	6,246	89.03	89.24	16.23	0.91	1.65	1.54	13.48	13.37	13.40	33
長期 (7-11)	2,620	98.10	98.33	8.53	0.92	1.17	1.16	8.19	8.14	8.19	34
超長期 (11-)	3,626	82.48	82.66	21.79	0.90	2.06	1.87	18.03	17.86	17.88	32
BBB 格	703	99.04	99.22	3.89	0.74	0.80	0.80	3.76	3.74	3.76	49
短期 (1-3)	387	100.06	100.25	2.21	0.74	0.59	0.59	2.19	2.18	2.19	46
中期 (3-7)	232	98.95	99.12	4.66	0.67	0.91	0.90	4.58	4.56	4.58	50
長期 (7-)	85	94.64	94.81	9.50	0.90	1.55	1.50	9.02	8.96	9.02	60
長期 (7-11)	75	95.57	95.71	8.89	0.91	1.49	1.46	8.52	8.45	8.51	60
超長期 (11-)	10	87.70	88.09	14.07	0.88	2.00	1.88	13.13	13.01	13.11	58
BB 格	240	99.98	100.59	6.57	2.26	2.12	2.12	5.89	5.82	5.87	155
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	215	101.10	101.67	5.41	2.25	2.01	2.01	5.09	5.04	5.09	153
長期 (7-)	25	90.33	91.34	16.57	2.37	3.27	3.12	13.48	13.27	13.37	168
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	25	90.33	91.34	16.57	2.37	3.27	3.12	13.48	13.27	13.37	168
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	50,723	96.02	96.18	7.28	0.65	1.06	1.03	6.36	6.31	6.33	47
短期 (1-3)	15,304	99.73	99.83	2.06	0.40	0.53	0.53	2.05	2.05	2.05	42
中期 (3-7)	18,981	98.60	98.73	4.70	0.59	0.88	0.87	4.62	4.60	4.62	46
長期 (7-)	16,437	89.58	89.83	15.11	0.96	1.85	1.74	13.01	12.89	12.94	54
長期 (7-11)	7,046	94.39	94.58	8.60	0.78	1.54	1.48	8.29	8.23	8.28	65
超長期 (11-)	9,392	85.97	86.26	19.99	1.09	2.11	1.95	16.90	16.73	16.77	45

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 (2023年10月末、11月ポートフォリオ)

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
AAA~AA 格	800	85.15	85.43	18.54	0.95	1.75	1.59	14.50	14.37	14.40	37
短期 (1-3)	30	102.16	102.56	2.23	1.52	0.38	0.39	2.19	2.19	2.19	26
中期 (3-7)	90	98.67	98.92	5.23	0.69	0.78	0.78	5.12	5.10	5.12	31
長期 (7-)	680	82.61	82.89	21.02	0.96	1.98	1.78	16.66	16.49	16.53	39
長期 (7-11)	222	98.60	98.88	9.05	1.05	1.25	1.25	8.61	8.56	8.61	37
超長期 (11-)	458	74.85	75.14	26.82	0.92	2.44	2.12	21.79	21.56	21.58	40
AAA~A 格	16,183	94.81	94.97	9.39	0.71	1.03	0.98	7.81	7.75	7.77	30
短期 (1-3)	3,713	99.93	100.02	2.11	0.35	0.36	0.36	2.10	2.10	2.10	24
中期 (3-7)	5,452	99.42	99.57	5.01	0.67	0.75	0.74	4.91	4.89	4.91	30
長期 (7-)	7,018	88.52	88.73	16.64	0.93	1.68	1.57	13.73	13.61	13.65	34
長期 (7-11)	2,924	98.12	98.36	8.64	0.95	1.20	1.19	8.28	8.23	8.27	35
超長期 (11-)	4,094	81.65	81.85	22.34	0.91	2.10	1.89	18.42	18.23	18.26	32
AAA~BBB 格	16,946	95.00	95.16	9.14	0.71	1.02	0.97	7.62	7.56	7.58	31
短期 (1-3)	4,129	99.94	100.04	2.12	0.39	0.38	0.38	2.11	2.11	2.11	26
中期 (3-7)	5,714	99.40	99.55	5.00	0.67	0.75	0.75	4.90	4.88	4.90	31
長期 (7-)	7,103	88.59	88.80	16.55	0.93	1.68	1.57	13.67	13.55	13.59	34
長期 (7-11)	2,999	98.06	98.29	8.65	0.95	1.21	1.19	8.29	8.24	8.28	36
超長期 (11-)	4,104	81.67	81.86	22.32	0.91	2.10	1.89	18.40	18.22	18.24	32
AAA~BB 格	17,186	95.07	95.24	9.10	0.73	1.04	0.99	7.59	7.54	7.56	33
短期 (1-3)	4,129	99.94	100.04	2.12	0.39	0.38	0.38	2.11	2.11	2.11	26
中期 (3-7)	5,929	99.46	99.63	5.01	0.73	0.80	0.80	4.91	4.88	4.90	35
長期 (7-)	7,128	88.60	88.81	16.55	0.93	1.69	1.57	13.67	13.55	13.59	35
長期 (7-11)	2,999	98.06	98.29	8.65	0.95	1.21	1.19	8.29	8.24	8.28	36
超長期 (11-)	4,129	81.72	81.92	22.29	0.91	2.10	1.90	18.37	18.19	18.21	33
AAA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA 格	800	85.15	85.43	18.54	0.95	1.75	1.59	14.50	14.37	14.40	37
短期 (1-3)	30	102.16	102.56	2.23	1.52	0.38	0.39	2.19	2.19	2.19	26
中期 (3-7)	90	98.67	98.92	5.23	0.69	0.78	0.78	5.12	5.10	5.12	31
長期 (7-)	680	82.61	82.89	21.02	0.96	1.98	1.78	16.66	16.49	16.53	39
長期 (7-11)	222	98.60	98.88	9.05	1.05	1.25	1.25	8.61	8.56	8.61	37
超長期 (11-)	458	74.85	75.14	26.82	0.92	2.44	2.12	21.79	21.56	21.58	40
A 格	15,383	95.31	95.47	8.91	0.70	1.00	0.95	7.50	7.44	7.46	30
短期 (1-3)	3,683	99.92	100.00	2.11	0.34	0.36	0.36	2.10	2.10	2.10	24
中期 (3-7)	5,362	99.43	99.59	5.01	0.67	0.74	0.74	4.91	4.89	4.91	30
長期 (7-)	6,338	89.15	89.35	16.17	0.92	1.65	1.55	13.44	13.33	13.36	33
長期 (7-11)	2,702	98.08	98.32	8.61	0.95	1.19	1.18	8.25	8.20	8.25	35
超長期 (11-)	3,636	82.51	82.69	21.78	0.90	2.06	1.87	18.03	17.85	17.88	32
BBB 格	763	99.06	99.23	3.89	0.74	0.81	0.81	3.76	3.75	3.76	50
短期 (1-3)	417	100.03	100.21	2.25	0.73	0.60	0.60	2.23	2.22	2.23	47
中期 (3-7)	262	98.94	99.11	4.69	0.69	0.92	0.92	4.61	4.59	4.61	51
長期 (7-)	85	94.64	94.81	9.50	0.90	1.55	1.50	9.02	8.96	9.02	60
長期 (7-11)	75	95.57	95.71	8.89	0.91	1.49	1.46	8.52	8.45	8.51	60
超長期 (11-)	10	87.70	88.09	14.07	0.88	2.00	1.88	13.13	13.01	13.11	58
BB 格	240	99.98	100.59	6.57	2.26	2.12	2.12	5.89	5.82	5.87	155
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	215	101.10	101.67	5.41	2.25	2.01	2.01	5.09	5.04	5.09	153
長期 (7-)	25	90.33	91.34	16.57	2.37	3.27	3.12	13.48	13.27	13.37	168
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	25	90.33	91.34	16.57	2.37	3.27	3.12	13.48	13.27	13.37	168
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	51,488	96.04	96.20	7.30	0.66	1.07	1.03	6.38	6.34	6.36	47
短期 (1-3)	15,777	99.70	99.81	2.11	0.40	0.53	0.53	2.10	2.09	2.10	41
中期 (3-7)	19,113	98.58	98.71	4.77	0.59	0.89	0.88	4.68	4.66	4.68	46
長期 (7-)	16,598	89.62	89.87	15.16	0.97	1.85	1.74	13.05	12.94	12.98	53
長期 (7-11)	7,097	94.41	94.61	8.68	0.80	1.54	1.48	8.36	8.29	8.35	64
超長期 (11-)	9,500	86.05	86.34	20.00	1.10	2.11	1.96	16.90	16.73	16.77	45

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 (2023年10月末)

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
AAA~AA格	888	98.34	98.52	3.55	0.74	1.15	1.14	3.45	3.42	3.45	87
短期(1-3)	413	99.26	99.40	2.24	0.61	0.92	0.91	2.22	2.21	2.22	78
中期(3-7)	429	98.04	98.26	4.18	0.83	1.30	1.28	4.10	4.07	4.10	93
長期(7-)	47	92.87	93.15	9.24	1.10	2.04	1.97	8.66	8.58	8.65	109
長期(7-11)	42	93.15	93.41	8.68	1.01	1.95	1.88	8.28	8.21	8.28	105
超長期(11-)	4	89.96	90.53	14.92	1.99	2.97	2.83	12.61	12.43	12.53	151
AAA~A格	2,756	98.12	98.43	3.90	1.08	1.47	1.45	3.68	3.65	3.68	115
短期(1-3)	1,159	99.59	99.88	2.03	1.04	1.20	1.20	2.00	1.99	2.00	109
中期(3-7)	1,362	97.78	98.06	4.19	0.97	1.49	1.47	4.09	4.06	4.09	112
長期(7-)	236	92.93	93.48	11.37	1.87	2.73	2.63	9.97	9.83	9.93	159
長期(7-11)	121	92.75	93.06	8.87	1.28	2.28	2.20	8.34	8.25	8.33	135
超長期(11-)	114	93.11	93.93	14.03	2.50	3.21	3.09	11.68	11.50	11.62	184
AAA~BBB格	2,756	98.12	98.43	3.90	1.08	1.47	1.45	3.68	3.65	3.68	115
短期(1-3)	1,159	99.59	99.88	2.03	1.04	1.20	1.20	2.00	1.99	2.00	109
中期(3-7)	1,362	97.78	98.06	4.19	0.97	1.49	1.47	4.09	4.06	4.09	112
長期(7-)	236	92.93	93.48	11.37	1.87	2.73	2.63	9.97	9.83	9.93	159
長期(7-11)	121	92.75	93.06	8.87	1.28	2.28	2.20	8.34	8.25	8.33	135
超長期(11-)	114	93.11	93.93	14.03	2.50	3.21	3.09	11.68	11.50	11.62	184
AAA~BB格	2,756	98.12	98.43	3.90	1.08	1.47	1.45	3.68	3.65	3.68	115
短期(1-3)	1,159	99.59	99.88	2.03	1.04	1.20	1.20	2.00	1.99	2.00	109
中期(3-7)	1,362	97.78	98.06	4.19	0.97	1.49	1.47	4.09	4.06	4.09	112
長期(7-)	236	92.93	93.48	11.37	1.87	2.73	2.63	9.97	9.83	9.93	159
長期(7-11)	121	92.75	93.06	8.87	1.28	2.28	2.20	8.34	8.25	8.33	135
超長期(11-)	114	93.11	93.93	14.03	2.50	3.21	3.09	11.68	11.50	11.62	184
AAA格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA格	888	98.34	98.52	3.55	0.74	1.15	1.14	3.45	3.42	3.45	87
短期(1-3)	413	99.26	99.40	2.24	0.61	0.92	0.91	2.22	2.21	2.22	78
中期(3-7)	429	98.04	98.26	4.18	0.83	1.30	1.28	4.10	4.07	4.10	93
長期(7-)	47	92.87	93.15	9.24	1.10	2.04	1.97	8.66	8.58	8.65	109
長期(7-11)	42	93.15	93.41	8.68	1.01	1.95	1.88	8.28	8.21	8.28	105
超長期(11-)	4	89.96	90.53	14.92	1.99	2.97	2.83	12.61	12.43	12.53	151
A格	1,868	98.02	98.39	4.06	1.24	1.62	1.60	3.79	3.75	3.79	128
短期(1-3)	746	99.77	100.14	1.91	1.28	1.36	1.36	1.88	1.87	1.88	127
中期(3-7)	933	97.66	97.97	4.19	1.03	1.58	1.56	4.09	4.06	4.09	121
長期(7-)	189	92.94	93.57	11.90	2.06	2.90	2.80	10.29	10.14	10.25	171
長期(7-11)	79	92.54	92.88	8.98	1.43	2.46	2.37	8.37	8.27	8.36	151
超長期(11-)	110	93.23	94.06	14.00	2.52	3.22	3.10	11.65	11.47	11.58	185
BBB格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
BB格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
B格以下	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
格付なし	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

出所:NFRC

- 格付は、格付会社4社の最高格付をもとに分類

円建外債 最高格付別・ポートフォリオ指標 (2023年10月末、11月ポートフォリオ)

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
AAA~AA 格	1,081	98.46	98.64	3.81	0.77	1.15	1.14	3.71	3.68	3.71	83
短期 (1-3)	439	99.30	99.43	2.31	0.60	0.89	0.88	2.29	2.28	2.29	74
中期 (3-7)	584	98.28	98.48	4.40	0.87	1.27	1.26	4.31	4.28	4.31	88
長期 (7-)	58	93.85	94.12	9.36	1.15	1.95	1.89	8.78	8.70	8.77	100
長期 (7-11)	54	94.16	94.40	8.93	1.08	1.87	1.82	8.49	8.41	8.48	96
超長期 (11-)	4	89.96	90.53	14.92	1.99	2.97	2.83	12.61	12.43	12.53	151
AAA~A 格	2,949	98.18	98.48	3.97	1.07	1.44	1.43	3.76	3.73	3.76	111
短期 (1-3)	1,245	99.80	100.13	2.11	1.10	1.19	1.19	2.08	2.07	2.08	107
中期 (3-7)	1,457	97.66	97.88	4.32	0.90	1.46	1.45	4.23	4.20	4.23	108
長期 (7-)	247	93.15	93.70	11.31	1.85	2.68	2.58	9.93	9.80	9.90	154
長期 (7-11)	133	93.19	93.49	8.96	1.29	2.22	2.15	8.42	8.33	8.41	129
超長期 (11-)	114	93.11	93.93	14.03	2.50	3.21	3.09	11.68	11.50	11.62	184
AAA~BBB 格	2,949	98.18	98.48	3.97	1.07	1.44	1.43	3.76	3.73	3.76	111
短期 (1-3)	1,245	99.80	100.13	2.11	1.10	1.19	1.19	2.08	2.07	2.08	107
中期 (3-7)	1,457	97.66	97.88	4.32	0.90	1.46	1.45	4.23	4.20	4.23	108
長期 (7-)	247	93.15	93.70	11.31	1.85	2.68	2.58	9.93	9.80	9.90	154
長期 (7-11)	133	93.19	93.49	8.96	1.29	2.22	2.15	8.42	8.33	8.41	129
超長期 (11-)	114	93.11	93.93	14.03	2.50	3.21	3.09	11.68	11.50	11.62	184
AAA~BB 格	2,949	98.18	98.48	3.97	1.07	1.44	1.43	3.76	3.73	3.76	111
短期 (1-3)	1,245	99.80	100.13	2.11	1.10	1.19	1.19	2.08	2.07	2.08	107
中期 (3-7)	1,457	97.66	97.88	4.32	0.90	1.46	1.45	4.23	4.20	4.23	108
長期 (7-)	247	93.15	93.70	11.31	1.85	2.68	2.58	9.93	9.80	9.90	154
長期 (7-11)	133	93.19	93.49	8.96	1.29	2.22	2.15	8.42	8.33	8.41	129
超長期 (11-)	114	93.11	93.93	14.03	2.50	3.21	3.09	11.68	11.50	11.62	184
AAA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA 格	1,081	98.46	98.64	3.81	0.77	1.15	1.14	3.71	3.68	3.71	83
短期 (1-3)	439	99.30	99.43	2.31	0.60	0.89	0.88	2.29	2.28	2.29	74
中期 (3-7)	584	98.28	98.48	4.40	0.87	1.27	1.26	4.31	4.28	4.31	88
長期 (7-)	58	93.85	94.12	9.36	1.15	1.95	1.89	8.78	8.70	8.77	100
長期 (7-11)	54	94.16	94.40	8.93	1.08	1.87	1.82	8.49	8.41	8.48	96
超長期 (11-)	4	89.96	90.53	14.92	1.99	2.97	2.83	12.61	12.43	12.53	151
A 格	1,868	98.02	98.39	4.06	1.24	1.62	1.60	3.79	3.75	3.79	128
短期 (1-3)	806	100.07	100.51	2.00	1.38	1.36	1.36	1.96	1.95	1.96	126
中期 (3-7)	873	97.24	97.48	4.27	0.93	1.60	1.58	4.18	4.14	4.18	121
長期 (7-)	189	92.94	93.57	11.90	2.06	2.90	2.80	10.29	10.14	10.25	171
長期 (7-11)	79	92.54	92.88	8.98	1.43	2.46	2.37	8.37	8.27	8.36	151
超長期 (11-)	110	93.23	94.06	14.00	2.52	3.22	3.10	11.65	11.47	11.58	185
BBB 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
BB 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
B 格以下	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
格付なし	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

出所:NFRC

- 格付は、格付会社 4 社の最高格付をもとに分類

円建外債 最低格付別・ポートフォリオ指標 (2023年10月末)

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
AAA～AA格	214	98.64	98.81	3.09	0.71	1.06	1.06	3.02	3.00	3.02	83
短期(1-3)	122	99.73	99.93	1.96	0.78	0.96	0.96	1.95	1.94	1.95	86
中期(3-7)	84	97.71	97.85	4.27	0.61	1.16	1.15	4.21	4.18	4.21	79
長期(7-)	7	91.02	91.16	8.28	0.60	1.85	1.77	8.06	7.99	8.06	97
長期(7-11)	7	91.02	91.16	8.28	0.60	1.85	1.77	8.06	7.99	8.06	97
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AAA～A格	1,537	98.79	99.12	3.59	1.00	1.27	1.27	3.44	3.41	3.43	99
短期(1-3)	796	99.58	99.84	2.11	0.94	1.10	1.09	2.09	2.07	2.09	98
中期(3-7)	630	98.28	98.62	4.15	0.95	1.32	1.31	4.05	4.03	4.05	97
長期(7-)	112	96.13	96.84	11.02	1.74	2.31	2.28	9.80	9.69	9.77	125
長期(7-11)	62	92.27	92.52	8.56	0.87	1.94	1.87	8.23	8.15	8.22	104
超長期(11-)	50	100.87	102.17	14.04	2.81	2.72	2.73	11.57	11.41	11.50	149
AAA～BBB格	2,756	98.12	98.43	3.90	1.08	1.47	1.45	3.68	3.65	3.68	115
短期(1-3)	1,159	99.59	99.88	2.03	1.04	1.20	1.20	2.00	1.99	2.00	109
中期(3-7)	1,362	97.78	98.06	4.19	0.97	1.49	1.47	4.09	4.06	4.09	112
長期(7-)	236	92.93	93.48	11.37	1.87	2.73	2.63	9.97	9.83	9.93	159
長期(7-11)	121	92.75	93.06	8.87	1.28	2.28	2.20	8.34	8.25	8.33	135
超長期(11-)	114	93.11	93.93	14.03	2.50	3.21	3.09	11.68	11.50	11.62	184
AAA～BB格	2,756	98.12	98.43	3.90	1.08	1.47	1.45	3.68	3.65	3.68	115
短期(1-3)	1,159	99.59	99.88	2.03	1.04	1.20	1.20	2.00	1.99	2.00	109
中期(3-7)	1,362	97.78	98.06	4.19	0.97	1.49	1.47	4.09	4.06	4.09	112
長期(7-)	236	92.93	93.48	11.37	1.87	2.73	2.63	9.97	9.83	9.93	159
長期(7-11)	121	92.75	93.06	8.87	1.28	2.28	2.20	8.34	8.25	8.33	135
超長期(11-)	114	93.11	93.93	14.03	2.50	3.21	3.09	11.68	11.50	11.62	184
AAA格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA格	214	98.64	98.81	3.09	0.71	1.06	1.06	3.02	3.00	3.02	83
短期(1-3)	122	99.73	99.93	1.96	0.78	0.96	0.96	1.95	1.94	1.95	86
中期(3-7)	84	97.71	97.85	4.27	0.61	1.16	1.15	4.21	4.18	4.21	79
長期(7-)	7	91.02	91.16	8.28	0.60	1.85	1.77	8.06	7.99	8.06	97
長期(7-11)	7	91.02	91.16	8.28	0.60	1.85	1.77	8.06	7.99	8.06	97
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
A格	1,323	98.82	99.17	3.67	1.05	1.31	1.30	3.50	3.48	3.50	102
短期(1-3)	673	99.55	99.82	2.14	0.97	1.12	1.12	2.11	2.10	2.11	100
中期(3-7)	546	98.36	98.73	4.13	1.00	1.35	1.34	4.03	4.00	4.03	99
長期(7-)	104	96.48	97.23	11.21	1.82	2.34	2.31	9.92	9.80	9.88	127
長期(7-11)	54	92.44	92.70	8.60	0.90	1.95	1.88	8.25	8.17	8.24	105
超長期(11-)	50	100.87	102.17	14.04	2.81	2.72	2.73	11.57	11.41	11.50	149
BBB格	1,219	97.28	97.57	4.28	1.17	1.71	1.69	3.99	3.95	3.99	135
短期(1-3)	363	99.62	99.97	1.85	1.26	1.44	1.44	1.83	1.81	1.83	135
中期(3-7)	732	97.35	97.58	4.23	0.99	1.63	1.61	4.13	4.09	4.13	125
長期(7-)	124	90.05	90.47	11.70	1.99	3.13	2.97	10.12	9.97	10.09	191
長期(7-11)	60	93.25	93.63	9.20	1.70	2.62	2.54	8.46	8.35	8.44	166
超長期(11-)	64	87.07	87.53	14.02	2.26	3.64	3.41	11.78	11.59	11.72	216
BB格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
B格以下	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
格付なし	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

出所:NFRC

- 格付は、格付会社4社の最低格付をもとに分類

円建外債 最低格付別・ポートフォリオ指標(2023年10月末、11月ポートフォリオ)

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
AAA~AA格	284	98.93	99.08	3.46	0.71	0.98	0.98	3.38	3.36	3.38	71
短期(1-3)	155	99.79	99.95	2.16	0.72	0.86	0.86	2.14	2.13	2.14	73
中期(3-7)	115	98.28	98.41	4.55	0.67	1.07	1.07	4.48	4.45	4.48	67
長期(7-)	14	94.69	94.85	9.03	0.94	1.65	1.61	8.66	8.59	8.65	73
長期(7-11)	14	94.69	94.85	9.03	0.94	1.65	1.61	8.66	8.59	8.65	73
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AAA~A格	1,730	98.82	99.12	3.75	0.99	1.26	1.25	3.60	3.57	3.60	96
短期(1-3)	882	99.87	100.19	2.21	1.04	1.09	1.09	2.18	2.17	2.18	96
中期(3-7)	726	97.97	98.19	4.42	0.82	1.30	1.29	4.33	4.30	4.33	91
長期(7-)	123	96.29	96.96	10.91	1.70	2.24	2.21	9.75	9.64	9.72	120
長期(7-11)	73	93.15	93.38	8.76	0.94	1.89	1.82	8.39	8.31	8.38	98
超長期(11-)	50	100.87	102.17	14.04	2.81	2.72	2.73	11.57	11.41	11.50	149
AAA~BBB格	2,949	98.18	98.48	3.97	1.07	1.44	1.43	3.76	3.73	3.76	111
短期(1-3)	1,245	99.80	100.13	2.11	1.10	1.19	1.19	2.08	2.07	2.08	107
中期(3-7)	1,457	97.66	97.88	4.32	0.90	1.46	1.45	4.23	4.20	4.23	108
長期(7-)	247	93.15	93.70	11.31	1.85	2.68	2.58	9.93	9.80	9.90	154
長期(7-11)	133	93.19	93.49	8.96	1.29	2.22	2.15	8.42	8.33	8.41	129
超長期(11-)	114	93.11	93.93	14.03	2.50	3.21	3.09	11.68	11.50	11.62	184
AAA~BB格	2,949	98.18	98.48	3.97	1.07	1.44	1.43	3.76	3.73	3.76	111
短期(1-3)	1,245	99.80	100.13	2.11	1.10	1.19	1.19	2.08	2.07	2.08	107
中期(3-7)	1,457	97.66	97.88	4.32	0.90	1.46	1.45	4.23	4.20	4.23	108
長期(7-)	247	93.15	93.70	11.31	1.85	2.68	2.58	9.93	9.80	9.90	154
長期(7-11)	133	93.19	93.49	8.96	1.29	2.22	2.15	8.42	8.33	8.41	129
超長期(11-)	114	93.11	93.93	14.03	2.50	3.21	3.09	11.68	11.50	11.62	184
AAA格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA格	284	98.93	99.08	3.46	0.71	0.98	0.98	3.38	3.36	3.38	71
短期(1-3)	155	99.79	99.95	2.16	0.72	0.86	0.86	2.14	2.13	2.14	73
中期(3-7)	115	98.28	98.41	4.55	0.67	1.07	1.07	4.48	4.45	4.48	67
長期(7-)	14	94.69	94.85	9.03	0.94	1.65	1.61	8.66	8.59	8.65	73
長期(7-11)	14	94.69	94.85	9.03	0.94	1.65	1.61	8.66	8.59	8.65	73
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
A格	1,446	98.80	99.13	3.81	1.05	1.31	1.30	3.64	3.61	3.64	100
短期(1-3)	727	99.89	100.24	2.22	1.11	1.14	1.14	2.19	2.18	2.19	101
中期(3-7)	611	97.91	98.15	4.39	0.84	1.34	1.33	4.30	4.27	4.30	95
長期(7-)	109	96.50	97.23	11.15	1.80	2.32	2.29	9.89	9.77	9.85	125
長期(7-11)	59	92.79	93.04	8.70	0.95	1.94	1.87	8.33	8.25	8.32	103
超長期(11-)	50	100.87	102.17	14.04	2.81	2.72	2.73	11.57	11.41	11.50	149
BBB格	1,219	97.28	97.57	4.28	1.17	1.71	1.69	3.99	3.95	3.99	135
短期(1-3)	363	99.62	99.97	1.85	1.26	1.44	1.44	1.83	1.81	1.83	135
中期(3-7)	732	97.35	97.58	4.23	0.99	1.63	1.61	4.13	4.09	4.13	125
長期(7-)	124	90.05	90.47	11.70	1.99	3.13	2.97	10.12	9.97	10.09	191
長期(7-11)	60	93.25	93.63	9.20	1.70	2.62	2.54	8.46	8.35	8.44	166
超長期(11-)	64	87.07	87.53	14.02	2.26	3.64	3.41	11.78	11.59	11.72	216
BB格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
B格以下	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
格付なし	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

出所:NFRC

- 格付は、格付会社4社の最低格付をもとに分類

円建外債 R&I 格付別・ポートフォリオ指標 (2023年10月末)

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
AAA~AA 格	60	99.98	100.25	1.95	0.91	1.02	1.02	1.93	1.92	1.93	93
短期 (1-3)	60	99.98	100.25	1.95	0.91	1.02	1.02	1.93	1.92	1.93	93
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AAA~A 格	865	98.48	98.89	3.28	1.22	1.53	1.51	3.17	3.15	3.17	127
短期 (1-3)	417	100.14	100.67	1.88	1.56	1.45	1.45	1.85	1.83	1.85	136
中期 (3-7)	419	97.32	97.60	4.27	0.90	1.57	1.55	4.18	4.15	4.18	118
長期 (7-)	29	91.45	91.78	9.01	0.96	2.10	2.02	8.59	8.51	8.59	114
長期 (7-11)	29	91.45	91.78	9.01	0.96	2.10	2.02	8.59	8.51	8.59	114
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AAA~BBB 格	865	98.48	98.89	3.28	1.22	1.53	1.51	3.17	3.15	3.17	127
短期 (1-3)	417	100.14	100.67	1.88	1.56	1.45	1.45	1.85	1.83	1.85	136
中期 (3-7)	419	97.32	97.60	4.27	0.90	1.57	1.55	4.18	4.15	4.18	118
長期 (7-)	29	91.45	91.78	9.01	0.96	2.10	2.02	8.59	8.51	8.59	114
長期 (7-11)	29	91.45	91.78	9.01	0.96	2.10	2.02	8.59	8.51	8.59	114
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AAA~BB 格	865	98.48	98.89	3.28	1.22	1.53	1.51	3.17	3.15	3.17	127
短期 (1-3)	417	100.14	100.67	1.88	1.56	1.45	1.45	1.85	1.83	1.85	136
中期 (3-7)	419	97.32	97.60	4.27	0.90	1.57	1.55	4.18	4.15	4.18	118
長期 (7-)	29	91.45	91.78	9.01	0.96	2.10	2.02	8.59	8.51	8.59	114
長期 (7-11)	29	91.45	91.78	9.01	0.96	2.10	2.02	8.59	8.51	8.59	114
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AAA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA 格	60	99.98	100.25	1.95	0.91	1.02	1.02	1.93	1.92	1.93	93
短期 (1-3)	60	99.98	100.25	1.95	0.91	1.02	1.02	1.93	1.92	1.93	93
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
A 格	805	98.37	98.78	3.38	1.25	1.56	1.55	3.26	3.24	3.26	130
短期 (1-3)	357	100.17	100.74	1.87	1.67	1.52	1.52	1.83	1.82	1.83	144
中期 (3-7)	419	97.32	97.60	4.27	0.90	1.57	1.55	4.18	4.15	4.18	118
長期 (7-)	29	91.45	91.78	9.01	0.96	2.10	2.02	8.59	8.51	8.59	114
長期 (7-11)	29	91.45	91.78	9.01	0.96	2.10	2.02	8.59	8.51	8.59	114
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
BBB 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
BB 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
B 格以下	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
格付なし	1,891	97.96	98.23	4.18	1.01	1.44	1.42	3.91	3.88	3.91	109
短期 (1-3)	741	99.28	99.43	2.12	0.74	1.06	1.06	2.10	2.08	2.10	94
中期 (3-7)	943	97.98	98.26	4.15	1.00	1.45	1.44	4.05	4.02	4.05	109
長期 (7-)	207	93.13	93.72	11.71	2.00	2.82	2.72	10.16	10.02	10.12	165
長期 (7-11)	92	93.16	93.47	8.83	1.38	2.33	2.26	8.26	8.17	8.25	141
超長期 (11-)	114	93.11	93.93	14.03	2.50	3.21	3.09	11.68	11.50	11.62	184

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 (2023年10月末、11月ポートフォリオ)

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
AAA~AA 格	60	99.98	100.25	1.95	0.91	1.02	1.02	1.93	1.92	1.93	93
短期 (1-3)	60	99.98	100.25	1.95	0.91	1.02	1.02	1.93	1.92	1.93	93
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AAA~A 格	865	98.48	98.89	3.28	1.22	1.53	1.51	3.17	3.15	3.17	127
短期 (1-3)	417	100.14	100.67	1.88	1.56	1.45	1.45	1.85	1.83	1.85	136
中期 (3-7)	419	97.32	97.60	4.27	0.90	1.57	1.55	4.18	4.15	4.18	118
長期 (7-)	29	91.45	91.78	9.01	0.96	2.10	2.02	8.59	8.51	8.59	114
長期 (7-11)	29	91.45	91.78	9.01	0.96	2.10	2.02	8.59	8.51	8.59	114
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AAA~BBB 格	865	98.48	98.89	3.28	1.22	1.53	1.51	3.17	3.15	3.17	127
短期 (1-3)	417	100.14	100.67	1.88	1.56	1.45	1.45	1.85	1.83	1.85	136
中期 (3-7)	419	97.32	97.60	4.27	0.90	1.57	1.55	4.18	4.15	4.18	118
長期 (7-)	29	91.45	91.78	9.01	0.96	2.10	2.02	8.59	8.51	8.59	114
長期 (7-11)	29	91.45	91.78	9.01	0.96	2.10	2.02	8.59	8.51	8.59	114
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AAA~BB 格	865	98.48	98.89	3.28	1.22	1.53	1.51	3.17	3.15	3.17	127
短期 (1-3)	417	100.14	100.67	1.88	1.56	1.45	1.45	1.85	1.83	1.85	136
中期 (3-7)	419	97.32	97.60	4.27	0.90	1.57	1.55	4.18	4.15	4.18	118
長期 (7-)	29	91.45	91.78	9.01	0.96	2.10	2.02	8.59	8.51	8.59	114
長期 (7-11)	29	91.45	91.78	9.01	0.96	2.10	2.02	8.59	8.51	8.59	114
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AAA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA 格	60	99.98	100.25	1.95	0.91	1.02	1.02	1.93	1.92	1.93	93
短期 (1-3)	60	99.98	100.25	1.95	0.91	1.02	1.02	1.93	1.92	1.93	93
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
A 格	805	98.37	98.78	3.38	1.25	1.56	1.55	3.26	3.24	3.26	130
短期 (1-3)	357	100.17	100.74	1.87	1.67	1.52	1.52	1.83	1.82	1.83	144
中期 (3-7)	419	97.32	97.60	4.27	0.90	1.57	1.55	4.18	4.15	4.18	118
長期 (7-)	29	91.45	91.78	9.01	0.96	2.10	2.02	8.59	8.51	8.59	114
長期 (7-11)	29	91.45	91.78	9.01	0.96	2.10	2.02	8.59	8.51	8.59	114
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
BBB 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
BB 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
B 格以下	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
格付なし	2,084	98.06	98.31	4.26	1.00	1.41	1.39	4.01	3.97	4.00	105
短期 (1-3)	828	99.63	99.85	2.22	0.87	1.06	1.06	2.20	2.18	2.20	93
中期 (3-7)	1,038	97.79	98.00	4.34	0.90	1.42	1.41	4.25	4.22	4.25	104
長期 (7-)	218	93.38	93.95	11.61	1.97	2.75	2.66	10.11	9.97	10.07	160
長期 (7-11)	103	93.68	93.97	8.94	1.38	2.25	2.18	8.37	8.28	8.36	132
超長期 (11-)	114	93.11	93.93	14.03	2.50	3.21	3.09	11.68	11.50	11.62	184

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 (2023年10月末)

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
AAA~AA 格	224	98.47	98.74	4.09	1.06	1.38	1.36	3.91	3.88	3.91	103
短期 (1-3)	39	99.26	99.36	2.10	0.64	0.98	0.98	2.09	2.08	2.09	86
中期 (3-7)	163	99.03	99.33	3.78	1.11	1.36	1.35	3.69	3.67	3.69	104
長期 (7-)	22	92.92	93.31	9.80	1.36	2.26	2.18	8.96	8.86	8.94	126
長期 (7-11)	18	93.61	93.96	8.60	1.21	2.10	2.04	8.14	8.06	8.13	121
超長期 (11-)	4	89.96	90.53	14.92	1.99	2.97	2.83	12.61	12.43	12.53	151
AAA~A 格	1,073	98.15	98.55	4.54	1.39	1.64	1.62	4.13	4.09	4.13	126
短期 (1-3)	370	100.00	100.39	1.77	1.31	1.27	1.28	1.75	1.74	1.75	120
中期 (3-7)	537	98.51	98.85	4.04	1.21	1.51	1.50	3.93	3.90	3.93	117
長期 (7-)	167	92.85	93.52	12.29	2.16	2.97	2.87	10.52	10.37	10.48	175
長期 (7-11)	62	93.27	93.61	9.02	1.60	2.52	2.45	8.34	8.24	8.33	158
超長期 (11-)	104	92.60	93.47	14.24	2.49	3.25	3.12	11.83	11.65	11.76	186
AAA~BBB 格	1,073	98.15	98.55	4.54	1.39	1.64	1.62	4.13	4.09	4.13	126
短期 (1-3)	370	100.00	100.39	1.77	1.31	1.27	1.28	1.75	1.74	1.75	120
中期 (3-7)	537	98.51	98.85	4.04	1.21	1.51	1.50	3.93	3.90	3.93	117
長期 (7-)	167	92.85	93.52	12.29	2.16	2.97	2.87	10.52	10.37	10.48	175
長期 (7-11)	62	93.27	93.61	9.02	1.60	2.52	2.45	8.34	8.24	8.33	158
超長期 (11-)	104	92.60	93.47	14.24	2.49	3.25	3.12	11.83	11.65	11.76	186
AAA~BB 格	1,073	98.15	98.55	4.54	1.39	1.64	1.62	4.13	4.09	4.13	126
短期 (1-3)	370	100.00	100.39	1.77	1.31	1.27	1.28	1.75	1.74	1.75	120
中期 (3-7)	537	98.51	98.85	4.04	1.21	1.51	1.50	3.93	3.90	3.93	117
長期 (7-)	167	92.85	93.52	12.29	2.16	2.97	2.87	10.52	10.37	10.48	175
長期 (7-11)	62	93.27	93.61	9.02	1.60	2.52	2.45	8.34	8.24	8.33	158
超長期 (11-)	104	92.60	93.47	14.24	2.49	3.25	3.12	11.83	11.65	11.76	186
AAA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA 格	224	98.47	98.74	4.09	1.06	1.38	1.36	3.91	3.88	3.91	103
短期 (1-3)	39	99.26	99.36	2.10	0.64	0.98	0.98	2.09	2.08	2.09	86
中期 (3-7)	163	99.03	99.33	3.78	1.11	1.36	1.35	3.69	3.67	3.69	104
長期 (7-)	22	92.92	93.31	9.80	1.36	2.26	2.18	8.96	8.86	8.94	126
長期 (7-11)	18	93.61	93.96	8.60	1.21	2.10	2.04	8.14	8.06	8.13	121
超長期 (11-)	4	89.96	90.53	14.92	1.99	2.97	2.83	12.61	12.43	12.53	151
A 格	849	98.06	98.51	4.66	1.48	1.72	1.69	4.19	4.15	4.18	133
短期 (1-3)	331	100.08	100.51	1.73	1.39	1.31	1.31	1.71	1.70	1.71	124
中期 (3-7)	374	98.29	98.64	4.16	1.25	1.58	1.57	4.03	4.00	4.03	122
長期 (7-)	144	92.84	93.55	12.67	2.28	3.09	2.97	10.76	10.60	10.71	183
長期 (7-11)	44	93.14	93.47	9.19	1.75	2.70	2.61	8.43	8.32	8.41	174
超長期 (11-)	100	92.71	93.59	14.21	2.51	3.26	3.13	11.80	11.62	11.73	187
BBB 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
BB 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
B 格以下	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
格付なし	1,683	98.11	98.36	3.49	0.88	1.35	1.34	3.39	3.36	3.39	107
短期 (1-3)	788	99.40	99.64	2.15	0.91	1.17	1.17	2.13	2.11	2.13	104
中期 (3-7)	825	97.30	97.54	4.29	0.82	1.47	1.45	4.20	4.17	4.20	109
長期 (7-)	69	93.10	93.39	9.18	1.19	2.14	2.07	8.62	8.53	8.61	119
長期 (7-11)	59	92.20	92.49	8.72	0.95	2.02	1.94	8.34	8.26	8.33	110
超長期 (11-)	10	98.41	98.73	11.87	2.65	2.83	2.81	10.21	10.07	10.18	172

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 (2023年10月末、11月ポートフォリオ)

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
AAA~AA 格	224	98.47	98.74	4.09	1.06	1.38	1.36	3.91	3.88	3.91	103
短期 (1-3)	39	99.26	99.36	2.10	0.64	0.98	0.98	2.09	2.08	2.09	86
中期 (3-7)	163	99.03	99.33	3.78	1.11	1.36	1.35	3.69	3.67	3.69	104
長期 (7-)	22	92.92	93.31	9.80	1.36	2.26	2.18	8.96	8.86	8.94	126
長期 (7-11)	18	93.61	93.96	8.60	1.21	2.10	2.04	8.14	8.06	8.13	121
超長期 (11-)	4	89.96	90.53	14.92	1.99	2.97	2.83	12.61	12.43	12.53	151
AAA~A 格	1,073	98.15	98.55	4.54	1.39	1.64	1.62	4.13	4.09	4.13	126
短期 (1-3)	430	100.53	101.03	1.95	1.49	1.28	1.29	1.92	1.90	1.92	119
中期 (3-7)	477	97.85	98.08	4.17	1.03	1.54	1.52	4.06	4.03	4.06	117
長期 (7-)	167	92.85	93.52	12.29	2.16	2.97	2.87	10.52	10.37	10.48	175
長期 (7-11)	62	93.27	93.61	9.02	1.60	2.52	2.45	8.34	8.24	8.33	158
超長期 (11-)	104	92.60	93.47	14.24	2.49	3.25	3.12	11.83	11.65	11.76	186
AAA~BBB 格	1,073	98.15	98.55	4.54	1.39	1.64	1.62	4.13	4.09	4.13	126
短期 (1-3)	430	100.53	101.03	1.95	1.49	1.28	1.29	1.92	1.90	1.92	119
中期 (3-7)	477	97.85	98.08	4.17	1.03	1.54	1.52	4.06	4.03	4.06	117
長期 (7-)	167	92.85	93.52	12.29	2.16	2.97	2.87	10.52	10.37	10.48	175
長期 (7-11)	62	93.27	93.61	9.02	1.60	2.52	2.45	8.34	8.24	8.33	158
超長期 (11-)	104	92.60	93.47	14.24	2.49	3.25	3.12	11.83	11.65	11.76	186
AAA~BB 格	1,073	98.15	98.55	4.54	1.39	1.64	1.62	4.13	4.09	4.13	126
短期 (1-3)	430	100.53	101.03	1.95	1.49	1.28	1.29	1.92	1.90	1.92	119
中期 (3-7)	477	97.85	98.08	4.17	1.03	1.54	1.52	4.06	4.03	4.06	117
長期 (7-)	167	92.85	93.52	12.29	2.16	2.97	2.87	10.52	10.37	10.48	175
長期 (7-11)	62	93.27	93.61	9.02	1.60	2.52	2.45	8.34	8.24	8.33	158
超長期 (11-)	104	92.60	93.47	14.24	2.49	3.25	3.12	11.83	11.65	11.76	186
AAA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA 格	224	98.47	98.74	4.09	1.06	1.38	1.36	3.91	3.88	3.91	103
短期 (1-3)	39	99.26	99.36	2.10	0.64	0.98	0.98	2.09	2.08	2.09	86
中期 (3-7)	163	99.03	99.33	3.78	1.11	1.36	1.35	3.69	3.67	3.69	104
長期 (7-)	22	92.92	93.31	9.80	1.36	2.26	2.18	8.96	8.86	8.94	126
長期 (7-11)	18	93.61	93.96	8.60	1.21	2.10	2.04	8.14	8.06	8.13	121
超長期 (11-)	4	89.96	90.53	14.92	1.99	2.97	2.83	12.61	12.43	12.53	151
A 格	849	98.06	98.51	4.66	1.48	1.72	1.69	4.19	4.15	4.18	133
短期 (1-3)	391	100.65	101.20	1.93	1.58	1.31	1.32	1.90	1.89	1.90	122
中期 (3-7)	314	97.24	97.43	4.37	0.99	1.63	1.61	4.26	4.23	4.26	124
長期 (7-)	144	92.84	93.55	12.67	2.28	3.09	2.97	10.76	10.60	10.71	183
長期 (7-11)	44	93.14	93.47	9.19	1.75	2.70	2.61	8.43	8.32	8.41	174
超長期 (11-)	100	92.71	93.59	14.21	2.51	3.26	3.13	11.80	11.62	11.73	187
BBB 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
BB 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
B 格以下	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
格付なし	1,876	98.20	98.44	3.65	0.88	1.33	1.32	3.55	3.52	3.54	103
短期 (1-3)	815	99.42	99.65	2.19	0.90	1.14	1.14	2.16	2.15	2.16	101
中期 (3-7)	981	97.56	97.79	4.40	0.84	1.43	1.41	4.31	4.28	4.31	104
長期 (7-)	80	93.78	94.05	9.27	1.22	2.06	2.00	8.71	8.63	8.70	111
長期 (7-11)	70	93.12	93.39	8.90	1.01	1.95	1.88	8.49	8.41	8.48	102
超長期 (11-)	10	98.41	98.73	11.87	2.65	2.83	2.81	10.21	10.07	10.18	172

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 (2023年10月末)

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
AAA~AA 格	713	98.26	98.42	3.36	0.65	1.09	1.08	3.29	3.27	3.29	82
短期 (1-3)	408	99.26	99.39	2.25	0.61	0.92	0.92	2.23	2.22	2.23	78
中期 (3-7)	274	97.46	97.63	4.41	0.68	1.27	1.25	4.34	4.31	4.34	87
長期 (7-)	32	92.41	92.59	8.64	0.80	1.84	1.77	8.32	8.25	8.32	94
長期 (7-11)	32	92.41	92.59	8.64	0.80	1.84	1.77	8.32	8.25	8.32	94
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AAA~A 格	1,570	98.57	98.86	3.74	0.90	1.26	1.25	3.57	3.55	3.57	96
短期 (1-3)	755	99.34	99.51	2.15	0.71	1.00	1.00	2.13	2.12	2.13	88
中期 (3-7)	688	98.19	98.54	4.14	0.95	1.35	1.34	4.04	4.02	4.04	99
長期 (7-)	127	96.04	96.72	11.02	1.78	2.36	2.32	9.80	9.69	9.77	130
長期 (7-11)	67	92.11	92.38	8.65	0.90	1.98	1.91	8.29	8.21	8.29	107
超長期 (11-)	60	100.46	101.59	13.68	2.78	2.74	2.75	11.35	11.19	11.29	153
AAA~BBB 格	2,373	97.99	98.26	4.09	0.97	1.41	1.39	3.85	3.82	3.85	107
短期 (1-3)	927	99.34	99.51	2.11	0.74	1.04	1.04	2.08	2.07	2.08	92
中期 (3-7)	1,218	97.89	98.19	4.22	0.98	1.46	1.44	4.12	4.09	4.12	109
長期 (7-)	228	93.00	93.57	11.48	1.90	2.74	2.64	10.04	9.90	10.00	159
長期 (7-11)	114	92.88	93.20	8.91	1.29	2.27	2.19	8.37	8.28	8.36	133
超長期 (11-)	114	93.11	93.93	14.03	2.50	3.21	3.09	11.68	11.50	11.62	184
AAA~BB 格	2,373	97.99	98.26	4.09	0.97	1.41	1.39	3.85	3.82	3.85	107
短期 (1-3)	927	99.34	99.51	2.11	0.74	1.04	1.04	2.08	2.07	2.08	92
中期 (3-7)	1,218	97.89	98.19	4.22	0.98	1.46	1.44	4.12	4.09	4.12	109
長期 (7-)	228	93.00	93.57	11.48	1.90	2.74	2.64	10.04	9.90	10.00	159
長期 (7-11)	114	92.88	93.20	8.91	1.29	2.27	2.19	8.37	8.28	8.36	133
超長期 (11-)	114	93.11	93.93	14.03	2.50	3.21	3.09	11.68	11.50	11.62	184
AAA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA 格	713	98.26	98.42	3.36	0.65	1.09	1.08	3.29	3.27	3.29	82
短期 (1-3)	408	99.26	99.39	2.25	0.61	0.92	0.92	2.23	2.22	2.23	78
中期 (3-7)	274	97.46	97.63	4.41	0.68	1.27	1.25	4.34	4.31	4.34	87
長期 (7-)	32	92.41	92.59	8.64	0.80	1.84	1.77	8.32	8.25	8.32	94
長期 (7-11)	32	92.41	92.59	8.64	0.80	1.84	1.77	8.32	8.25	8.32	94
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
A 格	858	98.83	99.22	4.05	1.12	1.40	1.40	3.81	3.78	3.81	108
短期 (1-3)	347	99.45	99.64	2.03	0.83	1.10	1.10	2.01	2.00	2.01	99
中期 (3-7)	414	98.68	99.13	3.96	1.13	1.41	1.40	3.85	3.82	3.85	107
長期 (7-)	96	97.24	98.08	11.81	2.11	2.52	2.49	10.26	10.14	10.22	141
長期 (7-11)	36	91.85	92.19	8.66	0.98	2.11	2.03	8.27	8.19	8.26	119
超長期 (11-)	60	100.46	101.59	13.68	2.78	2.74	2.75	11.35	11.19	11.29	153
BBB 格	803	96.84	97.10	4.77	1.11	1.70	1.66	4.41	4.37	4.41	128
短期 (1-3)	172	99.32	99.53	1.92	0.85	1.19	1.18	1.90	1.88	1.90	109
中期 (3-7)	530	97.50	97.73	4.32	1.02	1.60	1.58	4.21	4.18	4.21	121
長期 (7-)	101	89.13	89.57	12.06	2.04	3.26	3.08	10.35	10.19	10.31	199
長期 (7-11)	46	94.00	94.40	9.30	1.86	2.67	2.60	8.48	8.37	8.46	171
超長期 (11-)	54	84.99	85.46	14.42	2.19	3.82	3.54	12.12	11.91	12.05	226
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	383	98.97	99.50	2.70	1.72	1.83	1.82	2.61	2.59	2.61	164
短期 (1-3)	231	100.60	101.35	1.73	2.25	1.86	1.86	1.69	1.67	1.69	179
中期 (3-7)	144	96.80	96.99	3.97	0.90	1.75	1.73	3.88	3.85	3.88	140
長期 (7-)	8	90.89	91.11	8.32	1.15	2.47	2.36	7.92	7.83	7.91	156
長期 (7-11)	8	90.89	91.11	8.32	1.15	2.47	2.36	7.92	7.83	7.91	156
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 (2023年10月末、11月ポートフォリオ)

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
AAA~AA 格	906	98.43	98.57	3.72	0.70	1.09	1.09	3.63	3.61	3.63	79
短期 (1-3)	434	99.30	99.43	2.31	0.60	0.89	0.89	2.29	2.28	2.29	74
中期 (3-7)	429	98.00	98.16	4.62	0.78	1.24	1.23	4.53	4.51	4.53	83
長期 (7-)	43	93.86	94.04	8.95	0.95	1.77	1.72	8.57	8.50	8.56	85
長期 (7-11)	43	93.86	94.04	8.95	0.95	1.77	1.72	8.57	8.50	8.56	85
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AAA~A 格	1,763	98.62	98.89	3.88	0.90	1.25	1.24	3.72	3.69	3.72	93
短期 (1-3)	841	99.68	99.91	2.25	0.84	1.01	1.01	2.22	2.21	2.22	87
中期 (3-7)	784	97.92	98.15	4.39	0.83	1.32	1.31	4.30	4.27	4.30	93
長期 (7-)	139	96.20	96.83	10.93	1.75	2.29	2.26	9.76	9.65	9.73	124
長期 (7-11)	79	92.94	93.19	8.82	0.96	1.92	1.86	8.43	8.36	8.43	101
超長期 (11-)	60	100.46	101.59	13.68	2.78	2.74	2.75	11.35	11.19	11.29	153
AAA~BBB 格	2,566	98.07	98.33	4.16	0.97	1.39	1.37	3.93	3.90	3.93	104
短期 (1-3)	1,014	99.62	99.85	2.19	0.84	1.04	1.04	2.17	2.16	2.17	91
中期 (3-7)	1,313	97.75	97.98	4.36	0.90	1.43	1.42	4.27	4.23	4.27	105
長期 (7-)	239	93.23	93.78	11.40	1.87	2.68	2.59	10.00	9.87	9.96	154
長期 (7-11)	125	93.33	93.64	9.00	1.30	2.20	2.13	8.45	8.36	8.44	127
超長期 (11-)	114	93.11	93.93	14.03	2.50	3.21	3.09	11.68	11.50	11.62	184
AAA~BB 格	2,566	98.07	98.33	4.16	0.97	1.39	1.37	3.93	3.90	3.93	104
短期 (1-3)	1,014	99.62	99.85	2.19	0.84	1.04	1.04	2.17	2.16	2.17	91
中期 (3-7)	1,313	97.75	97.98	4.36	0.90	1.43	1.42	4.27	4.23	4.27	105
長期 (7-)	239	93.23	93.78	11.40	1.87	2.68	2.59	10.00	9.87	9.96	154
長期 (7-11)	125	93.33	93.64	9.00	1.30	2.20	2.13	8.45	8.36	8.44	127
超長期 (11-)	114	93.11	93.93	14.03	2.50	3.21	3.09	11.68	11.50	11.62	184
AAA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA 格	906	98.43	98.57	3.72	0.70	1.09	1.09	3.63	3.61	3.63	79
短期 (1-3)	434	99.30	99.43	2.31	0.60	0.89	0.89	2.29	2.28	2.29	74
中期 (3-7)	429	98.00	98.16	4.62	0.78	1.24	1.23	4.53	4.51	4.53	83
長期 (7-)	43	93.86	94.04	8.95	0.95	1.77	1.72	8.57	8.50	8.56	85
長期 (7-11)	43	93.86	94.04	8.95	0.95	1.77	1.72	8.57	8.50	8.56	85
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
A 格	858	98.83	99.22	4.05	1.12	1.40	1.40	3.81	3.78	3.81	108
短期 (1-3)	407	100.08	100.43	2.18	1.09	1.14	1.14	2.15	2.13	2.15	101
中期 (3-7)	354	97.82	98.14	4.11	0.88	1.42	1.41	4.02	3.99	4.02	106
長期 (7-)	96	97.24	98.08	11.81	2.11	2.52	2.49	10.26	10.14	10.22	141
長期 (7-11)	36	91.85	92.19	8.66	0.98	2.11	2.03	8.27	8.19	8.26	119
超長期 (11-)	60	100.46	101.59	13.68	2.78	2.74	2.75	11.35	11.19	11.29	153
BBB 格	803	96.84	97.10	4.77	1.11	1.70	1.66	4.41	4.37	4.41	128
短期 (1-3)	172	99.32	99.53	1.92	0.85	1.19	1.18	1.90	1.88	1.90	109
中期 (3-7)	530	97.50	97.73	4.32	1.02	1.60	1.58	4.21	4.18	4.21	121
長期 (7-)	101	89.13	89.57	12.06	2.04	3.26	3.08	10.35	10.19	10.31	199
長期 (7-11)	46	94.00	94.40	9.30	1.86	2.67	2.60	8.48	8.37	8.46	171
超長期 (11-)	54	84.99	85.46	14.42	2.19	3.82	3.54	12.12	11.91	12.05	226
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	383	98.97	99.50	2.70	1.72	1.83	1.82	2.61	2.59	2.61	164
短期 (1-3)	231	100.60	101.35	1.73	2.25	1.86	1.86	1.69	1.67	1.69	179
中期 (3-7)	144	96.80	96.99	3.97	0.90	1.75	1.73	3.88	3.85	3.88	140
長期 (7-)	8	90.89	91.11	8.32	1.15	2.47	2.36	7.92	7.83	7.91	156
長期 (7-11)	8	90.89	91.11	8.32	1.15	2.47	2.36	7.92	7.83	7.91	156
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 (2023年10月末)

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
AAA~AA 格	136	98.20	98.39	3.70	0.71	1.09	1.08	3.61	3.59	3.61	79
短期 (1-3)	51	100.09	100.33	2.14	0.96	0.96	0.96	2.11	2.10	2.11	84
中期 (3-7)	78	97.62	97.78	4.30	0.55	1.12	1.11	4.23	4.21	4.23	74
長期 (7-)	7	91.02	91.16	8.28	0.60	1.85	1.77	8.06	7.99	8.06	97
長期 (7-11)	7	91.02	91.16	8.28	0.60	1.85	1.77	8.06	7.99	8.06	97
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AAA~A 格	1,386	98.48	98.77	3.86	0.89	1.28	1.27	3.69	3.66	3.69	96
短期 (1-3)	605	99.22	99.38	2.26	0.68	1.02	1.01	2.24	2.22	2.24	88
中期 (3-7)	671	98.19	98.52	4.12	0.94	1.35	1.34	4.03	4.00	4.03	99
長期 (7-)	109	96.23	96.96	11.07	1.76	2.32	2.29	9.84	9.72	9.80	126
長期 (7-11)	59	92.33	92.58	8.57	0.88	1.95	1.88	8.23	8.16	8.23	105
超長期 (11-)	50	100.87	102.17	14.04	2.81	2.72	2.73	11.57	11.41	11.50	149
AAA~BBB 格	2,540	97.94	98.22	4.06	1.02	1.47	1.46	3.84	3.80	3.83	113
短期 (1-3)	958	99.37	99.60	2.11	0.88	1.17	1.16	2.08	2.07	2.08	105
中期 (3-7)	1,349	97.78	98.07	4.19	0.97	1.49	1.47	4.09	4.06	4.09	112
長期 (7-)	234	92.95	93.51	11.40	1.89	2.74	2.64	9.98	9.85	9.95	159
長期 (7-11)	119	92.79	93.10	8.89	1.29	2.29	2.21	8.34	8.25	8.34	136
超長期 (11-)	114	93.11	93.93	14.03	2.50	3.21	3.09	11.68	11.50	11.62	184
AAA~BB 格	2,540	97.94	98.22	4.06	1.02	1.47	1.46	3.84	3.80	3.83	113
短期 (1-3)	958	99.37	99.60	2.11	0.88	1.17	1.16	2.08	2.07	2.08	105
中期 (3-7)	1,349	97.78	98.07	4.19	0.97	1.49	1.47	4.09	4.06	4.09	112
長期 (7-)	234	92.95	93.51	11.40	1.89	2.74	2.64	9.98	9.85	9.95	159
長期 (7-11)	119	92.79	93.10	8.89	1.29	2.29	2.21	8.34	8.25	8.34	136
超長期 (11-)	114	93.11	93.93	14.03	2.50	3.21	3.09	11.68	11.50	11.62	184
AAA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA 格	136	98.20	98.39	3.70	0.71	1.09	1.08	3.61	3.59	3.61	79
短期 (1-3)	51	100.09	100.33	2.14	0.96	0.96	0.96	2.11	2.10	2.11	84
中期 (3-7)	78	97.62	97.78	4.30	0.55	1.12	1.11	4.23	4.21	4.23	74
長期 (7-)	7	91.02	91.16	8.28	0.60	1.85	1.77	8.06	7.99	8.06	97
長期 (7-11)	7	91.02	91.16	8.28	0.60	1.85	1.77	8.06	7.99	8.06	97
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
A 格	1,250	98.51	98.81	3.87	0.91	1.30	1.29	3.70	3.67	3.70	98
短期 (1-3)	554	99.14	99.29	2.27	0.65	1.02	1.02	2.25	2.24	2.25	88
中期 (3-7)	594	98.26	98.62	4.10	0.99	1.38	1.37	4.00	3.98	4.00	102
長期 (7-)	102	96.60	97.37	11.27	1.85	2.35	2.32	9.95	9.84	9.92	128
長期 (7-11)	52	92.51	92.77	8.62	0.92	1.96	1.89	8.26	8.18	8.25	106
超長期 (11-)	50	100.87	102.17	14.04	2.81	2.72	2.73	11.57	11.41	11.50	149
BBB 格	1,154	97.28	97.57	4.32	1.18	1.71	1.68	4.01	3.97	4.01	134
短期 (1-3)	352	99.63	99.97	1.84	1.24	1.42	1.42	1.82	1.81	1.82	133
中期 (3-7)	678	97.38	97.61	4.25	1.00	1.63	1.61	4.14	4.11	4.14	125
長期 (7-)	124	90.05	90.47	11.70	1.99	3.13	2.97	10.12	9.97	10.09	191
長期 (7-11)	60	93.25	93.63	9.20	1.70	2.62	2.54	8.46	8.35	8.44	166
超長期 (11-)	64	87.07	87.53	14.02	2.26	3.64	3.41	11.78	11.59	11.72	216
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	216	100.35	100.90	1.91	1.72	1.39	1.40	1.87	1.85	1.87	131
短期 (1-3)	201	100.65	101.23	1.67	1.78	1.38	1.38	1.64	1.63	1.64	132
中期 (3-7)	13	97.20	97.35	4.73	0.97	1.56	1.55	4.62	4.59	4.62	113
長期 (7-)	2	90.75	90.87	8.26	0.51	1.80	1.72	8.08	8.01	8.08	91
長期 (7-11)	2	90.75	90.87	8.26	0.51	1.80	1.72	8.08	8.01	8.08	91
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 (2023年10月末、11月ポートフォリオ)

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
AAA~AA 格	206	98.75	98.90	4.00	0.71	0.97	0.96	3.90	3.88	3.90	63
短期 (1-3)	84	100.05	100.22	2.42	0.77	0.77	0.77	2.40	2.39	2.40	61
中期 (3-7)	108	98.25	98.39	4.59	0.63	1.04	1.03	4.51	4.49	4.51	63
長期 (7-)	14	94.69	94.85	9.03	0.94	1.65	1.61	8.66	8.59	8.65	73
長期 (7-11)	14	94.69	94.85	9.03	0.94	1.65	1.61	8.66	8.59	8.65	73
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AAA~A 格	1,579	98.55	98.82	4.00	0.89	1.26	1.25	3.84	3.81	3.84	93
短期 (1-3)	692	99.64	99.89	2.37	0.83	1.02	1.02	2.34	2.33	2.34	87
中期 (3-7)	767	97.91	98.13	4.38	0.82	1.32	1.31	4.30	4.27	4.30	93
長期 (7-)	121	96.40	97.07	10.96	1.73	2.25	2.22	9.78	9.67	9.75	120
長期 (7-11)	71	93.22	93.46	8.78	0.96	1.89	1.83	8.40	8.32	8.39	98
超長期 (11-)	50	100.87	102.17	14.04	2.81	2.72	2.73	11.57	11.41	11.50	149
AAA~BBB 格	2,733	98.01	98.29	4.13	1.02	1.45	1.43	3.91	3.88	3.91	110
短期 (1-3)	1,044	99.64	99.92	2.19	0.97	1.16	1.15	2.16	2.15	2.16	103
中期 (3-7)	1,445	97.66	97.89	4.32	0.90	1.46	1.45	4.22	4.19	4.22	108
長期 (7-)	245	93.18	93.72	11.33	1.86	2.68	2.59	9.95	9.82	9.91	155
長期 (7-11)	130	93.23	93.54	8.97	1.30	2.23	2.15	8.42	8.33	8.42	129
超長期 (11-)	114	93.11	93.93	14.03	2.50	3.21	3.09	11.68	11.50	11.62	184
AAA~BB 格	2,733	98.01	98.29	4.13	1.02	1.45	1.43	3.91	3.88	3.91	110
短期 (1-3)	1,044	99.64	99.92	2.19	0.97	1.16	1.15	2.16	2.15	2.16	103
中期 (3-7)	1,445	97.66	97.89	4.32	0.90	1.46	1.45	4.22	4.19	4.22	108
長期 (7-)	245	93.18	93.72	11.33	1.86	2.68	2.59	9.95	9.82	9.91	155
長期 (7-11)	130	93.23	93.54	8.97	1.30	2.23	2.15	8.42	8.33	8.42	129
超長期 (11-)	114	93.11	93.93	14.03	2.50	3.21	3.09	11.68	11.50	11.62	184
AAA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA 格	206	98.75	98.90	4.00	0.71	0.97	0.96	3.90	3.88	3.90	63
短期 (1-3)	84	100.05	100.22	2.42	0.77	0.77	0.77	2.40	2.39	2.40	61
中期 (3-7)	108	98.25	98.39	4.59	0.63	1.04	1.03	4.51	4.49	4.51	63
長期 (7-)	14	94.69	94.85	9.03	0.94	1.65	1.61	8.66	8.59	8.65	73
長期 (7-11)	14	94.69	94.85	9.03	0.94	1.65	1.61	8.66	8.59	8.65	73
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
A 格	1,373	98.52	98.81	4.00	0.92	1.30	1.29	3.83	3.80	3.83	97
短期 (1-3)	607	99.58	99.84	2.36	0.84	1.06	1.05	2.33	2.32	2.33	91
中期 (3-7)	659	97.85	98.09	4.35	0.85	1.37	1.35	4.26	4.23	4.26	98
長期 (7-)	107	96.61	97.36	11.21	1.83	2.33	2.30	9.92	9.81	9.89	126
長期 (7-11)	57	92.86	93.12	8.72	0.96	1.95	1.88	8.33	8.26	8.33	104
超長期 (11-)	50	100.87	102.17	14.04	2.81	2.72	2.73	11.57	11.41	11.50	149
BBB 格	1,154	97.28	97.57	4.32	1.18	1.71	1.68	4.01	3.97	4.01	134
短期 (1-3)	352	99.63	99.97	1.84	1.24	1.42	1.42	1.82	1.81	1.82	133
中期 (3-7)	678	97.38	97.61	4.25	1.00	1.63	1.61	4.14	4.11	4.14	125
長期 (7-)	124	90.05	90.47	11.70	1.99	3.13	2.97	10.12	9.97	10.09	191
長期 (7-11)	60	93.25	93.63	9.20	1.70	2.62	2.54	8.46	8.35	8.44	166
超長期 (11-)	64	87.07	87.53	14.02	2.26	3.64	3.41	11.78	11.59	11.72	216
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	216	100.35	100.90	1.91	1.72	1.39	1.40	1.87	1.85	1.87	131
短期 (1-3)	201	100.65	101.23	1.67	1.78	1.38	1.38	1.64	1.63	1.64	132
中期 (3-7)	13	97.20	97.35	4.73	0.97	1.56	1.55	4.62	4.59	4.62	113
長期 (7-)	2	90.75	90.87	8.26	0.51	1.80	1.72	8.08	8.01	8.08	91
長期 (7-11)	2	90.75	90.87	8.26	0.51	1.80	1.72	8.08	8.01	8.08	91
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

出所:NFRC

- 格付は、S&P の格付をもとに NFRC で分類

NOMURA-BPI 総合・ポートフォリオ指標の推移

	2019年3月末	2020年3月末	2021年3月末	2022年3月末	2023年3月末	2023年10月末
銘柄数	12,853	13,875	14,702	15,303	15,524	15,847
額面(10億円)	954,968	970,751	1,016,799	1,055,162	1,084,026	1,111,513
時価単価(円)	109.41	108.41	106.49	104.20	101.51	96.80
利含単価(円)	109.54	108.53	106.60	104.31	101.62	96.97
残存年数(年)	9.69	9.85	9.89	10.02	10.17	10.15
利率(%)	0.95	0.89	0.83	0.79	0.77	0.77
単利(%)	0.02	0.08	0.14	0.27	0.43	0.86
複利(%)	0.02	0.08	0.14	0.27	0.43	0.83
Dur(年)	9.30	9.47	9.36	9.32	9.19	8.79
M-Dur	9.29	9.46	9.35	9.30	9.16	8.73
E-Dur	9.27	9.46	9.34	9.29	9.16	8.75
Tspd(bp)	4	5	4	3	5	5

出所:NFRFC

NOMURA-BPI の定義

NOMURA-BPI の銘柄組入基準

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

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

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

累積投資収益指数の計算方法

ある時点における投資収益指数は以下の計算式から算出される。

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

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

各ポートフォリオの累積投資収益指数は以下の基準日を 100 としている。

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

ただし、

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

投資収益率の計算方法

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

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

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

レポートの表記等について

投資収益率 投資収益指数

- 「前月末からの投資収益率」は、「2023 年 9 月の月末営業日から 2023 年 10 月の月末営業日までの投資収益率（年率換算、%）」を指す。
- 「前年度末からの投資収益率」は、「2023 年 3 月の月末営業日から 2023 年 10 月の月末営業日までの投資収益率（年率換算、%）」を指す。
- 「前年末からの投資収益率」は、「2022 年 12 月の月末営業日から 2023 年 10 月の月末営業日までの投資収益率（年率換算、%）」を指す。

月間投資収益率

- 2023 年 9 月の月末営業日から 2023 年 10 月の月末営業日までの投資収益率（年率換算、%）。
- 2023 年 9 月の月末営業日において、10 月ポートフォリオに組み入れられるべき銘柄がない場合には「-」と表記。

ポートフォリオ指標

- 時価単価・利合単価・残存年数・利率は額面加重平均。単利・複利・Tspd は時価総額加重平均。Dur・M-Dur・E-Dur は経過利子込時価総額加重平均。
- 「残存年数」は、「途中償還を考慮した平均残存年数」を指す。
- 「Dur」は、「デュレーション」を指す。
- 「M-Dur」は、「修正デュレーション」を指す。
- 「E-Dur」は、「実効デュレーション」を指す。
- 「Tspd」は、「T スプレッド」を指す。
- 左ページには 10 月ポートフォリオの、右ページには 11 月ポートフォリオの、2023 年 10 月の月末営業日における指標を掲載。

現存額

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

格付会社別ポートフォリオ指標

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

その他

- 短期・中期・長期などの残存別ポートフォリオは、2023 年 10 月末（暦上）における残存年数（至最終償還日）で区分。ただし 11 月ポートフォリオでは、2023 年 11 月末（暦上）における残存年数（至最終償還日）で区分。
- NOMURA-BPI は、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社の商標または登録商標です。

NOMURA-BPI のデータ提供について

NOMURA-BPI のデータは以下の情報端末でもご覧いただけます。

Quick-IS

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

REUTERS

NMSBPI メニュー

Bloomberg

NBPI(GO) メニュー

時事通信社

BPIG/12400

NFRC Web ページ

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

ディスクレイマー

NOMURA-BPI の知的財産権およびその他一切の権利は野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社（以下、NFRC）に帰属します。
なお、NFRC は、当インデックスの正確性、完全性、信頼性、有用性、市場性、商品性および適合性を保証するものではなく、インデックスの利用者およびその関連会社が当インデックスを用いて行う事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。
インデックスの算出において、電子計算機の障害もしくは天災地変その他やむを得ない事由が発生した場合は、インデックスの公表を延期または中止することがあります。
インデックス・データを取得した経路（当社ウェブサイト、情報ベンダー各社のサービスを通じた取得、等）に関わらず、これらのインデックスをご利用の際は、「インデックス・ライセンスについて」をご確認ください。

「インデックス・ライセンスについて」

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

本資料は、お客様への情報提供を目的として、NFRC が作成したものです。

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

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

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

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

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

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

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