



月間投資収益率 (2024年7月末)

累積投資 収益指数	前月末からの投資収益率			過去からの期間投資収益率	
	トータル	キャピタル	インカム	前年度末	前年末
総合 357.155	-1.10	-1.93	0.83	-7.50	-5.17

出所: 野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング(NFRC)

(注) 投資収益率は年率換算(%)

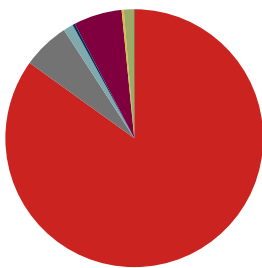
ポートフォリオ指標 (2024年7月末)

	翌月ポート (2024年8月)	当月ポート (2024年7月)	差
額面[兆円]	1148.53	1137.09	11.44
デュレーション[年]	8.70	8.67	0.04
修正デュレーション	8.64	8.60	0.04
時価単価[円]	95.57	95.54	0.04
利含単価[円]	95.78	95.74	0.04
残存年数[年]	10.23	10.19	0.04
利率[%]	0.80	0.79	0.01
単利[%]	1.05	1.05	0.00
複利[%]	1.02	1.02	0.00
Tスプレッド[bp]	4	4	0

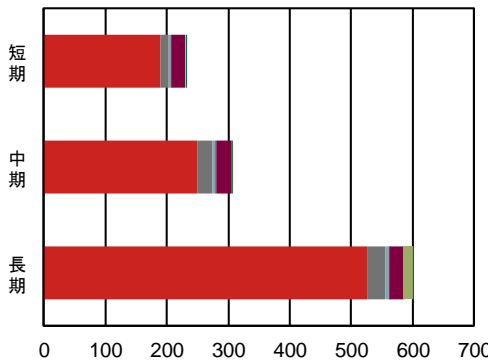
出所: NFRC

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

銘柄別額面構成 (2024年7月末)



残存別額面構成 (2024年7月末)



出所: NFRC

出所: NFRC

(兆円)

	国債	地方債	政保債	金融債	事業債	円建外債	MBS	ABS
構成比	84.9%	5.9%	1.2%	0.3%	6.1%	0.3%	1.2%	0.1%
全体	965.64	67.04	14.16	3.44	68.93	3.08	14.10	0.70
短期	190.46	12.82	3.32	2.03	20.42	1.60	-	0.23
中期	249.99	24.53	4.35	1.24	25.03	1.20	-	0.29
長期	525.19	29.69	6.50	0.18	23.48	0.28	14.10	0.19

出所: NFRC

(兆円)

目次

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

銘柄別・投資収益率(2024年7月末)

	累積投資 収益指数	前月末からの投資収益率			過去からの投資収益率	
		トータル	キャピタル	インカム	前年度末	前年末
総合	357.155	-1.10	-1.93	0.83	-7.50	-5.17
国債	367.297	-1.08	-1.94	0.85	-7.96	-5.54
地方債	385.149	-0.85	-1.47	0.62	-4.85	-3.26
政保債	359.607	-0.82	-1.57	0.75	-6.54	-4.23
金融債	271.899	-1.78	-2.04	0.26	-1.64	-1.36
事業債	383.791	-1.71	-2.46	0.76	-4.80	-2.84
円建外債	355.212	-0.36	-1.41	1.05	-0.05	0.55
MBS	122.774	-0.83	-1.50	0.67	-6.02	-4.15
ABS	112.532	-1.07	-1.81	0.74	-3.32	-2.36

出所:NFRC

投資収益率は年率換算(%)

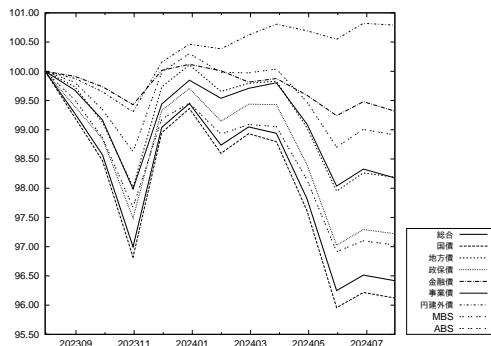
銘柄別・累積投資収益指数の推移

年/月/日	総合	国債	地方債	政保債	金融債	事業債	円建外債	MBS	ABS
2023/07/31	370.426	382.115	392.260	369.886	273.762	390.921	352.432	126.534	113.771
2023/08/31	367.761	379.098	391.224	367.657	273.527	389.661	352.004	125.918	113.558
2023/09/29	365.131	376.276	388.838	365.613	273.040	387.667	351.204	125.093	113.026
2023/10/31	359.310	369.972	384.497	360.606	272.197	383.050	349.978	123.591	112.207
2023/11/30	366.877	378.104	391.217	367.399	273.808	388.732	352.982	125.500	113.756
2023/12/29	368.384	379.681	392.689	368.807	274.089	390.324	354.068	125.847	114.116
2024/01/31	365.748	376.748	390.907	366.730	273.788	389.119	353.786	125.176	113.750
2024/02/29	366.902	378.041	391.457	367.807	273.255	389.783	354.618	125.381	113.740
2024/03/29	366.497	377.512	391.595	367.776	273.423	390.152	355.274	125.336	113.814
2024/04/30	362.353	373.000	388.461	363.973	272.639	387.392	354.877	124.185	113.176
2024/05/31	356.531	366.662	384.217	358.882	271.686	383.242	354.364	122.629	112.297
2024/06/28	357.511	367.658	385.446	359.874	272.337	384.383	355.328	122.865	112.641
2024/07/01	357.013	367.119	385.028	359.423	272.322	384.053	355.090	122.720	112.562
2024/07/02	356.413	366.480	384.478	358.858	272.207	383.599	354.984	122.488	112.452
2024/07/03	356.332	366.377	384.575	358.791	272.317	383.567	355.120	122.504	112.491
2024/07/04	356.583	366.630	384.913	359.025	272.427	383.817	355.310	122.616	112.577
2024/07/05	356.668	366.710	385.119	359.131	272.441	383.911	355.528	122.641	112.622
2024/07/08	356.377	366.405	384.792	358.861	272.332	383.656	355.354	122.573	112.553
2024/07/09	356.532	366.559	385.046	359.004	272.445	383.814	355.410	122.641	112.616
2024/07/10	356.207	366.195	384.924	358.717	272.468	383.606	355.476	122.558	112.582
2024/07/11	356.309	366.311	384.958	358.893	272.449	383.634	355.497	122.579	112.582
2024/07/12	357.421	367.509	385.877	359.922	272.637	384.462	355.837	122.902	112.771
2024/07/16	357.953	368.075	386.368	360.413	272.764	384.894	356.161	123.054	112.885
2024/07/17	357.811	367.936	386.147	360.262	272.684	384.726	356.000	122.995	112.829
2024/07/18	357.819	367.963	386.009	360.256	272.573	384.629	355.977	122.967	112.783
2024/07/19	357.901	368.062	385.980	360.339	272.536	384.653	355.959	122.970	112.768
2024/07/22	357.518	367.633	385.791	360.005	272.564	384.445	355.988	122.884	112.748
2024/07/23	357.291	367.393	385.563	359.793	272.480	384.254	355.938	122.816	112.697
2024/07/24	356.950	367.027	385.289	359.487	272.369	383.944	355.858	122.738	112.634
2024/07/25	357.177	367.303	385.259	359.659	272.213	383.973	355.773	122.729	112.597
2024/07/26	357.557	367.717	385.526	360.010	272.209	384.217	355.773	122.844	112.640
2024/07/29	358.327	368.541	386.205	360.713	272.390	384.833	356.064	123.078	112.792
2024/07/30	358.838	369.076	386.750	361.208	272.532	385.262	356.309	123.271	112.914
2024/07/31	357.155	367.297	385.149	359.607	271.899	383.791	355.212	122.774	112.532

出所:NFRC

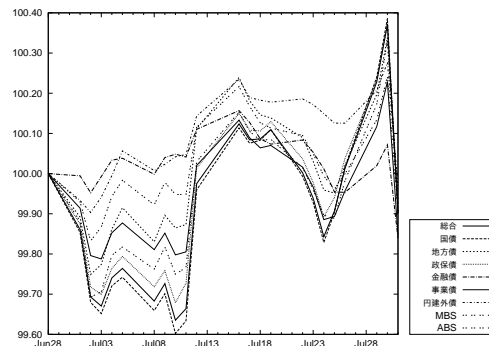
1983年12月末=100。MBSセクターは2003年3月末=100。ABSセクターは2008年3月末=100。

指数の推移(月次) 2023年7月末=100に補正。



出所:NFRC

指数の推移(日次) 2024年6月末=100に補正。



出所:NFRC

総合 残存別・投資収益率 (2024年7月末)

	累積投資 収益指数	前月末からの投資収益率			過去からの投資収益率	
		トータル	キャピタル	インカム	前年度末	前年末
総合	357.155	-1.10	-1.93	0.83	-7.50	-5.17
短期 (1-3)	233.183	-1.69	-2.08	0.39	-0.95	-0.87
中期 (3-7)	333.757	-2.74	-3.38	0.64	-3.17	-2.54
長期 (7-)	520.024	0.06	-1.06	1.12	-12.49	-8.32
長期 (7-11)	190.452	-0.26	-1.24	0.97	-6.08	-4.10
超長期 (11-)	228.852	0.26	-0.95	1.21	-16.26	-10.79
(11-15)	219.331	1.88	0.85	1.04	-10.37	-6.48
(15-)	234.235	-0.32	-1.59	1.27	-18.37	-12.32

出所:NFRC

投資収益率は年率換算 (%)

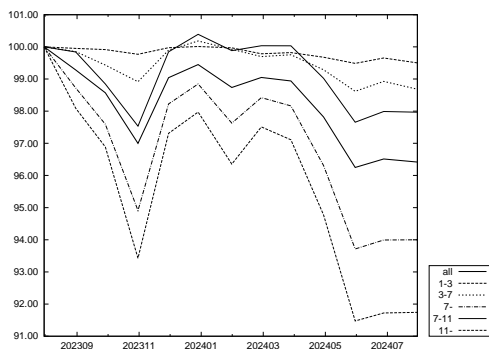
総合 残存別・投資収益指数の推移

総合 年/月/日	全体	短期 (1-3)	中期 (3-7)	長期 (7-)	長期*			
					長期* (7-11)	超長期* (11-)	(11-15)*	(15-)*
2023/07/31	370.426	234.353	338.216	553.224	194.403	249.447	228.461	259.576
2023/08/31	367.761	234.242	337.716	546.155	194.094	244.681	226.958	253.445
2023/09/29	365.131	234.156	336.305	539.912	192.157	241.681	224.358	250.261
2023/10/31	359.310	233.813	334.547	525.066	189.609	233.049	219.298	240.100
2023/11/30	366.877	234.294	337.869	543.408	194.102	242.740	226.749	250.768
2023/12/29	368.384	234.378	338.833	546.833	195.161	244.389	228.039	252.571
2024/01/31	365.748	234.282	337.961	540.108	194.175	240.354	226.074	247.692
2024/02/29	366.902	233.846	337.190	544.488	194.470	243.240	227.529	251.157
2024/03/29	366.497	233.935	337.386	543.065	194.467	242.237	227.344	249.824
2024/04/30	362.353	233.598	335.805	532.811	192.503	236.411	223.575	243.144
2024/05/31	356.531	233.147	333.537	518.449	189.847	228.179	218.413	233.650
2024/06/28	357.511	233.539	334.586	519.995	190.497	228.799	218.958	234.303
2024/07/01	357.013	233.548	334.377	518.736	190.221	228.109	218.459	233.535
2024/07/02	356.413	233.504	334.114	517.281	189.818	227.373	217.813	232.759
2024/07/03	356.332	233.575	334.333	516.791	189.898	226.967	217.707	232.235
2024/07/04	356.583	233.621	334.584	517.251	190.191	227.078	217.983	232.285
2024/07/05	356.668	233.603	334.662	517.445	190.404	227.060	218.225	232.166
2024/07/08	356.377	233.550	334.439	516.851	190.143	226.831	217.899	231.973
2024/07/09	356.532	233.597	334.652	517.068	190.377	226.813	218.027	231.899
2024/07/10	356.207	233.633	334.648	516.102	190.220	226.243	217.694	231.235
2024/07/11	356.309	233.632	334.572	516.465	190.237	226.488	217.805	231.532
2024/07/12	357.421	233.703	334.991	519.234	190.829	228.016	218.968	233.211
2024/07/16	357.953	233.755	335.270	520.471	191.169	228.643	219.508	233.877
2024/07/17	357.811	233.720	335.094	520.250	190.998	228.612	219.292	233.916
2024/07/18	357.819	233.655	334.870	520.529	190.896	228.884	219.297	234.292
2024/07/19	357.901	233.633	334.782	520.861	190.822	229.174	219.378	234.664
2024/07/22	357.518	233.660	334.779	519.736	190.717	228.454	219.053	233.788
2024/07/23	357.291	233.606	334.652	519.246	190.566	228.217	218.777	233.564
2024/07/24	356.950	233.542	334.444	518.502	190.405	227.808	218.600	233.063
2024/07/25	357.177	233.428	334.202	519.473	190.368	228.523	218.896	233.944
2024/07/26	357.557	233.412	334.228	520.557	190.533	229.170	219.331	234.677
2024/07/29	358.327	233.489	334.621	522.361	190.995	230.110	220.064	235.703
2024/07/30	358.838	233.544	334.943	523.499	191.390	230.627	220.666	236.191
2024/07/31	357.155	233.183	333.757	520.024	190.452	228.852	219.331	234.235

出所:NFRC

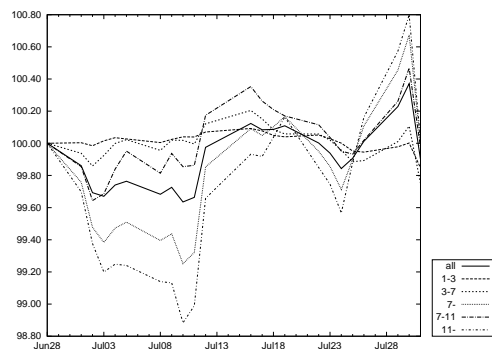
* は 1995年12月末=100。それ以外は、1983年12月末=100。

指数の推移 (月次) 2023年7月末=100に補正。



出所:NFRC

指数の推移 (日次) 2024年6月末=100に補正。



出所:NFRC

国債 残存別・投資収益率 (2024年7月末)

国債	累積投資 収益指数	前月末からの投資収益率			過去からの投資収益率	
		トータル	キャピタル	インカム	前年度末	前年末
国債	367.297	-1.08	-1.94	0.85	-7.96	-5.54
短期 (1-3)	220.511	-1.72	-2.10	0.38	-1.00	-0.92
中期 (3-7)	332.596	-2.82	-3.48	0.65	-3.27	-2.67
長期 (7-)	529.860	0.07	-1.07	1.14	-12.97	-8.72
長期 (7-11)	188.969	-0.31	-1.30	0.98	-6.19	-4.25
超長期 (11-)	227.590	0.31	-0.93	1.24	-16.94	-11.32
(11-15)	217.871	1.95	0.89	1.06	-10.50	-6.65
(15-)	233.119	-0.28	-1.58	1.31	-19.24	-12.98

出所:NFRC

投資収益率は年率換算 (%)

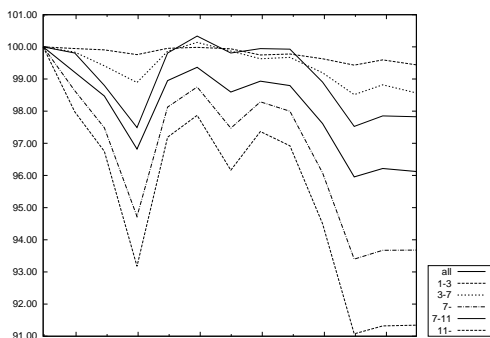
国債 残存別・投資収益指数の推移

国債 年/月/日	全体	短期 (1-3)	中期 (3-7)	長期 (7-)	長期*			
					長期* (7-11)	超長期* (11-)	(11-15)*	(15-)*
2023/07/31	382.115	221.754	337.431	565.612	193.170	249.154	227.207	259.815
2023/08/31	379.098	221.638	336.877	557.899	192.799	244.125	225.661	253.299
2023/09/29	376.276	221.548	335.443	551.388	190.852	241.059	223.053	250.022
2023/10/31	369.972	221.219	333.693	535.772	188.324	232.150	218.060	239.413
2023/11/30	378.104	221.653	336.972	555.024	192.800	242.152	225.500	250.540
2023/12/29	379.681	221.718	337.902	558.559	193.819	243.845	226.756	252.421
2024/01/31	376.748	221.618	336.994	551.309	192.800	239.595	224.741	247.251
2024/02/29	378.041	221.194	336.185	555.938	193.064	242.595	226.168	250.893
2024/03/29	377.512	221.262	336.327	554.290	193.031	241.486	225.933	249.426
2024/04/30	373.000	220.931	334.713	543.451	191.054	235.449	222.150	242.446
2024/05/31	366.662	220.496	332.417	528.266	188.388	226.914	216.973	232.523
2024/06/28	367.658	220.855	333.447	529.824	189.023	227.526	217.488	233.177
2024/07/01	367.119	220.862	333.236	528.504	188.747	226.817	216.990	232.381
2024/07/02	366.480	220.821	332.969	526.998	188.346	226.071	216.345	231.591
2024/07/03	366.377	220.888	333.187	526.468	188.428	225.644	216.248	231.035
2024/07/04	366.630	220.931	333.438	526.922	188.719	225.745	216.521	231.070
2024/07/05	366.710	220.913	333.514	527.095	188.930	225.711	216.759	230.931
2024/07/08	366.405	220.863	333.290	526.486	188.669	225.481	216.433	230.737
2024/07/09	366.559	220.906	333.503	526.692	188.901	225.455	216.559	230.651
2024/07/10	366.195	220.939	333.490	525.667	188.739	224.865	216.229	229.958
2024/07/11	366.311	220.937	333.413	526.054	188.755	225.121	216.340	230.271
2024/07/12	367.509	221.004	333.831	528.954	189.343	226.692	217.498	232.013
2024/07/16	368.075	221.051	334.108	530.242	189.680	227.334	218.037	232.700
2024/07/17	367.936	221.019	333.931	530.035	189.511	227.314	217.825	232.753
2024/07/18	367.963	220.957	333.707	530.356	189.411	227.609	217.833	233.160
2024/07/19	368.062	220.936	333.618	530.722	189.336	227.916	217.915	233.557
2024/07/22	367.633	220.961	333.613	529.517	189.231	227.162	217.588	232.632
2024/07/23	367.393	220.909	333.486	529.010	189.081	226.922	217.312	232.404
2024/07/24	367.027	220.850	333.279	528.227	188.923	226.496	217.135	231.880
2024/07/25	367.303	220.743	333.039	529.288	188.887	227.255	217.435	232.820
2024/07/26	367.717	220.727	333.063	530.428	189.049	227.923	217.869	233.584
2024/07/29	368.541	220.799	333.457	532.309	189.509	228.885	218.599	234.642
2024/07/30	369.076	220.849	333.779	533.473	189.900	229.402	219.200	235.131
2024/07/31	367.297	220.511	332.596	529.860	188.969	227.590	217.871	233.119

出所:NFRC

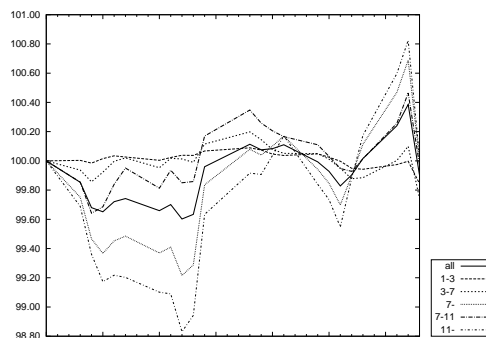
* は 1995年12月末=100。それ以外は、1983年12月末=100。

指数の推移 (月次) 2023年7月末=100に補正。



出所:NFRC

指数の推移 (日次) 2024年6月末=100に補正。



出所:NFRC

このページは空白です。

「除くMBS」残存別・投資収益率(2024年7月末)

	累積投資 収益指数	前月末からの投資収益率			過去からの投資収益率	
		トータル	キャピタル	インカム	前年度末	前年末
除くMBS	357.033	-1.10	-1.94	0.83	-7.52	-5.19
短期(1-3)	233.183	-1.69	-2.08	0.39	-0.95	-0.87
中期(3-7)	333.757	-2.74	-3.38	0.64	-3.17	-2.54
長期(7-)	521.764	0.08	-1.05	1.13	-12.65	-8.43
長期(7-11)	190.445	-0.26	-1.24	0.98	-6.08	-4.10
超長期(11-)	230.448	0.30	-0.93	1.23	-16.66	-11.05
(11-15)	219.320	1.88	0.85	1.04	-10.37	-6.48
(15-)	236.041	-0.30	-1.59	1.30	-19.02	-12.76

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(%)

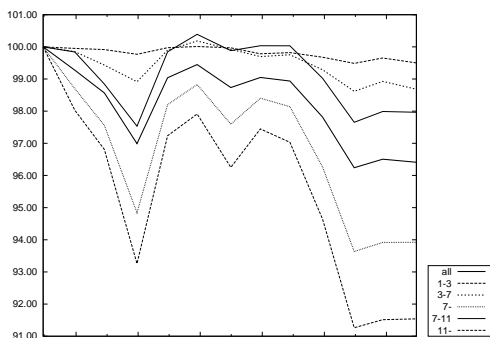
「除くMBS」残存別・投資収益指数の推移

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-)*
2023/07/31	370.329	234.353	338.216	555.520	194.399	251.747	228.449	262.626
2023/08/31	367.653	234.242	337.716	548.310	194.090	246.796	226.946	256.156
2023/09/29	365.021	234.156	336.305	541.973	192.152	243.713	224.345	252.853
2023/10/31	359.183	233.813	334.547	526.856	189.601	234.777	219.285	242.183
2023/11/30	366.774	234.294	337.869	545.524	194.098	244.789	226.737	253.340
2023/12/29	368.287	234.378	338.833	549.012	195.158	246.491	228.028	255.223
2024/01/31	365.643	234.282	337.961	542.163	194.171	242.313	226.063	250.100
2024/02/29	366.803	233.846	337.190	546.648	194.467	245.321	227.518	253.766
2024/03/29	366.395	233.935	337.386	545.189	194.464	244.274	227.333	252.351
2024/04/30	362.243	233.598	335.805	534.764	192.498	238.257	223.564	245.365
2024/05/31	356.406	233.147	333.537	520.160	189.840	229.754	218.402	235.435
2024/06/28	357.390	233.539	334.586	521.725	190.490	230.386	218.947	236.104
2024/07/01	356.891	233.548	334.377	520.445	190.214	229.674	218.448	235.303
2024/07/02	356.293	233.504	334.114	518.974	189.811	228.921	217.802	234.503
2024/07/03	356.210	233.575	334.333	518.468	189.891	228.495	217.697	233.944
2024/07/04	356.459	233.621	334.584	518.929	190.184	228.603	217.973	233.984
2024/07/05	356.545	233.603	334.662	519.126	190.397	228.581	218.214	233.856
2024/07/08	356.253	233.550	334.439	518.523	190.136	228.346	217.888	233.657
2024/07/09	356.407	233.597	334.652	518.738	190.370	228.322	218.016	233.571
2024/07/10	356.081	233.633	334.648	517.754	190.213	227.733	217.684	232.874
2024/07/11	356.184	233.632	334.572	518.125	190.230	227.987	217.795	233.188
2024/07/12	357.298	233.703	334.991	520.938	190.822	229.563	218.957	234.939
2024/07/16	357.830	233.755	335.270	522.195	191.163	230.208	219.498	235.630
2024/07/17	357.689	233.720	335.094	521.974	190.991	230.180	219.282	235.679
2024/07/18	357.698	233.655	334.870	522.263	190.890	230.467	219.286	236.081
2024/07/19	357.781	233.633	334.782	522.604	190.815	230.771	219.367	236.477
2024/07/22	357.396	233.660	334.779	521.456	190.710	230.023	219.043	235.554
2024/07/23	357.169	233.606	334.652	520.959	190.559	229.780	218.767	235.323
2024/07/24	356.826	233.542	334.444	520.203	190.398	229.358	218.589	234.799
2024/07/25	357.057	233.428	334.202	521.203	190.361	230.107	218.886	235.736
2024/07/26	357.437	233.412	334.228	522.305	190.526	230.776	219.320	236.504
2024/07/29	358.208	233.489	334.621	524.135	190.988	231.742	220.053	237.569
2024/07/30	358.718	233.544	334.943	525.284	191.383	232.269	220.655	238.068
2024/07/31	357.033	233.183	333.757	521.764	190.445	230.448	219.320	236.041

出所:NFRC

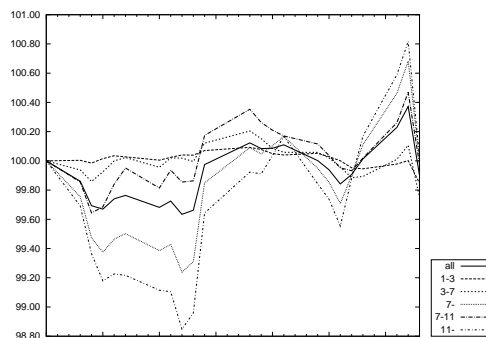
* は1995年12月末=100。それ以外は、1983年12月末=100。

指数の推移(月次) 2023年7月末=100に補正。



出所:NFRC

指数の推移(日次) 2024年6月末=100に補正。



出所:NFRC

「除く ABS」「SDGs」残存別・投資収益率 (2024年7月末)

	累積投資 収益指数	前月末からの投資収益率			過去からの投資収益率	
		トータル	キャピタル	インカム	前年度末	前年末
除く ABS	357.179	-1.10	-1.93	0.83	-7.51	-5.18
短期 (1-3)	233.148	-1.69	-2.08	0.39	-0.95	-0.87
中期 (3-7)	333.748	-2.74	-3.38	0.64	-3.17	-2.54
長期 (7-)	520.022	0.06	-1.06	1.12	-12.49	-8.32
長期 (7-11)	190.445	-0.26	-1.24	0.97	-6.08	-4.10
超長期 (11-)	228.850	0.26	-0.95	1.21	-16.27	-10.79
(11-15)	219.323	1.88	0.85	1.04	-10.37	-6.48
(15-)	234.237	-0.32	-1.59	1.27	-18.37	-12.32
SDGs	97.961	-1.55	-2.12	0.56	-4.99	-3.22

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 (%)

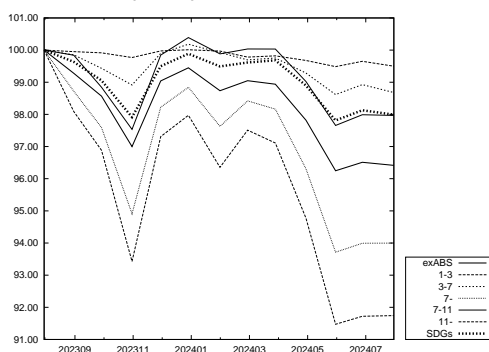
「除く ABS」「SDGs」残存別 投資収益指数の推移

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 *				SDGs**
					(7-11)*	(11-)*	(11-15)*	(15-)*	
2023/07/31	370.457	234.319	338.210	553.229	194.397	249.447	228.453	259.578	99.968
2023/08/31	367.790	234.208	337.710	546.157	194.088	244.680	226.950	253.447	99.602
2023/09/29	365.159	234.122	336.298	539.914	192.152	241.680	224.350	250.264	99.026
2023/10/31	359.336	233.779	334.540	525.066	189.603	233.047	219.290	240.102	97.885
2023/11/30	366.905	234.260	337.862	543.410	194.096	242.738	226.740	250.770	99.468
2023/12/29	368.412	234.343	338.826	546.835	195.155	244.387	228.030	252.573	99.855
2024/01/31	365.776	234.247	337.953	540.108	194.169	240.352	226.066	247.694	99.461
2024/02/29	366.930	233.811	337.182	544.489	194.464	243.238	227.521	251.159	99.583
2024/03/29	366.525	233.900	337.379	543.066	194.461	242.236	227.336	249.826	99.650
2024/04/30	362.379	233.563	335.797	532.811	192.497	236.409	223.567	243.146	98.866
2024/05/31	356.555	233.112	333.529	518.448	189.841	228.177	218.404	233.652	97.783
2024/06/28	357.535	233.504	334.578	519.993	190.491	228.797	218.950	234.305	98.099
2024/07/01	357.037	233.513	334.369	518.734	190.215	228.107	218.451	233.537	98.003
2024/07/02	356.437	233.469	334.106	517.279	189.812	227.371	217.805	232.761	97.873
2024/07/03	356.356	233.540	334.325	516.789	189.892	226.965	217.699	232.237	97.887
2024/07/04	356.606	233.586	334.576	517.248	190.185	227.076	217.975	232.286	97.963
2024/07/05	356.692	233.568	334.654	517.442	190.398	227.057	218.217	232.168	98.002
2024/07/08	356.400	233.515	334.431	516.849	190.137	226.828	217.891	231.974	97.924
2024/07/09	356.555	233.562	334.644	517.065	190.370	226.810	218.018	231.901	97.982
2024/07/10	356.230	233.598	334.640	516.100	190.214	226.241	217.686	231.236	97.936
2024/07/11	356.333	233.596	334.564	516.463	190.231	226.486	217.797	231.534	97.944
2024/07/12	357.445	233.668	334.983	519.231	190.823	228.013	218.959	233.213	98.161
2024/07/16	357.977	233.720	335.262	520.469	191.163	228.641	219.500	233.879	98.279
2024/07/17	357.835	233.685	335.085	520.248	190.992	228.610	219.284	233.918	98.231
2024/07/18	357.843	233.620	334.862	520.527	190.890	228.882	219.288	234.294	98.202
2024/07/19	357.925	233.598	334.774	520.859	190.815	229.172	219.370	234.666	98.195
2024/07/22	357.542	233.625	334.771	519.734	190.710	228.452	219.045	233.789	98.147
2024/07/23	357.315	233.570	334.643	519.243	190.559	228.215	218.769	233.566	98.094
2024/07/24	356.973	233.507	334.436	518.500	190.399	227.806	218.591	233.065	98.009
2024/07/25	357.201	233.393	334.194	519.471	190.362	228.521	218.888	233.946	98.006
2024/07/26	357.581	233.377	334.220	520.555	190.527	229.168	219.323	234.679	98.065
2024/07/29	358.352	233.454	334.613	522.359	190.988	230.108	220.056	235.704	98.231
2024/07/30	358.862	233.509	334.935	523.497	191.383	230.624	220.658	236.192	98.358
2024/07/31	357.179	233.148	333.748	520.022	190.445	228.850	219.323	234.237	97.961

出所:NFRC

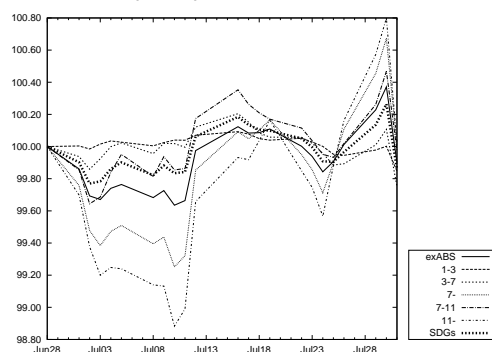
* は 1995 年 12 月末=100。 ** は 2017 年 12 月末=100。それ以外は、1983 年 12 月末=100。

指数の推移 (月次) 2023 年 7 月末=100 に補正。



出所:NFRC

指数の推移 (日次) 2024 年 6 月末=100 に補正。



出所:NFRC

「除く国債」残存別・投資収益率(2024年7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	168.463	-1.20	-1.89	0.69	-4.90	-3.13
短期(1-3)	133.042	-1.55	-1.95	0.41	-0.70	-0.59
中期(3-7)	165.375	-2.37	-2.97	0.60	-2.72	-2.00
長期(7-)	227.898	-0.04	-0.97	0.93	-9.05	-5.50
長期(7-11)	196.168	0.08	-0.82	0.90	-5.29	-3.07
超長期(11-)	230.494	-0.11	-1.06	0.95	-11.37	-6.99

出所:NFRC

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

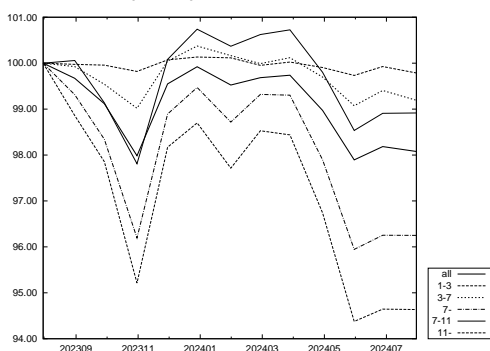
「除く国債」残存別・投資収益指数の推移

除く国債 年/月/日	全体	短期 (1-3)	中期 (3-7)	長期 (7-)	長期*	超長期*
					(7-11)	(11-)
2023/07/31	171.766	133.327	166.723	236.776	198.319	243.560
2023/08/31	171.201	133.293	166.598	235.153	198.434	240.783
2023/09/29	170.251	133.269	165.958	232.849	196.608	238.336
2023/10/31	168.303	133.086	165.085	227.764	193.978	231.899
2023/11/30	170.991	133.422	166.800	234.156	198.481	239.103
2023/12/29	171.632	133.505	167.346	235.524	199.785	240.393
2024/01/31	170.949	133.481	166.998	233.738	199.050	237.992
2024/02/29	171.225	133.263	166.706	235.165	199.556	239.975
2024/03/29	171.316	133.358	166.920	235.126	199.759	239.759
2024/04/30	170.000	133.200	166.220	231.797	197.926	235.626
2024/05/31	168.150	132.971	165.176	227.176	195.414	229.863
2024/06/28	168.645	133.228	165.731	227.905	196.153	230.517
2024/07/01	168.479	133.235	165.636	227.465	195.884	229.988
2024/07/02	168.254	133.209	165.515	226.897	195.479	229.351
2024/07/03	168.267	133.250	165.623	226.776	195.540	229.104
2024/07/04	168.394	133.279	165.747	227.022	195.837	229.288
2024/07/05	168.456	133.271	165.788	227.181	196.063	229.383
2024/07/08	168.333	133.241	165.681	226.934	195.807	229.166
2024/07/09	168.420	133.269	165.785	227.071	196.047	229.213
2024/07/10	168.343	133.294	165.804	226.775	195.932	228.807
2024/07/11	168.363	133.293	165.768	226.880	195.953	228.967
2024/07/12	168.748	133.339	165.976	227.854	196.561	230.124
2024/07/16	168.950	133.373	166.117	228.316	196.912	230.626
2024/07/17	168.867	133.350	166.030	228.166	196.727	230.518
2024/07/18	168.821	133.313	165.923	228.175	196.617	230.615
2024/07/19	168.823	133.302	165.883	228.238	196.548	230.771
2024/07/22	168.732	133.320	165.885	227.922	196.448	230.322
2024/07/23	168.642	133.289	165.823	227.729	196.298	230.116
2024/07/24	168.517	133.250	165.719	227.481	196.117	229.840
2024/07/25	168.520	133.185	165.597	227.691	196.077	230.218
2024/07/26	168.635	133.175	165.614	228.056	196.257	230.689
2024/07/29	168.919	133.223	165.805	228.716	196.722	231.433
2024/07/30	169.134	133.257	165.962	229.201	197.128	231.933
2024/07/31	168.463	133.042	165.375	227.898	196.168	230.494

出所:NFRC

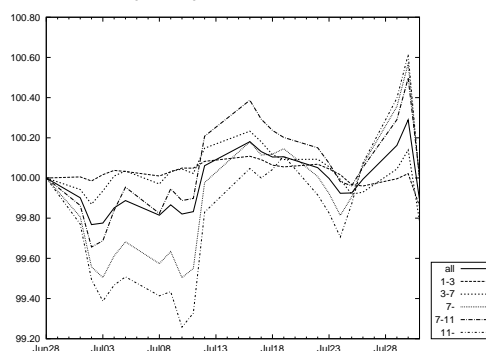
* は 1995年12月末=100。それ以外は、1993年12月末=100。

指数の推移(月次) 2023年7月末=100に補正。



出所:NFRC

指数の推移(日次) 2024年6月末=100に補正。



出所:NFRC

銘柄 残存別・月間投資収益率(2024年7月末)

	全体	短期 (1-3)	中期 (3-7)	長期 (7-)		
					(7-11)	(11-)
総合	-1.10	-1.69	-2.74	0.06	-0.26	0.26
国債	-1.08	-1.72	-2.82	0.07	-0.31	0.31
30年国債	0.57	-	-2.71	0.63	0.32	0.66
20年国債	-0.12	-1.88	-2.76	1.07	0.00	1.76
10年国債	-1.90	-1.85	-2.83	-0.67	-0.67	-
5年国債	-2.34	-1.84	-2.90	-	-	-
中期国債	-1.07	-1.07	-	-	-	-
地方債	-0.85	-1.59	-2.27	0.72	0.39	1.09
東京都債	-0.86	-1.43	-2.06	0.89	0.55	1.43
五大都市債	-0.60	-1.50	-2.08	0.95	0.53	1.19
その他地方債	-0.88	-1.59	-2.24	0.64	0.33	1.00
政保債	-0.82	-1.73	-2.66	1.05	0.98	1.08
公営企業債券	-2.28	-1.70	-2.94	-	-	-
その他政保債	-0.63	-1.74	-2.60	1.05	0.98	1.08
金融債	-1.78	-1.39	-2.60	-0.50	-0.50	-
特定金融債	-	-	-	-	-	-
事業債	-1.71	-1.55	-2.47	-0.95	-0.57	-1.28
円建外債	-0.36	-1.10	-1.32	8.34	4.22	13.23
MBS	-0.83	-	-	-0.83	-1.66	-0.81
ABS	-1.07	-1.15	-2.16	0.87	-0.34	2.52

出所:NFRC

「除く(銘柄)」残存別・月間投資収益率(2024年7月末)

	全体	短期 (1-3)	中期 (3-7)	長期 (7-)		
					(7-11)	(11-)
除く国債	-1.20	-1.55	-2.37	-0.04	0.08	-0.11
除く30年国債	-1.40	-1.69	-2.74	-0.18	-0.31	-0.05
除く20年国債	-1.46	-1.66	-2.74	-0.48	-0.41	-0.52
除く10年国債	-0.82	-1.62	-2.68	0.21	0.06	0.26
除く5年国債	-0.95	-1.63	-2.71	0.06	-0.26	0.26
除く中期国債	-1.10	-1.79	-2.74	0.06	-0.26	0.26
除く地方債	-1.12	-1.70	-2.78	0.03	-0.31	0.23
除く東京都債	-1.10	-1.69	-2.75	0.06	-0.27	0.26
除く五大都市債	-1.10	-1.69	-2.75	0.06	-0.27	0.25
除くその他地方債	-1.11	-1.69	-2.77	0.04	-0.29	0.24
除く政保債	-1.10	-1.69	-2.74	0.05	-0.27	0.25
除く公営企業債券	-1.10	-1.69	-2.74	0.06	-0.26	0.26
除くその他政保債	-1.11	-1.69	-2.74	0.05	-0.27	0.25
除く金融債	-1.10	-1.69	-2.74	0.06	-0.26	0.26
除く特定金融債	-1.10	-1.69	-2.74	0.06	-0.26	0.26
除く事業債	-1.06	-1.70	-2.76	0.10	-0.25	0.31
除く円建外債	-1.10	-1.69	-2.75	0.06	-0.27	0.25
除くMBS	-1.10	-1.69	-2.74	0.08	-0.26	0.30
除くABS	-1.10	-1.69	-2.74	0.06	-0.26	0.26
除くMBS・ABS	-1.10	-1.69	-2.74	0.08	-0.26	0.30

出所:NFRC

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

事業債 業種別・月間投資収益率(2024年7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	-1.71	-1.55	-2.47	-0.95	-0.57	-1.28
水産・農林業	-	-	-	-	-	-
鉱業	-1.49	-0.96	-2.04	-1.48	-1.48	-
建設業	-1.85	-1.73	-2.52	0.73	-0.34	2.25
食料品	-1.49	-1.66	-2.58	0.74	-0.06	2.13
繊維製品	-1.70	-2.14	-2.40	1.76	1.01	2.45
パルプ・紙	-1.32	-1.44	-2.39	1.11	-0.19	2.52
化学	-1.38	-1.65	-2.49	0.87	-0.47	2.65
医薬品	-1.23	-1.61	-2.50	-0.39	-1.26	2.06
石油・石炭製品	-1.16	-1.31	-2.23	-0.11	-0.58	1.88
ゴム製品	-1.96	-1.75	-2.38	-0.70	-0.70	-
ガラス・土石製品	-1.23	-1.48	-2.36	0.64	-0.09	2.46
鉄鋼	-1.85	-1.69	-2.60	0.43	0.06	2.64
非鉄金属	-1.95	-1.86	-2.56	-0.25	-0.25	-
金属製品	-2.18	-1.50	-2.53	-0.65	-0.65	-
機械	-1.82	-1.55	-2.56	-0.63	-0.63	-
電気機器	-1.84	-1.63	-2.53	0.26	0.26	-
輸送用機器	-1.44	-1.55	-2.45	0.88	-0.24	2.38
精密機器	-1.86	-1.88	-2.35	-0.04	-0.04	-
その他製品	-1.49	-2.05	-2.90	1.29	-1.47	2.34
電気・ガス業	-2.42	-1.53	-2.43	-2.90	-1.67	-4.23
陸運業	-2.63	-1.45	-2.44	-3.01	-0.65	-4.20
海運業	-1.58	-1.49	-2.42	0.54	0.54	-
空運業	0.67	-1.38	-2.57	2.51	1.77	3.25
倉庫・運輸関連業	-1.15	-0.73	-2.49	1.65	1.12	2.15
情報・通信業	-1.01	-1.11	-1.75	1.71	0.77	3.74
卸売業	-2.29	-1.74	-2.83	-1.77	-1.84	-1.62
小売業	-1.49	-1.17	-2.42	0.61	0.15	2.39
銀行業	-1.70	-1.18	-2.29	-0.37	-0.37	-
証券・商品先物取引業	-1.31	-1.04	-2.13	-0.58	-0.58	-
保険業	-1.97	-1.92	-2.58	-0.63	-0.63	-
その他金融業	-1.98	-1.38	-2.31	-3.32	-4.02	2.66
不動産業	-1.18	-1.74	-2.42	0.45	-0.06	1.20
サービス業	3.15	-3.86	-2.23	24.13	26.31	15.80
財投機関債	-1.34	-1.66	-2.67	0.00	-0.24	0.10

出所:NFRFC

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

事業債 円建外債 格付別・月間投資収益率(2024年7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	-1.65	-1.52	-2.42	-0.84	-0.50	-1.13
AAA～AA 格	-1.80	-1.56	-2.54	-1.21	-0.83	-1.48
AAA 格	-2.30	-1.58	-2.64	-3.16	-2.50	-4.28
AA 格	-1.67	-1.56	-2.51	-0.98	-0.53	-1.28
A 格	-1.26	-1.41	-2.14	0.37	0.26	0.54
事業債 全体	-1.71	-1.55	-2.47	-0.95	-0.57	-1.28
AAA～AA 格	-1.82	-1.58	-2.58	-1.23	-0.87	-1.49
AAA 格	-2.30	-1.58	-2.64	-3.16	-2.50	-4.28
AA 格	-1.69	-1.57	-2.56	-1.01	-0.58	-1.29
A 格	-1.39	-1.48	-2.21	-0.02	0.14	-0.26
円建外債 全体	-0.36	-1.10	-1.32	8.34	4.22	13.23
AAA～AA 格	-1.06	-1.29	-1.45	4.54	3.79	16.74
AAA 格	-	-	-	-	-	-
AA 格	-1.06	-1.29	-1.45	4.54	3.79	16.74
A 格	0.20	-0.96	-1.19	9.67	4.57	13.12

出所:NFRFC

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

事業債 円建外債 最高格付別・月間投資収益率(2024年7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	-1.82	-1.58	-2.58	-1.23	-0.87	-1.49
AAA~A格	-1.71	-1.55	-2.47	-0.95	-0.57	-1.28
AAA~BBB格	-1.71	-1.55	-2.47	-0.95	-0.57	-1.28
AAA~BB格	-1.71	-1.55	-2.47	-0.95	-0.57	-1.28
AAA格	-2.30	-1.58	-2.64	-3.16	-2.50	-4.28
AA格	-1.69	-1.57	-2.56	-1.01	-0.58	-1.29
A格	-1.39	-1.48	-2.21	-0.02	0.14	-0.26
BBB格	-	-	-	-	-	-
BB格	-	-	-	-	-	-
B格以下	-	-	-	-	-	-
格付なし	-	-	-	-	-	-
円建外債						
AAA~AA格	-1.06	-1.29	-1.45	4.54	3.79	16.74
AAA~A格	-0.36	-1.10	-1.32	8.34	4.22	13.23
AAA~BBB格	-0.36	-1.10	-1.32	8.34	4.22	13.23
AAA~BB格	-0.36	-1.10	-1.32	8.34	4.22	13.23
AAA格	-	-	-	-	-	-
AA格	-1.06	-1.29	-1.45	4.54	3.79	16.74
A格	0.20	-0.96	-1.19	9.67	4.57	13.12
BBB格	-	-	-	-	-	-
BB格	-	-	-	-	-	-
B格以下	-	-	-	-	-	-
格付なし	-	-	-	-	-	-

出所:NFRFC

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

事業債 円建外債 最低格付別・月間投資収益率(2024年7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	-1.96	-1.52	-2.54	-1.58	-0.10	-2.89
AAA~A格	-1.68	-1.55	-2.50	-0.87	-0.56	-1.14
AAA~BBB格	-1.71	-1.55	-2.50	-0.96	-0.57	-1.30
AAA~BB格	-1.71	-1.55	-2.47	-0.95	-0.57	-1.28
AAA格	-	-	-	-	-	-
AA格	-1.96	-1.52	-2.54	-1.58	-0.10	-2.89
A格	-1.63	-1.56	-2.49	-0.76	-0.62	-0.88
BBB格	-2.69	-1.46	-2.51	-4.31	-0.95	-8.19
BB格	0.80	-	0.27	5.87	-	5.87
B格以下	-	-	-	-	-	-
格付なし	-	-	-	-	-	-
円建外債						
AAA~AA格	-1.18	-1.21	-1.63	2.71	2.71	-
AAA~A格	-0.85	-1.18	-1.62	5.35	3.14	8.37
AAA~BBB格	-0.36	-1.10	-1.32	8.34	4.22	13.23
AAA~BB格	-0.36	-1.10	-1.32	8.34	4.22	13.23
AAA格	-	-	-	-	-	-
AA格	-1.18	-1.21	-1.63	2.71	2.71	-
A格	-0.80	-1.18	-1.62	5.61	3.22	8.37
BBB格	0.61	-0.90	-0.82	12.30	5.88	18.65
BB格	-	-	-	-	-	-
B格以下	-	-	-	-	-	-
格付なし	-	-	-	-	-	-

出所:NFRFC

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

事業債 円建外債 R&I 格付別・月間投資収益率(2024年7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	-1.69	-1.62	-2.60	-0.86	-0.68	-0.97
AAA~A 格	-1.77	-1.55	-2.50	-1.17	-0.94	-1.36
AAA~BBB 格	-1.77	-1.55	-2.50	-1.17	-0.93	-1.36
AAA~BB 格	-1.77	-1.55	-2.50	-1.17	-0.93	-1.36
AAA 格	-1.78	-1.70	-2.48	0.34	-0.34	2.08
AA 格	-1.69	-1.62	-2.61	-0.86	-0.68	-0.98
A 格	-1.90	-1.45	-2.36	-1.77	-1.26	-2.47
BBB 格	-0.97	-0.66	-1.68	2.25	2.25	-
BB 格	-	-	-	-	-	-
B 格以下	-	-	-	-	-	-
格付なし	-0.99	-1.55	-2.25	2.49	3.40	0.73
円建外債						
AAA~AA 格	-0.93	-0.93	-	-	-	-
AAA~A 格	-1.17	-1.24	-1.44	3.02	3.02	-
AAA~BBB 格	-1.17	-1.24	-1.44	3.02	3.02	-
AAA~BB 格	-1.17	-1.24	-1.44	3.02	3.02	-
AAA 格	-	-	-	-	-	-
AA 格	-0.93	-0.93	-	-	-	-
A 格	-1.18	-1.27	-1.44	3.02	3.02	-
BBB 格	-	-	-	-	-	-
BB 格	-	-	-	-	-	-
B 格以下	-	-	-	-	-	-
格付なし	-0.10	-1.05	-1.28	8.96	4.50	13.23

出所:NFRFC

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

事業債 円建外債 JCR 格付別・月間投資収益率(2024年7月末)

	全体	短期 (1-3)	中期 (3-7)	長期 (7-)	月間投資収益率	
					(7-11)	(11-)
事業債						
AAA~AA 格	-2.07	-1.52	-2.58	-1.98	-1.41	-2.77
AAA~A 格	-1.79	-1.51	-2.44	-1.12	-0.77	-1.63
AAA~BBB 格	-1.79	-1.51	-2.44	-1.12	-0.77	-1.63
AAA~BB 格	-1.79	-1.51	-2.44	-1.12	-0.77	-1.63
AAA 格	-2.31	-1.57	-2.65	-3.16	-2.50	-4.28
AA 格	-1.93	-1.48	-2.54	-1.60	-1.03	-2.35
A 格	-1.12	-1.50	-2.08	0.61	0.47	0.82
BBB 格	-	-	-	-	-	-
BB 格	-	-	-	-	-	-
B 格以下	-	-	-	-	-	-
格付なし	-1.58	-1.62	-2.53	-0.80	-0.24	-1.08
円建外債						
AAA~AA 格	-0.16	-1.31	0.13	7.44	5.29	16.74
AAA~A 格	1.17	-1.05	-0.71	10.64	5.36	14.00
AAA~BBB 格	1.17	-1.05	-0.71	10.64	5.36	14.00
AAA~BB 格	1.17	-1.05	-0.71	10.64	5.36	14.00
AAA 格	-	-	-	-	-	-
AA 格	-0.16	-1.31	0.13	7.44	5.29	16.74
A 格	1.64	-0.94	-1.00	11.07	5.39	13.90
BBB 格	-	-	-	-	-	-
BB 格	-	-	-	-	-	-
B 格以下	-	-	-	-	-	-
格付なし	-1.09	-1.12	-1.51	3.71	3.17	6.86

出所:NFRFC

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

事業債 円建外債 Moody's 格付別・月間投資収益率(2024年7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	-1.59	-1.64	-2.66	-0.60	-0.52	-0.64
AAA~BBB 格	-1.67	-1.65	-2.58	-0.82	-0.57	-0.98
AAA~BB 格	-1.67	-1.65	-2.58	-0.82	-0.57	-0.98
AAA 格	-	-	-	-	-	-
AA 格	-	-	-	-	-	-
A 格	-1.59	-1.64	-2.66	-0.60	-0.52	-0.64
BBB 格	-2.55	-1.74	-2.00	-4.03	-1.05	-7.04
BB 格	-	-	-	-	-	-
B 格以下	-	-	-	-	-	-
格付なし	-1.73	-1.50	-2.42	-1.05	-0.57	-1.56
円建外債						
AAA~AA 格	-1.24	-1.25	-1.66	3.09	3.09	-
AAA~A 格	-0.82	-1.20	-1.61	5.40	3.18	8.18
AAA~BBB 格	-0.34	-1.15	-1.35	8.50	4.30	13.23
AAA~BB 格	-0.34	-1.15	-1.35	8.50	4.30	13.23
AAA 格	-	-	-	-	-	-
AA 格	-1.24	-1.25	-1.66	3.09	3.09	-
A 格	-0.29	-1.15	-1.47	6.51	3.32	8.18
BBB 格	1.10	-0.94	-0.76	14.15	6.65	21.13
BB 格	-	-	-	-	-	-
B 格以下	-	-	-	-	-	-
格付なし	-0.62	-0.70	-0.80	2.71	2.71	-

出所:NFRFC

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

事業債 円建外債 S&P 格付別・月間投資収益率(2024年7月末)

	全体	短期 (1-3)	中期 (3-7)	長期 (7-)	月間投資収益率	
					(7-11)	(11-)
事業債						
AAA~AA 格	-3.15	-2.09	-2.35	-3.38	-0.66	-5.00
AAA~A 格	-1.96	-1.62	-2.58	-1.62	-1.36	-1.83
AAA~BBB 格	-1.95	-1.60	-2.58	-1.60	-1.35	-1.82
AAA~BB 格	-1.91	-1.60	-2.47	-1.58	-1.35	-1.76
AAA 格	-	-	-	-	-	-
AA 格	-3.15	-2.09	-2.35	-3.38	-0.66	-5.00
A 格	-1.90	-1.61	-2.59	-1.43	-1.42	-1.43
BBB 格	-1.61	-1.33	-2.49	0.21	-0.40	2.64
BB 格	0.80	-	0.27	5.87	-	5.87
B 格以下	-	-	-	-	-	-
格付なし	-1.64	-1.54	-2.47	-0.70	-0.26	-1.09
円建外債						
AAA~AA 格	-1.25	-1.36	-1.66	2.71	2.71	-
AAA~A 格	-0.83	-1.19	-1.55	5.40	3.17	8.37
AAA~BBB 格	-0.36	-1.14	-1.32	8.39	4.25	13.23
AAA~BB 格	-0.36	-1.14	-1.32	8.39	4.25	13.23
AAA 格	-	-	-	-	-	-
AA 格	-1.25	-1.36	-1.66	2.71	2.71	-
A 格	-0.78	-1.16	-1.53	5.66	3.25	8.37
BBB 格	0.62	-1.01	-0.88	12.30	5.88	18.65
BB 格	-	-	-	-	-	-
B 格以下	-	-	-	-	-	-
格付なし	-0.31	-0.21	-1.20	1.99	1.99	-

出所:NFRFC

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

このページは空白です。

銘柄残存別・ポートフォリオ指標(2024年7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	1,137,092	95.54	95.74	10.19	0.79	1.05	1.02	8.67	8.60	8.62	4
短期(1-3)	230,880	99.87	99.97	1.94	0.39	0.44	0.44	1.93	1.92	1.93	6
中期(3-7)	306,614	99.93	100.08	4.79	0.64	0.67	0.67	4.71	4.69	4.71	4
長期(7-)	599,597	91.62	91.89	16.12	1.03	1.52	1.46	13.69	13.58	13.61	3
長期(7-11)	207,903	100.20	100.43	8.70	0.98	0.97	0.97	8.33	8.29	8.33	3
超長期(11-)	391,694	87.06	87.36	20.06	1.05	1.85	1.75	16.97	16.81	16.84	4
(11-15)	94,348	95.32	95.60	12.90	0.99	1.40	1.37	12.05	11.97	12.03	4
(15-)	297,346	84.44	84.74	22.34	1.07	2.02	1.88	18.73	18.54	18.56	4
国債	965,641	95.46	95.67	10.68	0.82	1.05	1.01	9.04	8.97	8.99	1
短期(1-3)	190,464	99.96	100.05	1.92	0.38	0.40	0.40	1.91	1.91	1.91	1
中期(3-7)	249,992	100.21	100.37	4.79	0.66	0.62	0.63	4.71	4.70	4.71	0
長期(7-)	525,186	91.56	91.85	16.65	1.05	1.53	1.45	14.10	13.99	14.01	1
長期(7-11)	180,561	100.55	100.79	8.72	0.99	0.94	0.94	8.35	8.31	8.34	0
超長期(11-)	344,625	86.85	87.17	20.81	1.08	1.89	1.76	17.59	17.43	17.44	1
(11-15)	82,480	95.83	96.12	12.96	1.01	1.38	1.35	12.10	12.02	12.08	1
(15-)	262,145	84.03	84.35	23.27	1.10	2.08	1.91	19.55	19.36	19.36	1
地方債	67,041	96.70	96.87	7.35	0.60	0.91	0.92	6.76	6.72	6.74	9
短期(1-3)	12,816	99.73	99.83	1.99	0.37	0.49	0.49	1.99	1.98	1.99	10
中期(3-7)	24,532	98.83	98.96	4.93	0.50	0.72	0.72	4.86	4.84	4.86	8
長期(7-)	29,693	93.64	93.87	11.66	0.78	1.27	1.30	10.62	10.54	10.57	10
政保債	14,162	95.56	95.66	9.27	0.71	1.02	0.98	7.95	7.90	7.92	6
短期(1-3)	3,316	99.47	99.52	1.95	0.20	0.45	0.45	1.94	1.94	1.94	7
中期(3-7)	4,347	99.84	99.92	4.47	0.58	0.66	0.66	4.41	4.40	4.41	5
長期(7-)	6,499	90.70	90.85	16.21	1.07	1.60	1.51	13.92	13.80	13.85	7
金融債	3,443	98.43	98.50	3.09	0.26	0.75	0.75	3.04	3.03	3.04	26
短期(1-3)	2,030	99.02	99.06	1.99	0.16	0.64	0.63	1.99	1.98	1.99	24
中期(3-7)	1,235	98.00	98.10	4.16	0.38	0.87	0.86	4.12	4.10	4.12	27
長期(7-)	178	94.74	94.88	8.13	0.59	1.33	1.29	7.92	7.87	7.92	40
事業債	68,929	95.44	95.60	7.53	0.72	1.20	1.16	6.41	6.36	6.38	38
短期(1-3)	20,424	99.37	99.46	2.02	0.44	0.75	0.75	2.01	2.00	2.01	35
中期(3-7)	25,026	98.43	98.59	4.69	0.67	1.00	1.00	4.61	4.58	4.61	38
長期(7-)	23,480	88.83	89.05	15.33	1.02	1.88	1.76	12.83	12.70	12.73	42
長期(7-11)	10,019	96.56	96.78	8.58	0.97	1.43	1.40	8.22	8.16	8.21	47
超長期(11-)	13,460	83.08	83.30	20.35	1.07	2.27	2.07	16.81	16.63	16.64	37
円建外債	3,078	98.85	99.06	3.67	1.04	1.34	1.33	3.50	3.47	3.50	79
短期(1-3)	1,605	99.49	99.66	2.13	0.94	1.16	1.16	2.10	2.09	2.10	75
中期(3-7)	1,197	98.44	98.65	4.09	0.98	1.37	1.36	4.00	3.97	4.00	78
長期(7-)	276	96.92	97.32	10.82	1.86	2.26	2.22	9.60	9.49	9.57	111
長期(7-11)	150	96.37	96.64	8.46	1.34	1.86	1.83	7.98	7.91	7.97	91
超長期(11-)	126	97.58	98.14	13.65	2.49	2.73	2.68	11.51	11.36	11.45	133
MBS	14,099	94.36	94.39	7.35	0.63	0.86	1.36	6.83	6.78	7.08	22
ABS	697	95.46	95.63	5.59	0.71	1.37	1.33	5.16	5.12	5.15	67
短期(1-3)	227	99.36	99.52	1.89	0.69	0.99	0.98	1.88	1.87	1.88	61
中期(3-7)	285	96.67	96.84	5.06	0.66	1.32	1.30	4.95	4.92	4.95	66
長期(7-)	185	88.81	88.99	10.92	0.81	1.98	1.86	9.99	9.90	9.98	76

出所:NFRIC

「除く」銘柄 残存別・ポートフォリオ指標 (2024年7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	1,122,992	95.55	95.76	10.22	0.80	1.05	1.01	8.69	8.63	8.64	4
短期 (1-3)	230,880	99.87	99.97	1.94	0.39	0.44	0.44	1.93	1.92	1.93	6
中期 (3-7)	306,614	99.93	100.08	4.79	0.64	0.67	0.67	4.71	4.69	4.71	4
長期 (7-)	585,498	91.55	91.83	16.33	1.04	1.54	1.46	13.86	13.75	13.77	3
長期 (7-11)	207,714	100.20	100.44	8.71	0.98	0.97	0.97	8.34	8.29	8.33	3
超長期 (11-)	377,784	86.80	87.10	20.53	1.07	1.89	1.77	17.37	17.21	17.22	3
(11-15)	94,348	95.32	95.60	12.90	0.99	1.40	1.37	12.05	11.97	12.03	4
(15-)	283,436	83.96	84.27	23.07	1.09	2.08	1.91	19.38	19.19	19.18	3
除く ABS	1,136,394	95.54	95.74	10.19	0.79	1.05	1.02	8.67	8.61	8.63	4
短期 (1-3)	230,653	99.87	99.97	1.94	0.39	0.44	0.44	1.93	1.92	1.93	6
中期 (3-7)	306,329	99.93	100.09	4.79	0.64	0.67	0.67	4.71	4.69	4.71	4
長期 (7-)	599,412	91.62	91.89	16.12	1.03	1.52	1.45	13.69	13.58	13.61	3
長期 (7-11)	207,802	100.20	100.44	8.70	0.98	0.97	0.97	8.33	8.29	8.33	3
超長期 (11-)	391,610	87.06	87.36	20.06	1.05	1.85	1.75	16.97	16.81	16.84	4
(11-15)	94,292	95.32	95.60	12.90	0.99	1.40	1.37	12.05	11.97	12.03	4
(15-)	297,318	84.45	84.74	22.34	1.07	2.02	1.88	18.73	18.55	18.56	4
除く MBS・ABS	1,122,295	95.55	95.76	10.22	0.80	1.05	1.01	8.69	8.63	8.65	4
短期 (1-3)	230,653	99.87	99.97	1.94	0.39	0.44	0.44	1.93	1.92	1.93	6
中期 (3-7)	306,329	99.93	100.09	4.79	0.64	0.67	0.67	4.71	4.69	4.71	4
長期 (7-)	585,313	91.55	91.83	16.34	1.04	1.54	1.46	13.86	13.75	13.77	3
長期 (7-11)	207,613	100.20	100.44	8.71	0.98	0.97	0.97	8.34	8.30	8.33	3
超長期 (11-)	377,700	86.80	87.10	20.53	1.07	1.89	1.76	17.37	17.21	17.22	3
(11-15)	94,292	95.32	95.60	12.90	0.99	1.40	1.37	12.05	11.97	12.03	4
(15-)	283,408	83.96	84.27	23.07	1.09	2.08	1.91	19.38	19.19	19.18	3
除く 国債	171,450	95.97	96.12	7.42	0.66	1.04	1.06	6.58	6.54	6.58	24
短期 (1-3)	40,417	99.48	99.57	2.01	0.40	0.65	0.65	2.00	1.99	2.00	26
中期 (3-7)	56,623	98.69	98.83	4.76	0.59	0.86	0.86	4.68	4.66	4.68	23
長期 (7-)	74,411	92.00	92.19	12.39	0.86	1.41	1.47	10.83	10.74	10.82	22
長期 (7-11)	27,343	97.86	98.08	8.55	0.88	1.18	1.16	8.21	8.17	8.21	23
超長期 (11-)	47,068	88.60	88.76	14.62	0.84	1.56	1.67	12.51	12.39	12.50	22

出所:NFRG

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

銘柄 残存別・ポートフォリオ指標 (2024年7月末、8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	1,148,527	95.57	95.78	10.23	0.80	1.05	1.02	8.70	8.64	8.66	4
短期 (1-3)	231,002	99.87	99.97	1.96	0.39	0.44	0.44	1.95	1.94	1.95	6
中期 (3-7)	310,659	99.92	100.08	4.80	0.65	0.67	0.67	4.72	4.70	4.72	4
長期 (7-)	606,866	91.71	91.98	16.16	1.03	1.52	1.46	13.72	13.61	13.63	3
長期 (7-11)	210,884	100.20	100.44	8.72	0.98	0.97	0.97	8.35	8.31	8.35	3
超長期 (11-)	395,983	87.18	87.48	20.12	1.06	1.86	1.75	17.00	16.84	16.87	4
(11-15)	94,558	95.29	95.57	12.90	0.99	1.40	1.38	12.05	11.97	12.03	4
(15-)	301,425	84.64	84.94	22.39	1.08	2.02	1.89	18.74	18.56	18.57	4
国債	976,182	95.50	95.71	10.72	0.82	1.06	1.01	9.07	9.01	9.02	1
短期 (1-3)	190,460	99.96	100.06	1.93	0.39	0.40	0.40	1.93	1.92	1.93	2
中期 (3-7)	253,555	100.20	100.36	4.80	0.66	0.63	0.63	4.71	4.70	4.71	0
長期 (7-)	532,167	91.66	91.95	16.68	1.06	1.54	1.45	14.12	14.00	14.02	1
長期 (7-11)	183,341	100.55	100.79	8.74	0.99	0.94	0.95	8.36	8.32	8.36	0
超長期 (11-)	348,826	86.99	87.30	20.86	1.09	1.90	1.76	17.61	17.45	17.46	1
(11-15)	82,622	95.82	96.11	12.96	1.01	1.38	1.35	12.10	12.02	12.08	1
(15-)	266,204	84.25	84.57	23.31	1.12	2.08	1.91	19.55	19.37	19.36	1
地方債	67,253	96.70	96.88	7.41	0.61	0.92	0.93	6.82	6.78	6.80	9
短期 (1-3)	12,756	99.71	99.81	2.05	0.37	0.50	0.49	2.04	2.04	2.04	10
中期 (3-7)	24,707	98.82	98.95	4.98	0.50	0.73	0.72	4.91	4.89	4.91	9
長期 (7-)	29,790	93.67	93.90	11.72	0.79	1.28	1.30	10.67	10.59	10.61	10
政保債	14,169	95.55	95.65	9.37	0.72	1.03	0.99	8.06	8.00	8.03	6
短期 (1-3)	3,258	99.41	99.46	2.07	0.20	0.47	0.47	2.07	2.06	2.07	6
中期 (3-7)	4,390	99.95	100.03	4.57	0.61	0.67	0.66	4.50	4.49	4.50	5
長期 (7-)	6,521	90.66	90.81	16.25	1.06	1.61	1.52	13.97	13.85	13.90	7
金融債	3,447	98.43	98.49	3.17	0.28	0.76	0.76	3.12	3.11	3.12	26
短期 (1-3)	2,022	98.98	99.02	2.07	0.16	0.65	0.65	2.06	2.05	2.06	24
中期 (3-7)	1,246	98.06	98.15	4.24	0.41	0.87	0.86	4.20	4.18	4.20	27
長期 (7-)	178	94.74	94.88	8.13	0.59	1.33	1.29	7.92	7.87	7.92	40
事業債	69,480	95.47	95.63	7.54	0.73	1.21	1.16	6.43	6.38	6.40	38
短期 (1-3)	20,611	99.36	99.45	2.05	0.44	0.75	0.75	2.04	2.03	2.04	35
中期 (3-7)	25,263	98.42	98.58	4.73	0.68	1.01	1.00	4.64	4.62	4.64	38
長期 (7-)	23,605	88.91	89.14	15.34	1.03	1.88	1.76	12.83	12.71	12.74	41
長期 (7-11)	10,121	96.65	96.87	8.63	0.98	1.43	1.40	8.26	8.20	8.26	47
超長期 (11-)	13,484	83.11	83.34	20.37	1.07	2.27	2.07	16.82	16.64	16.65	37
円建外債	3,180	98.88	99.08	3.65	1.03	1.33	1.32	3.49	3.46	3.49	78
短期 (1-3)	1,695	99.49	99.66	2.17	0.93	1.15	1.15	2.15	2.13	2.15	74
中期 (3-7)	1,209	98.46	98.66	4.09	0.98	1.37	1.36	4.01	3.98	4.01	78
長期 (7-)	276	96.92	97.32	10.82	1.86	2.26	2.22	9.60	9.49	9.57	111
長期 (7-11)	150	96.37	96.64	8.46	1.34	1.86	1.83	7.98	7.91	7.97	91
超長期 (11-)	126	97.58	98.14	13.65	2.49	2.73	2.68	11.51	11.36	11.45	133
MBS	14,147	94.37	94.41	7.41	0.63	0.87	1.35	6.89	6.84	7.14	21
ABS	671	95.30	95.47	5.77	0.72	1.40	1.36	5.33	5.28	5.32	68
短期 (1-3)	200	99.34	99.50	2.00	0.74	1.02	1.02	1.99	1.98	1.99	63
中期 (3-7)	289	96.64	96.81	5.08	0.66	1.33	1.31	4.98	4.94	4.97	66
長期 (7-)	182	88.73	88.90	10.99	0.81	1.99	1.86	10.05	9.96	10.04	75

出所:NFRG

「除く」銘柄 残存別・ポートフォリオ指標 (2024年7月末、8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	1,134,380	95.59	95.79	10.27	0.80	1.06	1.02	8.72	8.66	8.68	4
短期 (1-3)	231,002	99.87	99.97	1.96	0.39	0.44	0.44	1.95	1.94	1.95	6
中期 (3-7)	310,659	99.92	100.08	4.80	0.65	0.67	0.67	4.72	4.70	4.72	4
長期 (7-)	592,720	91.64	91.92	16.37	1.04	1.54	1.46	13.88	13.77	13.79	3
長期 (7-11)	210,694	100.20	100.44	8.73	0.98	0.97	0.97	8.36	8.32	8.35	3
超長期 (11-)	382,026	86.92	87.23	20.58	1.08	1.90	1.77	17.39	17.24	17.25	3
(11-15)	94,558	95.29	95.57	12.90	0.99	1.40	1.38	12.05	11.97	12.03	4
(15-)	287,467	84.17	84.48	23.11	1.11	2.08	1.91	19.38	19.19	19.19	3
除く ABS	1,147,856	95.57	95.78	10.23	0.80	1.05	1.02	8.70	8.64	8.66	4
短期 (1-3)	230,801	99.87	99.97	1.96	0.39	0.44	0.44	1.95	1.94	1.95	6
中期 (3-7)	310,370	99.93	100.08	4.80	0.65	0.67	0.67	4.72	4.70	4.72	4
長期 (7-)	606,685	91.71	91.98	16.16	1.03	1.52	1.46	13.72	13.61	13.63	3
長期 (7-11)	210,786	100.20	100.44	8.72	0.98	0.97	0.97	8.35	8.31	8.35	3
超長期 (11-)	395,899	87.18	87.48	20.12	1.06	1.86	1.75	17.00	16.84	16.87	4
(11-15)	94,502	95.30	95.58	12.90	0.99	1.40	1.37	12.05	11.97	12.03	4
(15-)	301,397	84.64	84.94	22.39	1.08	2.02	1.89	18.74	18.56	18.57	4
除く MBS・ABS	1,133,709	95.59	95.79	10.27	0.80	1.06	1.02	8.73	8.66	8.68	4
短期 (1-3)	230,801	99.87	99.97	1.96	0.39	0.44	0.44	1.95	1.94	1.95	6
中期 (3-7)	310,370	99.93	100.08	4.80	0.65	0.67	0.67	4.72	4.70	4.72	4
長期 (7-)	592,538	91.64	91.92	16.37	1.04	1.54	1.46	13.89	13.77	13.79	3
長期 (7-11)	210,596	100.21	100.44	8.73	0.98	0.97	0.97	8.36	8.32	8.35	3
超長期 (11-)	381,942	86.92	87.23	20.58	1.08	1.90	1.77	17.40	17.24	17.25	3
(11-15)	94,502	95.30	95.58	12.90	0.99	1.40	1.37	12.05	11.97	12.03	4
(15-)	287,439	84.17	84.48	23.11	1.11	2.08	1.91	19.38	19.19	19.19	3
除く 国債	172,344	95.99	96.14	7.46	0.67	1.04	1.07	6.63	6.58	6.62	23
短期 (1-3)	40,542	99.46	99.55	2.06	0.41	0.66	0.66	2.05	2.04	2.05	26
中期 (3-7)	57,103	98.69	98.84	4.80	0.60	0.87	0.86	4.72	4.70	4.72	23
長期 (7-)	74,699	92.04	92.22	12.43	0.86	1.41	1.47	10.87	10.78	10.86	22
長期 (7-11)	27,543	97.88	98.10	8.62	0.89	1.18	1.17	8.27	8.23	8.27	23
超長期 (11-)	47,156	88.62	88.79	14.65	0.85	1.57	1.67	12.54	12.43	12.53	21

出所:NFRG

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

特定銘柄 残存別・ポートフォリオ指標 (2024年7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	181,706	90.69	91.09	20.73	1.44	1.86	1.75	17.18	17.02	17.04	2
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	2,403	110.90	111.56	6.05	2.56	0.68	0.71	5.64	5.62	5.63	1
長期 (7-)	179,303	90.42	90.82	20.93	1.43	1.87	1.77	17.37	17.21	17.23	2
長期 (7-11)	13,408	110.21	110.69	9.43	2.15	0.97	1.02	8.59	8.55	8.58	1
超長期 (11-)	165,895	88.82	89.21	21.86	1.37	1.97	1.84	18.25	18.08	18.09	2
20年国債	293,877	97.82	98.14	10.38	1.32	1.10	1.07	9.38	9.32	9.37	1
短期 (1-3)	25,904	103.53	104.05	2.06	2.15	0.41	0.41	2.02	2.01	2.02	1
中期 (3-7)	63,502	106.92	107.41	5.14	2.06	0.63	0.65	4.89	4.88	4.89	1
長期 (7-)	204,471	94.28	94.52	13.06	0.99	1.36	1.31	12.00	11.91	11.97	0
長期 (7-11)	72,070	104.74	105.11	9.02	1.56	0.95	0.97	8.42	8.38	8.41	1
超長期 (11-)	132,402	88.58	88.75	15.26	0.69	1.62	1.52	14.30	14.19	14.27	0
10年国債	291,847	97.37	97.42	5.40	0.21	0.68	0.67	5.31	5.29	5.31	0
短期 (1-3)	68,755	99.43	99.47	2.01	0.16	0.41	0.41	2.01	2.00	2.01	1
中期 (3-7)	128,009	97.27	97.29	5.00	0.10	0.65	0.64	4.97	4.96	4.97	0
長期 (7-)	95,083	96.01	96.12	8.40	0.40	0.93	0.91	8.25	8.21	8.25	-1
5年国債	119,751	99.04	99.08	2.89	0.14	0.48	0.48	2.88	2.87	2.88	0
短期 (1-3)	63,673	99.20	99.21	2.02	0.03	0.41	0.41	2.02	2.01	2.02	1
中期 (3-7)	56,078	98.87	98.94	3.88	0.26	0.57	0.56	3.86	3.85	3.86	0
中期国債	32,132	99.72	99.75	1.41	0.13	0.34	0.34	1.41	1.41	1.41	3
短期 (1-3)	32,132	99.72	99.75	1.41	0.13	0.34	0.34	1.41	1.41	1.41	3
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
地方公共団体	57,239	96.80	96.96	7.15	0.57	0.88	0.90	6.62	6.58	6.59	8
短期 (1-3)	11,217	99.66	99.75	1.99	0.33	0.48	0.48	1.98	1.97	1.98	9
中期 (3-7)	21,098	98.70	98.83	4.90	0.46	0.71	0.71	4.83	4.82	4.83	7
長期 (7-)	24,923	93.90	94.12	11.38	0.76	1.23	1.28	10.41	10.34	10.36	9
東京都債	4,729	98.13	98.43	7.14	0.70	0.89	0.87	6.51	6.47	6.49	8
短期 (1-3)	1,035	99.78	99.96	1.90	0.40	0.47	0.47	1.89	1.89	1.89	9
中期 (3-7)	1,970	98.89	99.12	4.98	0.52	0.71	0.71	4.90	4.88	4.90	7
長期 (7-)	1,724	96.26	96.72	12.75	1.08	1.35	1.31	11.25	11.17	11.20	9
五大都市債	6,302	97.15	97.36	8.08	0.83	0.94	0.98	7.22	7.17	7.18	9
短期 (1-3)	1,150	100.13	100.25	1.95	0.55	0.47	0.47	1.94	1.93	1.94	9
中期 (3-7)	2,202	100.48	100.68	4.66	0.81	0.68	0.69	4.57	4.55	4.57	7
長期 (7-)	2,950	93.51	93.76	13.03	0.95	1.35	1.42	11.54	11.46	11.45	11
その他地方公共団体	46,208	96.62	96.75	7.03	0.52	0.88	0.89	6.55	6.51	6.52	8
短期 (1-3)	9,032	99.59	99.67	2.00	0.30	0.48	0.48	1.99	1.99	1.99	9
中期 (3-7)	16,926	98.45	98.55	4.92	0.41	0.71	0.71	4.86	4.84	4.86	8
長期 (7-)	20,250	93.76	93.95	11.02	0.71	1.21	1.25	10.18	10.11	10.13	9
その他地方債	9,803	96.12	96.36	8.51	0.80	1.07	1.04	7.63	7.58	7.61	15
短期 (1-3)	1,599	100.19	100.36	2.04	0.65	0.55	0.55	2.03	2.02	2.03	15
中期 (3-7)	3,434	99.59	99.81	5.11	0.74	0.79	0.79	5.00	4.98	5.00	15
長期 (7-)	4,770	92.25	92.54	13.12	0.89	1.47	1.40	11.71	11.62	11.67	15
特定金融債	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
政保地方公営企業債	1,605	98.80	98.85	2.83	0.15	0.52	0.52	2.82	2.81	2.82	6
短期 (1-3)	845	99.38	99.44	1.91	0.17	0.44	0.44	1.90	1.90	1.90	7
中期 (3-7)	760	98.15	98.20	3.86	0.14	0.62	0.61	3.84	3.83	3.84	4
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
その他政保債	12,557	95.15	95.26	10.09	0.79	1.09	1.04	8.63	8.57	8.60	7
短期 (1-3)	2,471	99.50	99.55	1.96	0.21	0.46	0.46	1.96	1.95	1.96	7
中期 (3-7)	3,587	100.20	100.29	4.60	0.67	0.67	0.67	4.53	4.51	4.53	5
長期 (7-)	6,499	90.70	90.85	16.21	1.07	1.60	1.51	13.92	13.80	13.85	7
SDGs	17,121	96.04	96.18	7.37	0.54	1.05	1.02	6.64	6.60	6.62	22

出所:NFRC

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

特定銘柄 残存別・ポートフォリオ指標 (2024年7月末、8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	182,708	90.74	91.14	20.78	1.45	1.86	1.75	17.21	17.05	17.06	2
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	2,403	110.90	111.56	6.05	2.56	0.68	0.71	5.64	5.62	5.63	1
長期(7-)	180,304	90.47	90.87	20.98	1.43	1.88	1.77	17.40	17.23	17.25	2
長期(7-11)	13,408	110.21	110.69	9.43	2.15	0.97	1.02	8.59	8.55	8.58	1
超長期(11-)	166,896	88.89	89.28	21.91	1.38	1.97	1.85	18.27	18.10	18.11	2
20年国債	296,431	97.83	98.15	10.45	1.33	1.10	1.07	9.44	9.38	9.42	1
短期(1-3)	25,926	103.53	104.05	2.06	2.15	0.41	0.41	2.02	2.01	2.02	1
中期(3-7)	63,604	106.92	107.41	5.14	2.06	0.63	0.65	4.89	4.88	4.89	1
長期(7-)	206,901	94.32	94.56	13.13	1.00	1.36	1.31	12.05	11.97	12.02	0
長期(7-11)	72,070	104.74	105.11	9.02	1.56	0.95	0.97	8.42	8.38	8.41	1
超長期(11-)	134,832	88.75	88.92	15.33	0.70	1.62	1.53	14.34	14.23	14.30	0
10年国債	295,214	97.40	97.45	5.44	0.22	0.68	0.67	5.35	5.33	5.35	0
短期(1-3)	68,791	99.43	99.47	2.01	0.16	0.41	0.41	2.01	2.00	2.01	1
中期(3-7)	128,559	97.27	97.29	5.00	0.10	0.65	0.64	4.97	4.96	4.97	0
長期(7-)	97,863	96.14	96.24	8.44	0.42	0.93	0.92	8.28	8.24	8.28	-1
5年国債	122,738	99.06	99.09	2.94	0.15	0.49	0.48	2.92	2.92	2.92	0
短期(1-3)	63,748	99.20	99.21	2.02	0.03	0.41	0.41	2.02	2.01	2.02	1
中期(3-7)	58,990	98.91	98.97	3.93	0.28	0.57	0.57	3.91	3.90	3.91	0
中期国債	31,994	99.73	99.77	1.50	0.16	0.35	0.35	1.50	1.49	1.50	3
短期(1-3)	31,994	99.73	99.77	1.50	0.16	0.35	0.35	1.50	1.49	1.50	3
中期(3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
地方公共団体	57,404	96.80	96.96	7.21	0.57	0.89	0.91	6.67	6.63	6.65	8
短期(1-3)	11,162	99.64	99.74	2.05	0.33	0.49	0.49	2.04	2.03	2.04	9
中期(3-7)	21,232	98.69	98.82	4.95	0.47	0.71	0.71	4.88	4.86	4.88	8
長期(7-)	25,010	93.93	94.15	11.43	0.77	1.24	1.28	10.46	10.38	10.40	9
東京都債	4,749	98.13	98.43	7.15	0.70	0.89	0.87	6.52	6.48	6.50	8
短期(1-3)	1,035	99.78	99.96	1.90	0.40	0.47	0.47	1.89	1.89	1.89	9
中期(3-7)	1,970	98.89	99.12	4.98	0.52	0.71	0.71	4.90	4.88	4.90	7
長期(7-)	1,744	96.30	96.76	12.72	1.08	1.34	1.31	11.22	11.14	11.18	9
五大都市債	6,292	97.15	97.36	8.12	0.83	0.95	0.98	7.25	7.20	7.21	9
短期(1-3)	1,167	100.12	100.25	2.01	0.55	0.48	0.48	1.99	1.99	1.99	9
中期(3-7)	2,184	100.50	100.70	4.72	0.81	0.69	0.69	4.62	4.60	4.62	7
長期(7-)	2,941	93.47	93.73	13.06	0.95	1.35	1.42	11.58	11.49	11.49	11
その他地方公共団体	46,363	96.62	96.76	7.09	0.52	0.88	0.90	6.61	6.57	6.59	8
短期(1-3)	8,960	99.56	99.64	2.07	0.30	0.49	0.49	2.06	2.05	2.06	9
中期(3-7)	17,078	98.44	98.54	4.98	0.42	0.72	0.71	4.91	4.90	4.91	8
長期(7-)	20,325	93.80	93.99	11.09	0.72	1.21	1.26	10.23	10.16	10.18	9
その他地方債	9,849	96.13	96.37	8.57	0.80	1.07	1.04	7.68	7.63	7.67	15
短期(1-3)	1,594	100.19	100.35	2.09	0.66	0.56	0.56	2.08	2.07	2.08	15
中期(3-7)	3,474	99.57	99.79	5.16	0.74	0.80	0.79	5.05	5.03	5.05	15
長期(7-)	4,780	92.27	92.56	13.21	0.90	1.48	1.41	11.78	11.68	11.74	15
特定金融債	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
政保地方公営企業債	1,485	98.72	98.77	2.98	0.15	0.54	0.54	2.96	2.95	2.96	5
短期(1-3)	775	99.29	99.34	2.11	0.17	0.47	0.46	2.11	2.10	2.11	6
中期(3-7)	710	98.10	98.15	3.92	0.14	0.62	0.61	3.90	3.89	3.90	5
長期(7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
その他政保債	12,684	95.18	95.29	10.12	0.79	1.09	1.04	8.67	8.61	8.64	6
短期(1-3)	2,483	99.45	99.50	2.06	0.21	0.47	0.47	2.05	2.05	2.05	7
中期(3-7)	3,680	100.30	100.39	4.69	0.70	0.67	0.67	4.62	4.60	4.62	6
長期(7-)	6,521	90.66	90.81	16.25	1.06	1.61	1.52	13.97	13.85	13.90	7
SDGs	17,774	96.15	96.29	7.38	0.55	1.05	1.02	6.67	6.62	6.65	22

出所:NFRG

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

事業債 業種別・ポートフォリオ指標 (1/4) (2024年7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	68,929	95.44	95.60	7.53	0.72	1.20	1.16	6.41	6.36	6.38	38
短期 (1-3)	20,424	99.37	99.46	2.02	0.44	0.75	0.75	2.01	2.00	2.01	35
中期 (3-7)	25,026	98.43	98.59	4.69	0.67	1.00	1.00	4.61	4.58	4.61	38
長期 (7-)	23,480	88.83	89.05	15.33	1.02	1.88	1.76	12.83	12.70	12.73	42
長期 (7-11)	10,019	96.56	96.78	8.58	0.97	1.43	1.40	8.22	8.16	8.21	47
超長期 (11-)	13,460	83.08	83.30	20.35	1.07	2.27	2.07	16.81	16.63	16.64	37
水産・農林業	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
鉱業	30	95.93	96.00	5.15	0.21	0.98	0.96	5.05	5.02	5.05	33
短期 (1-3)	10	99.09	99.12	1.62	0.08	0.65	0.64	1.62	1.62	1.62	29
中期 (3-7)	10	94.95	95.06	6.62	0.30	1.12	1.09	6.55	6.51	6.55	35
長期 (7-)	10	93.76	93.83	7.21	0.25	1.19	1.16	7.14	7.10	7.14	36
長期 (7-11)	10	93.76	93.83	7.21	0.25	1.19	1.16	7.14	7.10	7.14	36
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
建設業	1,176	97.37	97.45	4.45	0.44	0.97	0.95	4.27	4.25	4.27	36
短期 (1-3)	408	99.00	99.04	2.11	0.26	0.73	0.73	2.10	2.10	2.10	32
中期 (3-7)	618	97.77	97.87	4.42	0.49	0.98	0.97	4.36	4.34	4.36	37
長期 (7-)	150	91.26	91.36	10.91	0.75	1.63	1.55	10.27	10.19	10.26	42
長期 (7-11)	84	95.51	95.63	8.45	0.78	1.38	1.35	8.17	8.12	8.17	44
超長期 (11-)	66	85.85	85.94	14.05	0.71	1.98	1.84	13.24	13.12	13.22	41
食料品	1,418	97.31	97.44	4.91	0.46	0.97	0.96	4.66	4.63	4.65	33
短期 (1-3)	598	99.07	99.14	2.09	0.25	0.68	0.68	2.08	2.08	2.08	28
中期 (3-7)	510	97.65	97.78	4.59	0.44	0.97	0.96	4.54	4.51	4.54	35
長期 (7-)	310	93.36	93.62	10.85	0.89	1.57	1.51	10.12	10.04	10.11	39
長期 (7-11)	190	96.57	96.79	8.71	0.88	1.33	1.30	8.38	8.32	8.37	36
超長期 (11-)	120	88.27	88.59	14.25	0.92	1.98	1.87	13.15	13.02	13.11	43
繊維製品	235	97.41	97.48	4.85	0.52	1.02	1.00	4.62	4.60	4.62	37
短期 (1-3)	90	98.91	98.94	2.57	0.32	0.76	0.75	2.56	2.55	2.56	30
中期 (3-7)	109	98.05	98.14	4.41	0.52	0.99	0.98	4.35	4.33	4.35	38
長期 (7-)	36	91.71	91.83	11.90	1.03	1.80	1.72	11.06	10.96	11.04	50
長期 (7-11)	16	98.37	98.61	9.32	1.29	1.49	1.48	8.78	8.72	8.78	48
超長期 (11-)	20	86.38	86.41	13.96	0.83	2.09	1.95	13.13	13.00	13.11	52
パルプ・紙	340	96.15	96.22	5.05	0.45	1.15	1.12	4.75	4.72	4.75	48
短期 (1-3)	140	98.82	98.89	2.03	0.31	0.89	0.88	2.03	2.02	2.03	48
中期 (3-7)	130	97.04	97.11	4.86	0.44	1.05	1.03	4.79	4.77	4.79	40
長期 (7-)	70	89.14	89.23	11.45	0.75	1.93	1.82	10.70	10.60	10.68	65
長期 (7-11)	35	92.84	92.96	7.83	0.62	1.72	1.66	7.63	7.57	7.63	80
超長期 (11-)	35	85.43	85.50	15.07	0.88	2.16	2.00	14.03	13.89	13.99	48
化学	2,136	95.26	95.37	5.72	0.48	1.18	1.14	5.29	5.25	5.28	46
短期 (1-3)	645	98.99	99.06	2.09	0.28	0.75	0.75	2.08	2.07	2.08	35
中期 (3-7)	908	97.22	97.33	4.63	0.44	1.05	1.03	4.57	4.55	4.57	42
長期 (7-)	583	88.08	88.25	11.43	0.75	1.95	1.82	10.49	10.39	10.47	67
長期 (7-11)	310	94.33	94.48	8.01	0.68	1.50	1.46	7.78	7.73	7.78	58
超長期 (11-)	273	80.99	81.19	15.31	0.83	2.55	2.30	14.07	13.91	14.03	78
医薬品	715	95.37	95.50	6.22	0.49	1.16	1.12	5.82	5.78	5.81	40
短期 (1-3)	175	99.28	99.39	1.94	0.30	0.67	0.67	1.93	1.93	1.93	28
中期 (3-7)	175	98.43	98.64	4.21	0.53	0.91	0.91	4.15	4.13	4.15	32
長期 (7-)	365	92.03	92.13	9.24	0.56	1.54	1.47	8.68	8.62	8.67	51
長期 (7-11)	265	93.85	93.98	7.26	0.43	1.36	1.32	7.14	7.09	7.14	52
超長期 (11-)	100	87.22	87.24	14.48	0.91	2.03	1.89	13.10	12.97	13.05	48

出所:NFRC

- 東証 33 業種分類を参考に NFRC で分類

事業債 業種別・ポートフォリオ指標 (1/4) (2024年7月末、8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	69,480	95.47	95.63	7.54	0.73	1.21	1.16	6.43	6.38	6.40	38
短期 (1-3)	20,611	99.36	99.45	2.05	0.44	0.75	0.75	2.04	2.03	2.04	35
中期 (3-7)	25,263	98.42	98.58	4.73	0.68	1.01	1.00	4.64	4.62	4.64	38
長期 (7-)	23,605	88.91	89.14	15.34	1.03	1.88	1.76	12.83	12.71	12.74	41
長期 (7-11)	10,121	96.65	96.87	8.63	0.98	1.43	1.40	8.26	8.20	8.26	47
超長期 (11-)	13,484	83.11	83.34	20.37	1.07	2.27	2.07	16.82	16.64	16.65	37
水産・農林業	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
鉱業	30	95.93	96.00	5.15	0.21	0.98	0.96	5.05	5.02	5.05	33
短期 (1-3)	10	99.09	99.12	1.62	0.08	0.65	0.64	1.62	1.62	1.62	29
中期 (3-7)	10	94.95	95.06	6.62	0.30	1.12	1.09	6.55	6.51	6.55	35
長期 (7-)	10	93.76	93.83	7.21	0.25	1.19	1.16	7.14	7.10	7.14	36
長期 (7-11)	10	93.76	93.83	7.21	0.25	1.19	1.16	7.14	7.10	7.14	36
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
建設業	1,196	97.40	97.48	4.46	0.45	0.97	0.95	4.28	4.26	4.28	36
短期 (1-3)	408	99.00	99.04	2.11	0.26	0.73	0.73	2.10	2.10	2.10	32
中期 (3-7)	638	97.82	97.93	4.44	0.50	0.98	0.97	4.38	4.35	4.38	37
長期 (7-)	150	91.26	91.36	10.91	0.75	1.63	1.55	10.27	10.19	10.26	42
長期 (7-11)	84	95.51	95.63	8.45	0.78	1.38	1.35	8.17	8.12	8.17	44
超長期 (11-)	66	85.85	85.94	14.05	0.71	1.98	1.84	13.24	13.12	13.22	41
食料品	1,428	97.34	97.47	4.98	0.47	0.98	0.96	4.73	4.70	4.73	33
短期 (1-3)	588	99.06	99.12	2.11	0.25	0.69	0.68	2.10	2.09	2.10	28
中期 (3-7)	520	97.70	97.83	4.63	0.45	0.97	0.96	4.58	4.55	4.58	35
長期 (7-)	320	93.57	93.83	10.82	0.91	1.56	1.51	10.09	10.01	10.08	39
長期 (7-11)	200	96.76	96.98	8.77	0.90	1.33	1.31	8.42	8.37	8.42	36
超長期 (11-)	120	88.27	88.59	14.25	0.92	1.98	1.87	13.15	13.02	13.11	43
繊維製品	225	97.31	97.38	5.02	0.53	1.03	1.02	4.78	4.76	4.78	36
短期 (1-3)	80	98.82	98.84	2.76	0.33	0.77	0.77	2.75	2.74	2.75	29
中期 (3-7)	109	98.05	98.14	4.41	0.52	0.99	0.98	4.35	4.33	4.35	38
長期 (7-)	36	91.71	91.83	11.90	1.03	1.80	1.72	11.06	10.96	11.04	50
長期 (7-11)	16	98.37	98.61	9.32	1.29	1.49	1.48	8.78	8.72	8.78	48
超長期 (11-)	20	86.38	86.41	13.96	0.83	2.09	1.95	13.13	13.00	13.11	52
パルプ・紙	340	96.15	96.22	5.05	0.45	1.15	1.12	4.75	4.72	4.75	48
短期 (1-3)	140	98.82	98.89	2.03	0.31	0.89	0.88	2.03	2.02	2.03	48
中期 (3-7)	130	97.04	97.11	4.86	0.44	1.05	1.03	4.79	4.77	4.79	40
長期 (7-)	70	89.14	89.23	11.45	0.75	1.93	1.82	10.70	10.60	10.68	65
長期 (7-11)	35	92.84	92.96	7.83	0.62	1.72	1.66	7.63	7.57	7.63	80
超長期 (11-)	35	85.43	85.50	15.07	0.88	2.16	2.00	14.03	13.89	13.99	48
化学	2,166	95.32	95.43	5.71	0.48	1.18	1.14	5.28	5.24	5.27	46
短期 (1-3)	645	98.99	99.06	2.09	0.28	0.75	0.75	2.08	2.07	2.08	35
中期 (3-7)	938	97.29	97.40	4.64	0.45	1.05	1.03	4.58	4.55	4.58	42
長期 (7-)	583	88.08	88.25	11.43	0.75	1.95	1.82	10.49	10.39	10.47	67
長期 (7-11)	310	94.33	94.48	8.01	0.68	1.50	1.46	7.78	7.73	7.78	58
超長期 (11-)	273	80.99	81.19	15.31	0.83	2.55	2.30	14.07	13.91	14.03	78
医薬品	725	95.43	95.56	6.20	0.50	1.16	1.12	5.80	5.76	5.80	41
短期 (1-3)	175	99.28	99.39	1.94	0.30	0.67	0.67	1.93	1.93	1.93	28
中期 (3-7)	185	98.51	98.71	4.24	0.56	0.93	0.92	4.18	4.16	4.18	33
長期 (7-)	365	92.03	92.13	9.24	0.56	1.54	1.47	8.68	8.62	8.67	51
長期 (7-11)	265	93.85	93.98	7.26	0.43	1.36	1.32	7.14	7.09	7.14	52
超長期 (11-)	100	87.22	87.24	14.48	0.91	2.03	1.89	13.10	12.97	13.05	48

出所:NFRC

- 東証 33 業種分類を参考に NFRC で分類

事業債 業種別・ポートフォリオ指標 (2/4) (2024年7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	295	95.86	95.95	6.21	0.56	1.22	1.19	5.86	5.82	5.86	47
短期 (1-3)	70	99.16	99.21	1.78	0.24	0.71	0.71	1.77	1.76	1.77	35
中期 (3-7)	105	96.07	96.16	5.43	0.39	1.12	1.10	5.35	5.32	5.35	43
長期 (7-)	120	93.76	93.86	9.47	0.90	1.62	1.57	8.85	8.77	8.83	58
長期 (7-11)	95	95.65	95.74	7.88	0.84	1.45	1.42	7.63	7.58	7.63	56
超長期 (11-)	25	86.61	86.71	15.52	1.13	2.32	2.16	13.95	13.80	13.89	64
ゴム製品	330	97.81	97.92	3.94	0.39	0.93	0.92	3.87	3.85	3.87	36
短期 (1-3)	140	98.95	99.03	2.27	0.28	0.75	0.75	2.26	2.25	2.26	32
中期 (3-7)	160	97.31	97.42	4.65	0.41	1.01	0.99	4.60	4.58	4.60	38
長期 (7-)	30	95.17	95.41	7.99	0.74	1.42	1.39	7.74	7.68	7.73	52
長期 (7-11)	30	95.17	95.41	7.99	0.74	1.42	1.39	7.74	7.68	7.73	52
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
ガラス・土石製品	272	96.07	96.16	5.36	0.48	1.11	1.07	5.00	4.97	5.00	42
短期 (1-3)	98	99.15	99.20	1.93	0.26	0.70	0.70	1.92	1.91	1.92	32
中期 (3-7)	97	97.22	97.33	4.50	0.43	1.06	1.04	4.45	4.42	4.45	44
長期 (7-)	77	90.72	90.85	10.77	0.81	1.73	1.64	10.01	9.92	10.00	53
長期 (7-11)	52	95.43	95.57	8.63	0.82	1.42	1.39	8.33	8.27	8.33	45
超長期 (11-)	25	80.87	80.98	15.26	0.80	2.51	2.26	14.16	14.00	14.13	73
鉄鋼	440	97.85	97.97	4.25	0.52	1.01	1.00	4.12	4.09	4.11	42
短期 (1-3)	160	99.00	99.07	2.11	0.30	0.77	0.77	2.10	2.09	2.10	36
中期 (3-7)	217	97.81	97.92	4.35	0.53	1.03	1.02	4.29	4.27	4.29	42
長期 (7-)	63	95.08	95.36	9.37	1.02	1.58	1.53	8.81	8.74	8.81	54
長期 (7-11)	53	96.93	97.23	8.52	1.03	1.45	1.43	8.13	8.08	8.13	50
超長期 (11-)	10	85.31	85.43	13.87	0.95	2.36	2.18	12.92	12.78	12.89	77
非鉄金属	375	97.69	97.77	4.44	0.46	1.01	1.00	4.34	4.32	4.34	40
短期 (1-3)	130	98.76	98.82	2.27	0.27	0.83	0.83	2.26	2.25	2.26	39
中期 (3-7)	185	97.69	97.77	4.60	0.52	1.03	1.02	4.53	4.51	4.53	41
長期 (7-)	60	95.40	95.45	8.65	0.72	1.33	1.30	8.38	8.33	8.38	36
長期 (7-11)	60	95.40	95.45	8.65	0.72	1.33	1.30	8.38	8.33	8.38	36
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
金属製品	150	97.90	98.02	3.81	0.42	0.97	0.96	3.75	3.73	3.75	41
短期 (1-3)	35	98.94	98.99	1.97	0.23	0.77	0.77	1.97	1.96	1.97	37
中期 (3-7)	106	97.83	97.95	4.06	0.46	0.99	0.98	4.01	3.99	4.01	41
長期 (7-)	9	94.68	94.97	8.07	0.70	1.44	1.40	7.83	7.78	7.83	52
長期 (7-11)	9	94.68	94.97	8.07	0.70	1.44	1.40	7.83	7.78	7.83	52
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
機械	1,278	97.57	97.68	4.21	0.41	0.97	0.96	4.11	4.09	4.11	39
短期 (1-3)	496	99.00	99.07	2.01	0.26	0.75	0.74	2.00	2.00	2.00	36
中期 (3-7)	549	97.30	97.42	4.55	0.44	1.02	1.01	4.49	4.47	4.49	40
長期 (7-)	233	95.14	95.33	8.09	0.65	1.33	1.30	7.86	7.81	7.86	42
長期 (7-11)	233	95.14	95.33	8.09	0.65	1.33	1.30	7.86	7.81	7.86	42
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
電気機器	2,075	98.09	98.22	4.23	0.50	0.96	0.95	4.13	4.11	4.13	38
短期 (1-3)	770	99.17	99.25	2.08	0.33	0.73	0.72	2.07	2.06	2.07	32
中期 (3-7)	1,040	97.65	97.79	4.67	0.51	1.02	1.01	4.60	4.58	4.60	39
長期 (7-)	265	96.69	96.95	8.79	1.00	1.44	1.42	8.40	8.34	8.39	47
長期 (7-11)	265	96.69	96.95	8.79	1.00	1.44	1.42	8.40	8.34	8.39	47
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
輸送用機器	1,087	96.96	97.04	4.54	0.39	1.00	0.98	4.34	4.31	4.34	38
短期 (1-3)	515	98.88	98.92	2.10	0.25	0.79	0.79	2.09	2.08	2.09	38
中期 (3-7)	373	97.29	97.39	4.72	0.42	0.99	0.98	4.65	4.63	4.65	36
長期 (7-)	199	91.37	91.48	10.56	0.70	1.61	1.53	10.01	9.93	10.00	42
長期 (7-11)	109	95.63	95.76	8.53	0.73	1.31	1.29	8.26	8.21	8.26	36
超長期 (11-)	90	86.20	86.30	13.01	0.67	2.00	1.86	12.36	12.25	12.35	51

出所:NFRC

- 東証 33 業種分類を参考に NFRC で分類

事業債 業種別・ポートフォリオ指標 (2/4) (2024年7月末、8月ポートフォリオ)

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
石油・石炭製品	295	95.86	95.95	6.21	0.56	1.22	1.19	5.86	5.82	5.86	47
短期 (1-3)	80	99.11	99.17	1.93	0.26	0.73	0.73	1.92	1.91	1.92	35
中期 (3-7)	95	95.79	95.87	5.69	0.39	1.15	1.13	5.60	5.57	5.60	44
長期 (7-)	120	93.76	93.86	9.47	0.90	1.62	1.57	8.85	8.77	8.83	58
長期 (7-11)	95	95.65	95.74	7.88	0.84	1.45	1.42	7.63	7.58	7.63	56
超長期 (11-)	25	86.61	86.71	15.52	1.13	2.32	2.16	13.95	13.80	13.89	64
ゴム製品	330	97.81	97.92	3.94	0.39	0.93	0.92	3.87	3.85	3.87	36
短期 (1-3)	140	98.95	99.03	2.27	0.28	0.75	0.75	2.26	2.25	2.26	32
中期 (3-7)	160	97.31	97.42	4.65	0.41	1.01	0.99	4.60	4.58	4.60	38
長期 (7-)	30	95.17	95.41	7.99	0.74	1.42	1.39	7.74	7.68	7.73	52
長期 (7-11)	30	95.17	95.41	7.99	0.74	1.42	1.39	7.74	7.68	7.73	52
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
ガラス・土石製品	272	96.07	96.16	5.36	0.48	1.11	1.07	5.00	4.97	5.00	42
短期 (1-3)	98	99.15	99.20	1.93	0.26	0.70	0.70	1.92	1.91	1.92	32
中期 (3-7)	97	97.22	97.33	4.50	0.43	1.06	1.04	4.45	4.42	4.45	44
長期 (7-)	77	90.72	90.85	10.77	0.81	1.73	1.64	10.01	9.92	10.00	53
長期 (7-11)	52	95.43	95.57	8.63	0.82	1.42	1.39	8.33	8.27	8.33	45
超長期 (11-)	25	80.87	80.98	15.26	0.80	2.51	2.26	14.16	14.00	14.13	73
鉄鋼	430	97.80	97.91	4.33	0.51	1.02	1.01	4.19	4.16	4.19	42
短期 (1-3)	150	98.92	98.97	2.17	0.27	0.78	0.77	2.17	2.16	2.17	35
中期 (3-7)	217	97.81	97.92	4.35	0.53	1.03	1.02	4.29	4.27	4.29	42
長期 (7-)	63	95.08	95.36	9.37	1.02	1.58	1.53	8.81	8.74	8.81	54
長期 (7-11)	53	96.93	97.23	8.52	1.03	1.45	1.43	8.13	8.08	8.13	50
超長期 (11-)	10	85.31	85.43	13.87	0.95	2.36	2.18	12.92	12.78	12.89	77
非鉄金属	375	97.69	97.77	4.44	0.46	1.01	1.00	4.34	4.32	4.34	40
短期 (1-3)	140	98.74	98.81	2.33	0.27	0.83	0.83	2.32	2.31	2.32	39
中期 (3-7)	175	97.64	97.73	4.69	0.53	1.04	1.03	4.62	4.60	4.62	41
長期 (7-)	60	95.40	95.45	8.65	0.72	1.33	1.30	8.38	8.33	8.38	36
長期 (7-11)	60	95.40	95.45	8.65	0.72	1.33	1.30	8.38	8.33	8.38	36
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
金属製品	150	97.90	98.02	3.81	0.42	0.97	0.96	3.75	3.73	3.75	41
短期 (1-3)	75	98.77	98.90	2.56	0.36	0.86	0.86	2.54	2.53	2.54	40
中期 (3-7)	66	97.35	97.43	4.65	0.45	1.02	1.01	4.60	4.57	4.60	40
長期 (7-)	9	94.68	94.97	8.07	0.70	1.44	1.40	7.83	7.78	7.83	52
長期 (7-11)	9	94.68	94.97	8.07	0.70	1.44	1.40	7.83	7.78	7.83	52
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
機械	1,292	97.59	97.70	4.23	0.41	0.97	0.96	4.13	4.11	4.13	39
短期 (1-3)	506	99.00	99.07	2.03	0.26	0.75	0.75	2.02	2.02	2.02	35
中期 (3-7)	549	97.32	97.43	4.59	0.44	1.03	1.01	4.53	4.50	4.52	40
長期 (7-)	237	95.21	95.40	8.12	0.66	1.33	1.30	7.89	7.84	7.89	42
長期 (7-11)	237	95.21	95.40	8.12	0.66	1.33	1.30	7.89	7.84	7.89	42
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
電気機器	2,085	98.10	98.23	4.24	0.51	0.96	0.95	4.13	4.11	4.13	38
短期 (1-3)	770	99.17	99.25	2.08	0.33	0.73	0.72	2.07	2.06	2.07	32
中期 (3-7)	1,050	97.67	97.80	4.67	0.51	1.02	1.01	4.60	4.58	4.60	39
長期 (7-)	265	96.69	96.95	8.79	1.00	1.44	1.42	8.40	8.34	8.39	47
長期 (7-11)	265	96.69	96.95	8.79	1.00	1.44	1.42	8.40	8.34	8.39	47
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
輸送用機器	1,087	96.96	97.04	4.54	0.39	1.00	0.98	4.34	4.31	4.34	38
短期 (1-3)	515	98.88	98.92	2.10	0.25	0.79	0.79	2.09	2.08	2.09	38
中期 (3-7)	373	97.29	97.39	4.72	0.42	0.99	0.98	4.65	4.63	4.65	36
長期 (7-)	199	91.37	91.48	10.56	0.70	1.61	1.53	10.01	9.93	10.00	42
長期 (7-11)	109	95.63	95.76	8.53	0.73	1.31	1.29	8.26	8.21	8.26	36
超長期 (11-)	90	86.20	86.30	13.01	0.67	2.00	1.86	12.36	12.25	12.35	51

出所:NFRC

- 東証 33 業種分類を参考に NFRC で分類

事業債 業種別・ポートフォリオ指標 (3/4) (2024年7月末)

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
精密機器	240	97.73	97.86	4.61	0.58	1.06	1.05	4.49	4.46	4.49	44
短期 (1-3)	80	99.30	99.40	2.32	0.39	0.72	0.72	2.31	2.30	2.31	29
中期 (3-7)	125	97.30	97.43	5.04	0.60	1.14	1.13	4.96	4.93	4.96	49
長期 (7-)	35	95.63	95.90	8.29	0.97	1.58	1.55	7.95	7.89	7.95	65
長期 (7-11)	35	95.63	95.90	8.29	0.97	1.58	1.55	7.95	7.89	7.95	65
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
その他製品	175	94.09	94.21	7.46	0.51	1.24	1.19	6.98	6.93	6.97	36
短期 (1-3)	15	98.35	98.37	2.52	0.20	0.88	0.87	2.51	2.50	2.51	41
中期 (3-7)	100	97.52	97.58	5.11	0.49	1.00	0.99	5.05	5.03	5.05	35
長期 (7-)	60	87.30	87.55	12.60	0.61	1.77	1.65	11.80	11.70	11.79	37
長期 (7-11)	15	96.09	96.32	7.10	0.55	1.15	1.12	6.95	6.91	6.95	34
超長期 (11-)	45	84.37	84.62	14.44	0.63	2.01	1.85	13.64	13.52	13.62	38
電気・ガス業	12,218	94.31	94.48	8.14	0.79	1.38	1.33	7.12	7.06	7.10	48
短期 (1-3)	2,665	99.35	99.45	2.13	0.46	0.76	0.76	2.12	2.11	2.12	35
中期 (3-7)	4,100	97.96	98.12	4.91	0.73	1.14	1.13	4.81	4.78	4.81	50
長期 (7-)	5,453	89.10	89.32	13.50	0.99	1.92	1.81	11.75	11.64	11.70	55
長期 (7-11)	2,640	95.70	95.92	8.69	0.97	1.54	1.51	8.31	8.25	8.30	57
超長期 (11-)	2,813	82.91	83.13	18.00	1.00	2.34	2.13	15.48	15.31	15.38	52
陸運業	5,909	89.87	90.22	13.53	1.02	1.56	1.44	10.27	10.17	10.16	34
短期 (1-3)	714	100.28	100.54	1.98	0.80	0.68	0.68	1.97	1.96	1.97	29
中期 (3-7)	1,627	100.45	100.81	5.10	1.11	0.96	0.96	4.94	4.92	4.94	31
長期 (7-)	3,568	82.96	83.32	19.69	1.02	2.11	1.90	15.21	15.05	15.01	37
長期 (7-11)	1,005	98.54	98.91	8.85	1.12	1.32	1.31	8.40	8.34	8.39	35
超長期 (11-)	2,563	76.86	77.21	23.94	0.98	2.51	2.19	18.63	18.42	18.33	39
海運業	163	98.61	98.79	5.25	0.92	1.15	1.14	5.07	5.04	5.07	48
短期 (1-3)	20	101.15	101.29	1.94	1.46	0.82	0.83	1.92	1.91	1.92	43
中期 (3-7)	103	98.14	98.26	4.48	0.63	1.07	1.06	4.41	4.39	4.41	46
長期 (7-)	40	98.54	98.91	8.90	1.38	1.53	1.51	8.36	8.30	8.36	56
長期 (7-11)	40	98.54	98.91	8.90	1.38	1.53	1.51	8.36	8.30	8.36	56
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
空運業	315	93.49	93.68	8.22	0.98	1.76	1.68	7.40	7.32	7.39	79
短期 (1-3)	90	99.19	99.34	2.04	0.65	1.06	1.06	2.03	2.02	2.03	65
中期 (3-7)	40	95.51	95.60	4.77	0.36	1.34	1.32	4.72	4.69	4.72	69
長期 (7-)	185	90.27	90.52	11.97	1.28	2.22	2.10	10.88	10.76	10.86	88
長期 (7-11)	85	98.36	98.63	9.59	1.53	1.74	1.72	8.92	8.85	8.92	70
超長期 (11-)	100	83.40	83.62	13.99	1.07	2.70	2.48	12.83	12.68	12.80	106
倉庫・運輸関連業	124	94.93	95.10	6.83	0.58	1.29	1.25	6.42	6.37	6.41	48
短期 (1-3)	12	99.78	99.84	1.31	0.42	0.61	0.60	1.31	1.30	1.31	31
中期 (3-7)	75	96.51	96.65	5.10	0.44	1.16	1.14	5.02	4.99	5.02	50
長期 (7-)	37	90.07	90.37	12.21	0.93	1.84	1.74	11.33	11.23	11.32	49
長期 (7-11)	17	97.28	97.73	9.42	1.18	1.51	1.49	8.90	8.84	8.90	48
超長期 (11-)	20	84.11	84.30	14.50	0.72	2.15	1.98	13.66	13.53	13.64	51
情報・通信業	2,159	96.52	96.75	4.64	0.89	1.55	1.51	4.30	4.26	4.29	91
短期 (1-3)	781	99.06	99.22	1.97	0.65	1.13	1.13	1.95	1.94	1.95	74
中期 (3-7)	1,040	97.17	97.38	4.68	0.91	1.52	1.49	4.56	4.53	4.56	88
長期 (7-)	338	88.67	89.08	10.67	1.40	2.73	2.56	9.44	9.32	9.41	148
長期 (7-11)	220	92.73	93.10	8.58	1.23	2.25	2.17	8.09	8.01	8.09	124
超長期 (11-)	118	81.06	81.55	14.57	1.73	3.75	3.40	12.32	12.11	12.25	198
卸売業	1,257	97.45	97.65	6.50	0.90	1.17	1.15	6.12	6.08	6.11	39
短期 (1-3)	198	100.32	100.53	2.09	0.94	0.76	0.76	2.07	2.06	2.07	36
中期 (3-7)	605	99.16	99.33	4.92	0.84	1.03	1.03	4.81	4.79	4.81	39
長期 (7-)	454	93.92	94.15	10.54	0.95	1.55	1.49	9.83	9.76	9.82	40
長期 (7-11)	309	97.62	97.88	8.80	1.02	1.32	1.31	8.41	8.36	8.41	35
超長期 (11-)	145	86.06	86.22	14.23	0.82	2.09	1.94	13.28	13.15	13.25	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 (3/4) (2024年7月末、8月ポートフォリオ)

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
精密機器	240	97.73	97.86	4.61	0.58	1.06	1.05	4.49	4.46	4.49	44
短期 (1-3)	80	99.30	99.40	2.32	0.39	0.72	0.72	2.31	2.30	2.31	29
中期 (3-7)	125	97.30	97.43	5.04	0.60	1.14	1.13	4.96	4.93	4.96	49
長期 (7-)	35	95.63	95.90	8.29	0.97	1.58	1.55	7.95	7.89	7.95	65
長期 (7-11)	35	95.63	95.90	8.29	0.97	1.58	1.55	7.95	7.89	7.95	65
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
その他製品	180	94.25	94.37	7.39	0.52	1.23	1.18	6.91	6.86	6.90	36
短期 (1-3)	15	98.35	98.37	2.52	0.20	0.88	0.87	2.51	2.50	2.51	41
中期 (3-7)	105	97.63	97.70	5.10	0.51	1.00	0.99	5.04	5.01	5.04	35
長期 (7-)	60	87.30	87.55	12.60	0.61	1.77	1.65	11.80	11.70	11.79	37
長期 (7-11)	15	96.09	96.32	7.10	0.55	1.15	1.12	6.95	6.91	6.95	34
超長期 (11-)	45	84.37	84.62	14.44	0.63	2.01	1.85	13.64	13.52	13.62	38
電気・ガス業	12,234	94.32	94.49	8.16	0.79	1.39	1.33	7.15	7.09	7.13	48
短期 (1-3)	2,635	99.34	99.44	2.16	0.47	0.76	0.76	2.15	2.14	2.15	35
中期 (3-7)	4,230	97.87	98.02	4.98	0.73	1.15	1.14	4.87	4.84	4.87	50
長期 (7-)	5,369	89.05	89.27	13.62	1.00	1.93	1.81	11.85	11.73	11.79	54
長期 (7-11)	2,566	95.78	95.99	8.80	0.98	1.54	1.51	8.40	8.33	8.39	56
超長期 (11-)	2,803	82.90	83.11	18.03	1.01	2.34	2.13	15.50	15.33	15.39	52
陸運業	5,919	89.88	90.23	13.53	1.02	1.56	1.44	10.27	10.17	10.15	34
短期 (1-3)	714	100.28	100.54	1.98	0.80	0.68	0.68	1.97	1.96	1.97	29
中期 (3-7)	1,627	100.45	100.81	5.10	1.11	0.96	0.96	4.94	4.92	4.94	31
長期 (7-)	3,578	83.01	83.36	19.66	1.02	2.11	1.90	15.19	15.03	14.99	37
長期 (7-11)	1,015	98.54	98.91	8.86	1.13	1.32	1.31	8.41	8.35	8.40	35
超長期 (11-)	2,563	76.86	77.21	23.94	0.98	2.51	2.19	18.63	18.42	18.33	39
海運業	163	98.61	98.79	5.25	0.92	1.15	1.14	5.07	5.04	5.07	48
短期 (1-3)	20	101.15	101.29	1.94	1.46	0.82	0.83	1.92	1.91	1.92	43
中期 (3-7)	103	98.14	98.26	4.48	0.63	1.07	1.06	4.41	4.39	4.41	46
長期 (7-)	40	98.54	98.91	8.90	1.38	1.53	1.51	8.36	8.30	8.36	56
長期 (7-11)	40	98.54	98.91	8.90	1.38	1.53	1.51	8.36	8.30	8.36	56
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
空運業	315	93.49	93.68	8.22	0.98	1.76	1.68	7.40	7.32	7.39	79
短期 (1-3)	90	99.19	99.34	2.04	0.65	1.06	1.06	2.03	2.02	2.03	65
中期 (3-7)	40	95.51	95.60	4.77	0.36	1.34	1.32	4.72	4.69	4.72	69
長期 (7-)	185	90.27	90.52	11.97	1.28	2.22	2.10	10.88	10.76	10.86	88
長期 (7-11)	85	98.36	98.63	9.59	1.53	1.74	1.72	8.92	8.85	8.92	70
超長期 (11-)	100	83.40	83.62	13.99	1.07	2.70	2.48	12.83	12.68	12.80	106
倉庫・運輸関連業	124	94.93	95.10	6.83	0.58	1.29	1.25	6.42	6.37	6.41	48
短期 (1-3)	12	99.78	99.84	1.31	0.42	0.61	0.60	1.31	1.30	1.31	31
中期 (3-7)	75	96.51	96.65	5.10	0.44	1.16	1.14	5.02	4.99	5.02	50
長期 (7-)	37	90.07	90.37	12.21	0.93	1.84	1.74	11.33	11.23	11.32	49
長期 (7-11)	17	97.28	97.73	9.42	1.18	1.51	1.49	8.90	8.84	8.90	48
超長期 (11-)	20	84.11	84.30	14.50	0.72	2.15	1.98	13.66	13.53	13.64	51
情報・通信業	2,169	96.53	96.76	4.63	0.89	1.55	1.51	4.29	4.25	4.29	91
短期 (1-3)	821	99.18	99.37	2.02	0.70	1.14	1.14	2.00	1.99	2.00	74
中期 (3-7)	1,010	97.01	97.20	4.74	0.88	1.53	1.50	4.62	4.58	4.61	88
長期 (7-)	338	88.67	89.08	10.67	1.40	2.73	2.56	9.44	9.32	9.41	148
長期 (7-11)	220	92.73	93.10	8.58	1.23	2.25	2.17	8.09	8.01	8.09	124
超長期 (11-)	118	81.06	81.55	14.57	1.73	3.75	3.40	12.32	12.11	12.25	198
卸売業	1,277	97.49	97.69	6.49	0.90	1.17	1.15	6.10	6.06	6.10	39
短期 (1-3)	198	100.32	100.53	2.09	0.94	0.76	0.76	2.07	2.06	2.07	36
中期 (3-7)	622	99.18	99.35	4.92	0.85	1.04	1.03	4.81	4.79	4.81	40
長期 (7-)	457	93.96	94.19	10.53	0.96	1.55	1.49	9.83	9.75	9.82	40
長期 (7-11)	312	97.64	97.90	8.81	1.02	1.32	1.31	8.42	8.36	8.41	36
超長期 (11-)	145	86.06	86.22	14.23	0.82	2.09	1.94	13.28	13.15	13.25	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 (4/4) (2024年7月末)

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
小売業	1,199	98.41	98.54	4.04	0.56	0.94	0.93	3.89	3.87	3.89	37
短期 (1-3)	474	99.40	99.46	1.70	0.34	0.67	0.66	1.70	1.69	1.70	31
中期 (3-7)	548	98.48	98.64	4.21	0.60	1.00	0.99	4.15	4.13	4.15	40
長期 (7-)	177	95.53	95.79	9.76	1.03	1.53	1.49	9.18	9.11	9.17	46
長期 (7-11)	137	97.77	98.07	8.57	1.07	1.40	1.39	8.18	8.12	8.18	46
超長期 (11-)	40	87.86	87.96	13.84	0.88	2.00	1.88	12.98	12.86	12.96	46
銀行業	1,337	100.02	100.28	3.41	1.26	1.14	1.14	3.32	3.30	3.32	63
短期 (1-3)	667	100.96	101.26	1.98	1.51	1.04	1.04	1.96	1.95	1.96	65
中期 (3-7)	652	99.17	99.38	4.74	1.01	1.25	1.24	4.61	4.58	4.61	62
長期 (7-)	18	96.09	96.24	8.59	0.83	1.34	1.31	8.29	8.23	8.28	38
長期 (7-11)	18	96.09	96.24	8.59	0.83	1.34	1.31	8.29	8.23	8.28	38
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
証券、商品先物取引業	1,031	99.12	99.33	2.41	0.87	1.18	1.18	2.38	2.36	2.38	75
短期 (1-3)	775	99.37	99.57	1.90	0.87	1.14	1.14	1.88	1.87	1.88	76
中期 (3-7)	252	98.47	98.71	3.88	0.87	1.29	1.29	3.81	3.79	3.81	72
長期 (7-)	5	93.05	93.42	8.09	0.90	1.89	1.83	7.78	7.71	7.78	95
長期 (7-11)	5	93.05	93.42	8.09	0.90	1.89	1.83	7.78	7.71	7.78	95
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
保険業	335	97.95	98.04	3.61	0.38	0.95	0.94	3.54	3.52	3.54	40
短期 (1-3)	165	98.65	98.69	2.29	0.20	0.81	0.80	2.29	2.28	2.29	37
中期 (3-7)	120	98.37	98.49	3.52	0.46	0.94	0.93	3.49	3.47	3.49	39
長期 (7-)	50	94.62	94.84	8.21	0.75	1.49	1.45	7.95	7.89	7.95	55
長期 (7-11)	50	94.62	94.84	8.21	0.75	1.49	1.45	7.95	7.89	7.95	55
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
その他金融業	6,150	97.95	98.05	3.87	0.45	0.96	0.95	3.76	3.74	3.76	40
短期 (1-3)	2,833	99.08	99.15	1.97	0.31	0.79	0.78	1.96	1.96	1.96	39
中期 (3-7)	2,652	97.77	97.88	4.62	0.52	1.01	0.99	4.55	4.53	4.55	38
長期 (7-)	666	93.88	94.05	8.97	0.77	1.53	1.48	8.55	8.48	8.54	52
長期 (7-11)	588	95.14	95.31	8.27	0.74	1.43	1.39	8.01	7.95	8.00	49
超長期 (11-)	78	84.39	84.59	14.28	0.96	2.41	2.22	13.16	13.01	13.12	78
不動産業	2,602	94.68	94.86	7.74	0.73	1.32	1.27	6.71	6.66	6.69	46
短期 (1-3)	529	99.14	99.24	2.25	0.41	0.81	0.81	2.24	2.23	2.24	39
中期 (3-7)	1,023	97.67	97.83	4.74	0.61	1.08	1.07	4.66	4.63	4.66	45
長期 (7-)	1,051	89.52	89.77	13.43	1.00	1.85	1.73	11.37	11.27	11.31	51
長期 (7-11)	578	96.64	96.86	8.65	1.00	1.43	1.41	8.27	8.21	8.27	47
超長期 (11-)	473	80.83	81.10	19.27	1.00	2.46	2.21	15.90	15.72	15.75	57
サービス業	737	89.91	90.03	5.12	0.60	2.34	2.12	4.57	4.51	4.57	150
短期 (1-3)	240	97.67	97.73	1.88	0.30	1.42	1.39	1.86	1.85	1.86	102
中期 (3-7)	287	96.04	96.14	4.73	0.45	1.32	1.28	4.67	4.64	4.67	66
長期 (7-)	210	72.67	72.86	9.34	1.14	5.60	4.75	8.55	8.35	8.54	377
長期 (7-11)	160	75.74	75.91	8.23	1.04	5.23	4.54	7.75	7.58	7.75	365
超長期 (11-)	50	62.82	63.08	12.91	1.45	7.04	5.56	11.61	11.31	11.57	423
財投機関債	20,628	95.41	95.55	9.40	0.79	1.11	1.07	7.78	7.72	7.73	17
短期 (1-3)	5,687	99.60	99.67	1.97	0.35	0.56	0.56	1.97	1.96	1.97	17
中期 (3-7)	6,387	99.62	99.77	4.62	0.70	0.78	0.77	4.53	4.52	4.53	16
長期 (7-)	8,554	89.47	89.66	17.91	1.14	1.80	1.69	14.77	14.63	14.64	18
長期 (7-11)	2,302	99.57	99.75	8.68	1.06	1.11	1.11	8.28	8.24	8.28	17
超長期 (11-)	6,252	85.75	85.94	21.31	1.16	2.09	1.94	17.54	17.36	17.35	19

出所:NFRC

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

事業債 業種別・ポートフォリオ指標 (4/4) (2024年7月末、8月ポートフォリオ)

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
小売業	1,189	98.40	98.53	4.06	0.56	0.94	0.93	3.92	3.89	3.91	37
短期 (1-3)	484	99.37	99.43	1.77	0.34	0.67	0.67	1.76	1.76	1.76	31
中期 (3-7)	528	98.47	98.62	4.25	0.61	1.00	0.99	4.19	4.17	4.19	40
長期 (7-)	177	95.53	95.79	9.76	1.03	1.53	1.49	9.18	9.11	9.17	46
長期 (7-11)	137	97.77	98.07	8.57	1.07	1.40	1.39	8.18	8.12	8.18	46
超長期 (11-)	40	87.86	87.96	13.84	0.88	2.00	1.88	12.98	12.86	12.96	46
銀行業	1,337	100.02	100.28	3.41	1.26	1.14	1.14	3.32	3.30	3.32	63
短期 (1-3)	667	100.96	101.26	1.98	1.51	1.04	1.04	1.96	1.95	1.96	65
中期 (3-7)	652	99.17	99.38	4.74	1.01	1.25	1.24	4.61	4.58	4.61	62
長期 (7-)	18	96.09	96.24	8.59	0.83	1.34	1.31	8.29	8.23	8.28	38
長期 (7-11)	18	96.09	96.24	8.59	0.83	1.34	1.31	8.29	8.23	8.28	38
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
証券、商品先物取引業	1,006	99.10	99.30	2.45	0.87	1.20	1.19	2.41	2.40	2.41	76
短期 (1-3)	775	99.30	99.49	1.97	0.85	1.16	1.15	1.95	1.94	1.95	76
中期 (3-7)	227	98.52	98.77	3.98	0.92	1.32	1.31	3.90	3.88	3.90	74
長期 (7-)	5	93.05	93.42	8.09	0.90	1.89	1.83	7.78	7.71	7.78	95
長期 (7-11)	5	93.05	93.42	8.09	0.90	1.89	1.83	7.78	7.71	7.78	95
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
保険業	335	97.95	98.04	3.61	0.38	0.95	0.94	3.54	3.52	3.54	40
短期 (1-3)	165	98.65	98.69	2.29	0.20	0.81	0.80	2.29	2.28	2.29	37
中期 (3-7)	120	98.37	98.49	3.52	0.46	0.94	0.93	3.49	3.47	3.49	39
長期 (7-)	50	94.62	94.84	8.21	0.75	1.49	1.45	7.95	7.89	7.95	55
長期 (7-11)	50	94.62	94.84	8.21	0.75	1.49	1.45	7.95	7.89	7.95	55
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
その他金融業	6,540	98.08	98.18	3.99	0.49	0.97	0.95	3.88	3.86	3.88	40
短期 (1-3)	2,898	99.10	99.17	2.00	0.33	0.79	0.79	1.99	1.98	1.99	39
中期 (3-7)	2,877	97.93	98.05	4.65	0.55	1.00	0.99	4.58	4.56	4.58	38
長期 (7-)	766	94.74	94.92	9.06	0.86	1.52	1.47	8.61	8.54	8.60	50
長期 (7-11)	688	95.91	96.09	8.46	0.85	1.43	1.40	8.16	8.10	8.15	47
超長期 (11-)	78	84.39	84.59	14.28	0.96	2.41	2.22	13.16	13.01	13.12	78
不動産業	2,591	94.66	94.84	7.77	0.73	1.32	1.27	6.74	6.68	6.71	46
短期 (1-3)	551	99.08	99.19	2.32	0.42	0.83	0.82	2.31	2.30	2.31	39
中期 (3-7)	1,000	97.61	97.76	4.82	0.61	1.08	1.07	4.74	4.71	4.74	45
長期 (7-)	1,041	89.48	89.73	13.49	1.00	1.85	1.74	11.42	11.31	11.35	51
長期 (7-11)	568	96.69	96.91	8.68	1.01	1.44	1.41	8.30	8.24	8.29	47
超長期 (11-)	473	80.83	81.10	19.27	1.00	2.46	2.21	15.90	15.72	15.75	57
サービス業	737	89.91	90.03	5.12	0.60	2.34	2.12	4.57	4.51	4.57	150
短期 (1-3)	240	97.67	97.73	1.88	0.30	1.42	1.39	1.86	1.85	1.86	102
中期 (3-7)	287	96.04	96.14	4.73	0.45	1.32	1.28	4.67	4.64	4.67	66
長期 (7-)	210	72.67	72.86	9.34	1.14	5.60	4.75	8.55	8.35	8.54	377
長期 (7-11)	160	75.74	75.91	8.23	1.04	5.23	4.54	7.75	7.58	7.75	365
超長期 (11-)	50	62.82	63.08	12.91	1.45	7.04	5.56	11.61	11.31	11.57	423
財投機関債	20,699	95.41	95.56	9.45	0.79	1.12	1.07	7.82	7.76	7.77	17
短期 (1-3)	5,728	99.58	99.65	2.01	0.35	0.57	0.56	2.00	2.00	2.00	17
中期 (3-7)	6,324	99.63	99.79	4.65	0.71	0.78	0.78	4.56	4.54	4.56	16
長期 (7-)	8,647	89.57	89.75	17.89	1.14	1.80	1.69	14.75	14.62	14.62	18
長期 (7-11)	2,361	99.55	99.73	8.72	1.06	1.12	1.11	8.32	8.28	8.32	17
超長期 (11-)	6,286	85.82	86.00	21.33	1.17	2.09	1.94	17.56	17.38	17.37	19

出所:NFRC

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

事業債 円建外債 格付別・ポートフォリオ指標(2024年7月末)

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
AAA~AA 格	51,472	95.27	95.43	8.09	0.72	1.15	1.11	6.76	6.70	6.72	30
短期 (1-3)	15,126	99.47	99.56	2.01	0.42	0.68	0.68	2.00	1.99	2.00	29
中期 (3-7)	18,066	98.75	98.91	4.67	0.67	0.93	0.92	4.59	4.56	4.59	31
長期 (7-)	18,280	88.36	88.58	16.51	1.02	1.83	1.71	13.57	13.45	13.46	31
長期 (7-11)	7,015	97.30	97.51	8.56	0.92	1.28	1.26	8.22	8.17	8.21	34
超長期 (11-)	11,265	82.80	83.03	21.46	1.08	2.23	2.03	17.49	17.31	17.29	29
AAA~A 格	72,008	95.58	95.75	7.36	0.74	1.21	1.17	6.29	6.24	6.26	40
短期 (1-3)	22,028	99.37	99.48	2.03	0.47	0.78	0.78	2.02	2.01	2.02	38
中期 (3-7)	26,224	98.43	98.59	4.67	0.69	1.02	1.01	4.58	4.56	4.58	40
長期 (7-)	23,756	88.92	89.15	15.28	1.03	1.89	1.76	12.78	12.66	12.69	43
長期 (7-11)	10,170	96.56	96.78	8.58	0.97	1.44	1.41	8.21	8.16	8.21	48
超長期 (11-)	13,586	83.21	83.44	20.29	1.08	2.28	2.07	16.75	16.57	16.58	38
AAA~BBB 格	72,008	95.58	95.75	7.36	0.74	1.21	1.17	6.29	6.24	6.26	40
短期 (1-3)	22,028	99.37	99.48	2.03	0.47	0.78	0.78	2.02	2.01	2.02	38
中期 (3-7)	26,224	98.43	98.59	4.67	0.69	1.02	1.01	4.58	4.56	4.58	40
長期 (7-)	23,756	88.92	89.15	15.28	1.03	1.89	1.76	12.78	12.66	12.69	43
長期 (7-11)	10,170	96.56	96.78	8.58	0.97	1.44	1.41	8.21	8.16	8.21	48
超長期 (11-)	13,586	83.21	83.44	20.29	1.08	2.28	2.07	16.75	16.57	16.58	38
AAA~BB 格	72,008	95.58	95.75	7.36	0.74	1.21	1.17	6.29	6.24	6.26	40
短期 (1-3)	22,028	99.37	99.48	2.03	0.47	0.78	0.78	2.02	2.01	2.02	38
中期 (3-7)	26,224	98.43	98.59	4.67	0.69	1.02	1.01	4.58	4.56	4.58	40
長期 (7-)	23,756	88.92	89.15	15.28	1.03	1.89	1.76	12.78	12.66	12.69	43
長期 (7-11)	10,170	96.56	96.78	8.58	0.97	1.44	1.41	8.21	8.16	8.21	48
超長期 (11-)	13,586	83.21	83.44	20.29	1.08	2.28	2.07	16.75	16.57	16.58	38
AAA 格	11,060	96.77	96.87	5.51	0.39	0.85	0.83	4.74	4.71	4.72	21
短期 (1-3)	4,350	99.17	99.22	1.93	0.16	0.59	0.58	1.93	1.92	1.93	20
中期 (3-7)	4,842	98.18	98.30	4.57	0.43	0.82	0.81	4.52	4.50	4.52	20
長期 (7-)	1,869	87.51	87.69	16.24	0.84	1.68	1.54	12.77	12.65	12.63	25
長期 (7-11)	1,067	96.37	96.51	8.41	0.71	1.19	1.17	8.15	8.10	8.15	26
超長期 (11-)	802	75.73	75.96	26.67	1.02	2.49	2.16	20.58	20.35	20.22	25
AA 格	40,411	94.86	95.04	8.80	0.81	1.23	1.18	7.32	7.26	7.28	33
短期 (1-3)	10,776	99.59	99.70	2.04	0.53	0.72	0.72	2.03	2.02	2.03	32
中期 (3-7)	13,225	98.96	99.13	4.71	0.76	0.97	0.96	4.61	4.59	4.61	35
長期 (7-)	16,411	88.46	88.69	16.54	1.04	1.85	1.73	13.67	13.54	13.55	31
長期 (7-11)	5,948	97.46	97.69	8.59	0.96	1.30	1.28	8.23	8.18	8.23	35
超長期 (11-)	10,463	83.34	83.57	21.06	1.08	2.22	2.02	17.28	17.10	17.09	29
A 格	20,536	96.36	96.53	5.52	0.78	1.36	1.32	5.12	5.08	5.11	65
短期 (1-3)	6,903	99.16	99.29	2.07	0.59	0.99	0.98	2.06	2.05	2.06	58
中期 (3-7)	8,157	97.71	97.88	4.66	0.73	1.23	1.22	4.57	4.54	4.57	60
長期 (7-)	5,476	90.80	91.04	11.16	1.09	2.07	1.95	10.22	10.11	10.20	81
長期 (7-11)	3,155	94.91	95.15	8.62	1.09	1.80	1.74	8.21	8.14	8.20	80
超長期 (11-)	2,322	85.21	85.46	14.61	1.10	2.47	2.28	13.26	13.11	13.21	83
BBB 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
BB 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
B 格以下	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
格付なし	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

出所:NFRFC

- 格付は、格付会社 4 社の最高格付をもとに分類

事業債 円建外債 格付別・ポートフォリオ指標 (2024年7月末、8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	52,129	95.32	95.48	8.09	0.72	1.15	1.11	6.76	6.71	6.72	30
短期 (1-3)	15,362	99.46	99.55	2.04	0.42	0.69	0.69	2.03	2.02	2.03	29
中期 (3-7)	18,255	98.76	98.92	4.69	0.67	0.93	0.93	4.61	4.59	4.61	31
長期 (7-)	18,513	88.49	88.71	16.46	1.02	1.83	1.70	13.54	13.41	13.43	31
長期 (7-11)	7,194	97.36	97.58	8.60	0.93	1.28	1.27	8.25	8.20	8.24	34
超長期 (11-)	11,319	82.85	83.08	21.45	1.08	2.23	2.03	17.49	17.31	17.29	29
AAA~A 格	72,659	95.62	95.78	7.37	0.74	1.21	1.17	6.30	6.25	6.27	40
短期 (1-3)	22,306	99.37	99.47	2.06	0.48	0.78	0.78	2.05	2.04	2.05	38
中期 (3-7)	26,472	98.42	98.58	4.70	0.69	1.03	1.02	4.61	4.59	4.61	40
長期 (7-)	23,882	89.01	89.23	15.29	1.04	1.88	1.76	12.79	12.67	12.70	42
長期 (7-11)	10,272	96.64	96.86	8.63	0.98	1.44	1.41	8.26	8.20	8.25	47
超長期 (11-)	13,610	83.24	83.47	20.31	1.08	2.28	2.08	16.77	16.59	16.59	38
AAA~BBB 格	72,659	95.62	95.78	7.37	0.74	1.21	1.17	6.30	6.25	6.27	40
短期 (1-3)	22,306	99.37	99.47	2.06	0.48	0.78	0.78	2.05	2.04	2.05	38
中期 (3-7)	26,472	98.42	98.58	4.70	0.69	1.03	1.02	4.61	4.59	4.61	40
長期 (7-)	23,882	89.01	89.23	15.29	1.04	1.88	1.76	12.79	12.67	12.70	42
長期 (7-11)	10,272	96.64	96.86	8.63	0.98	1.44	1.41	8.26	8.20	8.25	47
超長期 (11-)	13,610	83.24	83.47	20.31	1.08	2.28	2.08	16.77	16.59	16.59	38
AAA~BB 格	72,659	95.62	95.78	7.37	0.74	1.21	1.17	6.30	6.25	6.27	40
短期 (1-3)	22,306	99.37	99.47	2.06	0.48	0.78	0.78	2.05	2.04	2.05	38
中期 (3-7)	26,472	98.42	98.58	4.70	0.69	1.03	1.02	4.61	4.59	4.61	40
長期 (7-)	23,882	89.01	89.23	15.29	1.04	1.88	1.76	12.79	12.67	12.70	42
長期 (7-11)	10,272	96.64	96.86	8.63	0.98	1.44	1.41	8.26	8.20	8.25	47
超長期 (11-)	13,610	83.24	83.47	20.31	1.08	2.28	2.08	16.77	16.59	16.59	38
AAA 格	11,432	96.87	96.97	5.51	0.41	0.86	0.84	4.76	4.73	4.74	21
短期 (1-3)	4,517	99.17	99.21	1.97	0.17	0.59	0.59	1.97	1.96	1.97	20
中期 (3-7)	4,947	98.23	98.36	4.61	0.45	0.82	0.82	4.55	4.53	4.55	20
長期 (7-)	1,969	88.17	88.35	15.91	0.87	1.66	1.53	12.55	12.44	12.42	26
長期 (7-11)	1,167	96.72	96.87	8.51	0.77	1.21	1.20	8.23	8.18	8.22	27
超長期 (11-)	802	75.73	75.96	26.67	1.02	2.49	2.16	20.58	20.35	20.22	25
AA 格	40,697	94.88	95.06	8.81	0.81	1.24	1.19	7.34	7.28	7.29	33
短期 (1-3)	10,845	99.58	99.69	2.07	0.53	0.73	0.73	2.05	2.05	2.05	33
中期 (3-7)	13,308	98.96	99.13	4.72	0.76	0.97	0.97	4.63	4.61	4.63	35
長期 (7-)	16,544	88.53	88.76	16.52	1.04	1.85	1.73	13.66	13.53	13.54	31
長期 (7-11)	6,027	97.49	97.72	8.62	0.96	1.30	1.28	8.25	8.20	8.25	35
超長期 (11-)	10,517	83.39	83.62	21.05	1.09	2.22	2.02	17.28	17.10	17.09	29
A 格	20,530	96.37	96.55	5.54	0.78	1.36	1.32	5.14	5.10	5.13	65
短期 (1-3)	6,944	99.16	99.29	2.11	0.60	0.99	0.99	2.09	2.08	2.09	58
中期 (3-7)	8,217	97.67	97.84	4.72	0.73	1.24	1.22	4.63	4.60	4.63	60
長期 (7-)	5,369	90.78	91.02	11.24	1.10	2.07	1.96	10.28	10.18	10.26	81
長期 (7-11)	3,077	94.95	95.19	8.71	1.11	1.80	1.74	8.28	8.20	8.27	80
超長期 (11-)	2,292	85.18	85.43	14.64	1.10	2.48	2.28	13.28	13.13	13.23	83
BBB 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
BB 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
B 格以下	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
格付なし	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

出所:NFRC

- 格付は、格付会社 4 社の最高格付をもとに分類

事業債 最高格付別・ポートフォリオ指標 (2024年7月末)

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
AAA～AA格	50,117	95.17	95.33	8.22	0.72	1.15	1.11	6.86	6.80	6.82	29
短期(1-3)	14,443	99.47	99.56	2.01	0.41	0.67	0.67	2.00	1.99	2.00	28
中期(3-7)	17,465	98.74	98.90	4.69	0.66	0.92	0.91	4.61	4.58	4.61	30
長期(7-)	18,209	88.33	88.55	16.54	1.02	1.83	1.71	13.60	13.47	13.48	31
長期(7-11)	6,948	97.30	97.51	8.56	0.92	1.28	1.26	8.22	8.17	8.22	33
超長期(11-)	11,260	82.79	83.02	21.46	1.08	2.23	2.03	17.50	17.31	17.30	29
AAA～A格	68,929	95.44	95.60	7.53	0.72	1.20	1.16	6.41	6.36	6.38	38
短期(1-3)	20,424	99.37	99.46	2.02	0.44	0.75	0.75	2.01	2.00	2.01	35
中期(3-7)	25,026	98.43	98.59	4.69	0.67	1.00	1.00	4.61	4.58	4.61	38
長期(7-)	23,480	88.83	89.05	15.33	1.02	1.88	1.76	12.83	12.70	12.73	42
長期(7-11)	10,019	96.56	96.78	8.58	0.97	1.43	1.40	8.22	8.16	8.21	47
超長期(11-)	13,460	83.08	83.30	20.35	1.07	2.27	2.07	16.81	16.63	16.64	37
AAA～BBB格	68,929	95.44	95.60	7.53	0.72	1.20	1.16	6.41	6.36	6.38	38
短期(1-3)	20,424	99.37	99.46	2.02	0.44	0.75	0.75	2.01	2.00	2.01	35
中期(3-7)	25,026	98.43	98.59	4.69	0.67	1.00	1.00	4.61	4.58	4.61	38
長期(7-)	23,480	88.83	89.05	15.33	1.02	1.88	1.76	12.83	12.70	12.73	42
長期(7-11)	10,019	96.56	96.78	8.58	0.97	1.43	1.40	8.22	8.16	8.21	47
超長期(11-)	13,460	83.08	83.30	20.35	1.07	2.27	2.07	16.81	16.63	16.64	37
AAA～BB格	68,929	95.44	95.60	7.53	0.72	1.20	1.16	6.41	6.36	6.38	38
短期(1-3)	20,424	99.37	99.46	2.02	0.44	0.75	0.75	2.01	2.00	2.01	35
中期(3-7)	25,026	98.43	98.59	4.69	0.67	1.00	1.00	4.61	4.58	4.61	38
長期(7-)	23,480	88.83	89.05	15.33	1.02	1.88	1.76	12.83	12.70	12.73	42
長期(7-11)	10,019	96.56	96.78	8.58	0.97	1.43	1.40	8.22	8.16	8.21	47
超長期(11-)	13,460	83.08	83.30	20.35	1.07	2.27	2.07	16.81	16.63	16.64	37
AAA格	11,060	96.77	96.87	5.51	0.39	0.85	0.83	4.74	4.71	4.72	21
短期(1-3)	4,350	99.17	99.22	1.93	0.16	0.59	0.58	1.93	1.92	1.93	20
中期(3-7)	4,842	98.18	98.30	4.57	0.43	0.82	0.81	4.52	4.50	4.52	20
長期(7-)	1,869	87.51	87.69	16.24	0.84	1.68	1.54	12.77	12.65	12.63	25
長期(7-11)	1,067	96.37	96.51	8.41	0.71	1.19	1.17	8.15	8.10	8.15	26
超長期(11-)	802	75.73	75.96	26.67	1.02	2.49	2.16	20.58	20.35	20.22	25
AA格	39,056	94.71	94.89	8.99	0.81	1.24	1.19	7.47	7.41	7.42	32
短期(1-3)	10,093	99.60	99.71	2.04	0.51	0.71	0.71	2.03	2.02	2.03	31
中期(3-7)	12,623	98.96	99.13	4.73	0.75	0.96	0.95	4.64	4.62	4.64	33
長期(7-)	16,340	88.42	88.65	16.57	1.04	1.85	1.73	13.69	13.56	13.58	31
長期(7-11)	5,881	97.46	97.69	8.59	0.95	1.29	1.28	8.23	8.18	8.23	35
超長期(11-)	10,458	83.33	83.56	21.06	1.08	2.22	2.02	17.28	17.10	17.09	29
A格	18,813	96.15	96.32	5.67	0.74	1.34	1.30	5.25	5.21	5.24	62
短期(1-3)	5,981	99.12	99.23	2.05	0.51	0.93	0.93	2.03	2.02	2.03	53
中期(3-7)	7,561	97.70	97.87	4.70	0.71	1.20	1.19	4.61	4.58	4.61	57
長期(7-)	5,271	90.57	90.80	11.15	1.05	2.05	1.93	10.22	10.12	10.20	79
長期(7-11)	3,071	94.89	95.13	8.63	1.08	1.79	1.73	8.21	8.14	8.21	79
超長期(11-)	2,200	84.53	84.75	14.67	1.02	2.46	2.25	13.37	13.22	13.33	79
BBB格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
BB格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
B格以下	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
格付なし	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

出所:NFRC

- 格付は、格付会社4社の最高格付をもとに分類

事業債 最高格付別・ポートフォリオ指標 (2024年7月末、8月ポートフォリオ)

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
AAA~AA格	50,673	95.21	95.37	8.23	0.72	1.15	1.11	6.87	6.82	6.83	29
短期(1-3)	14,589	99.46	99.55	2.04	0.41	0.67	0.67	2.03	2.02	2.03	28
中期(3-7)	17,642	98.75	98.91	4.71	0.67	0.92	0.92	4.63	4.61	4.63	30
長期(7-)	18,442	88.46	88.68	16.49	1.02	1.83	1.71	13.56	13.43	13.45	31
長期(7-11)	7,127	97.36	97.58	8.60	0.93	1.28	1.27	8.25	8.20	8.25	33
超長期(11-)	11,314	82.85	83.07	21.46	1.08	2.23	2.03	17.49	17.31	17.29	29
AAA~A格	69,480	95.47	95.63	7.54	0.73	1.21	1.16	6.43	6.38	6.40	38
短期(1-3)	20,611	99.36	99.45	2.05	0.44	0.75	0.75	2.04	2.03	2.04	35
中期(3-7)	25,263	98.42	98.58	4.73	0.68	1.01	1.00	4.64	4.62	4.64	38
長期(7-)	23,605	88.91	89.14	15.34	1.03	1.88	1.76	12.83	12.71	12.74	41
長期(7-11)	10,121	96.65	96.87	8.63	0.98	1.43	1.40	8.26	8.20	8.26	47
超長期(11-)	13,484	83.11	83.34	20.37	1.07	2.27	2.07	16.82	16.64	16.65	37
AAA~BBB格	69,480	95.47	95.63	7.54	0.73	1.21	1.16	6.43	6.38	6.40	38
短期(1-3)	20,611	99.36	99.45	2.05	0.44	0.75	0.75	2.04	2.03	2.04	35
中期(3-7)	25,263	98.42	98.58	4.73	0.68	1.01	1.00	4.64	4.62	4.64	38
長期(7-)	23,605	88.91	89.14	15.34	1.03	1.88	1.76	12.83	12.71	12.74	41
長期(7-11)	10,121	96.65	96.87	8.63	0.98	1.43	1.40	8.26	8.20	8.26	47
超長期(11-)	13,484	83.11	83.34	20.37	1.07	2.27	2.07	16.82	16.64	16.65	37
AAA~BB格	69,480	95.47	95.63	7.54	0.73	1.21	1.16	6.43	6.38	6.40	38
短期(1-3)	20,611	99.36	99.45	2.05	0.44	0.75	0.75	2.04	2.03	2.04	35
中期(3-7)	25,263	98.42	98.58	4.73	0.68	1.01	1.00	4.64	4.62	4.64	38
長期(7-)	23,605	88.91	89.14	15.34	1.03	1.88	1.76	12.83	12.71	12.74	41
長期(7-11)	10,121	96.65	96.87	8.63	0.98	1.43	1.40	8.26	8.20	8.26	47
超長期(11-)	13,484	83.11	83.34	20.37	1.07	2.27	2.07	16.82	16.64	16.65	37
AAA格	11,432	96.87	96.97	5.51	0.41	0.86	0.84	4.76	4.73	4.74	21
短期(1-3)	4,517	99.17	99.21	1.97	0.17	0.59	0.59	1.97	1.96	1.97	20
中期(3-7)	4,947	98.23	98.36	4.61	0.45	0.82	0.82	4.55	4.53	4.55	20
長期(7-)	1,969	88.17	88.35	15.91	0.87	1.66	1.53	12.55	12.44	12.42	26
長期(7-11)	1,167	96.72	96.87	8.51	0.77	1.21	1.20	8.23	8.18	8.22	27
超長期(11-)	802	75.73	75.96	26.67	1.02	2.49	2.16	20.58	20.35	20.22	25
AA格	39,240	94.72	94.90	9.02	0.81	1.24	1.19	7.50	7.44	7.45	32
短期(1-3)	10,072	99.59	99.70	2.06	0.51	0.71	0.71	2.05	2.04	2.05	31
中期(3-7)	12,695	98.96	99.12	4.75	0.75	0.96	0.96	4.66	4.64	4.66	33
長期(7-)	16,473	88.49	88.72	16.56	1.04	1.85	1.73	13.68	13.55	13.57	31
長期(7-11)	5,960	97.49	97.72	8.62	0.96	1.29	1.28	8.26	8.20	8.25	34
超長期(11-)	10,512	83.39	83.62	21.06	1.09	2.22	2.02	17.28	17.10	17.09	29
A格	18,807	96.17	96.34	5.69	0.75	1.34	1.30	5.27	5.23	5.27	62
短期(1-3)	6,023	99.11	99.23	2.09	0.52	0.94	0.94	2.08	2.07	2.08	53
中期(3-7)	7,621	97.65	97.82	4.77	0.71	1.21	1.20	4.68	4.65	4.68	57
長期(7-)	5,164	90.55	90.78	11.23	1.06	2.06	1.94	10.29	10.19	10.27	79
長期(7-11)	2,994	94.94	95.17	8.71	1.10	1.79	1.73	8.28	8.21	8.28	79
超長期(11-)	2,170	84.48	84.71	14.70	1.02	2.46	2.26	13.39	13.25	13.35	80
BBB格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
BB格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
B格以下	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
格付なし	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

出所:NFRC

- 格付は、格付会社4社の最高格付をもとに分類

事業債 最低格付別・ポートフォリオ指標 (2024年7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	10,944	95.14	95.29	7.19	0.62	1.11	1.06	5.90	5.86	5.87	34
短期(1-3)	3,489	99.43	99.53	1.98	0.42	0.70	0.70	1.97	1.96	1.97	31
中期(3-7)	4,445	98.33	98.47	4.53	0.59	0.97	0.96	4.45	4.43	4.45	36
長期(7-)	3,010	85.46	85.68	17.18	0.89	1.89	1.73	13.65	13.52	13.51	34
長期(7-11)	1,255	96.47	96.66	8.60	0.83	1.31	1.29	8.28	8.23	8.28	35
超長期(11-)	1,755	77.59	77.82	23.32	0.93	2.40	2.12	18.43	18.22	18.16	33
AAA~A格	66,508	95.41	95.58	7.56	0.72	1.20	1.16	6.44	6.39	6.41	38
短期(1-3)	19,824	99.38	99.48	2.02	0.44	0.74	0.74	2.01	2.00	2.01	34
中期(3-7)	23,858	98.41	98.57	4.70	0.66	0.99	0.99	4.61	4.59	4.61	37
長期(7-)	22,826	88.84	89.06	15.37	1.03	1.88	1.76	12.85	12.72	12.75	41
長期(7-11)	9,707	96.59	96.81	8.58	0.97	1.43	1.40	8.22	8.16	8.21	47
超長期(11-)	13,119	83.10	83.33	20.40	1.07	2.26	2.06	16.83	16.65	16.65	37
AAA~BBB格	68,689	95.42	95.58	7.53	0.72	1.20	1.16	6.42	6.37	6.39	38
短期(1-3)	20,424	99.37	99.46	2.02	0.44	0.75	0.75	2.01	2.00	2.01	35
中期(3-7)	24,811	98.40	98.56	4.69	0.66	1.00	0.99	4.61	4.59	4.61	37
長期(7-)	23,455	88.83	89.05	15.33	1.02	1.88	1.76	12.82	12.70	12.73	42
長期(7-11)	10,019	96.56	96.78	8.58	0.97	1.43	1.40	8.22	8.16	8.21	47
超長期(11-)	13,435	83.06	83.29	20.36	1.07	2.27	2.07	16.82	16.64	16.64	37
AAA~BB格	68,929	95.44	95.60	7.53	0.72	1.20	1.16	6.41	6.36	6.38	38
短期(1-3)	20,424	99.37	99.46	2.02	0.44	0.75	0.75	2.01	2.00	2.01	35
中期(3-7)	25,026	98.43	98.59	4.69	0.67	1.00	1.00	4.61	4.58	4.61	38
長期(7-)	23,480	88.83	89.05	15.33	1.02	1.88	1.76	12.83	12.70	12.73	42
長期(7-11)	10,019	96.56	96.78	8.58	0.97	1.43	1.40	8.22	8.16	8.21	47
超長期(11-)	13,460	83.08	83.30	20.35	1.07	2.27	2.07	16.81	16.63	16.64	37
AAA格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA格	10,944	95.14	95.29	7.19	0.62	1.11	1.06	5.90	5.86	5.87	34
短期(1-3)	3,489	99.43	99.53	1.98	0.42	0.70	0.70	1.97	1.96	1.97	31
中期(3-7)	4,445	98.33	98.47	4.53	0.59	0.97	0.96	4.45	4.43	4.45	36
長期(7-)	3,010	85.46	85.68	17.18	0.89	1.89	1.73	13.65	13.52	13.51	34
長期(7-11)	1,255	96.47	96.66	8.60	0.83	1.31	1.29	8.28	8.23	8.28	35
超長期(11-)	1,755	77.59	77.82	23.32	0.93	2.40	2.12	18.43	18.22	18.16	33
A格	55,564	95.47	95.63	7.64	0.74	1.22	1.17	6.54	6.49	6.51	38
短期(1-3)	16,336	99.37	99.47	2.03	0.44	0.75	0.75	2.02	2.01	2.02	35
中期(3-7)	19,413	98.43	98.59	4.74	0.68	1.00	0.99	4.65	4.62	4.65	37
長期(7-)	19,816	89.35	89.58	15.10	1.05	1.88	1.76	12.73	12.61	12.64	42
長期(7-11)	8,452	96.61	96.84	8.58	0.99	1.45	1.42	8.21	8.15	8.20	49
超長期(11-)	11,364	83.96	84.18	19.95	1.09	2.25	2.05	16.60	16.42	16.43	37
BBB格	2,182	95.56	95.72	6.56	0.68	1.27	1.23	5.85	5.81	5.84	49
短期(1-3)	599	98.86	98.98	2.06	0.43	0.95	0.94	2.05	2.04	2.05	54
中期(3-7)	954	98.24	98.39	4.65	0.66	1.07	1.06	4.57	4.54	4.57	44
長期(7-)	629	88.34	88.55	13.76	0.94	1.95	1.81	12.07	11.95	12.01	53
長期(7-11)	313	95.54	95.75	8.63	0.91	1.53	1.48	8.29	8.23	8.29	55
超長期(11-)	316	81.22	81.42	18.82	0.97	2.43	2.20	16.46	16.28	16.35	50
BB格	240	100.33	100.90	5.83	2.26	2.04	2.04	5.26	5.20	5.25	134
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	215	101.28	101.87	4.66	2.25	1.93	1.94	4.43	4.38	4.42	133
長期(7-)	25	92.16	92.57	15.82	2.37	3.11	2.99	13.10	12.91	13.02	146
長期(7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期(11-)	25	92.16	92.57	15.82	2.37	3.11	2.99	13.10	12.91	13.02	146
B格以下	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
格付なし	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

出所:NFRC

- 格付は、格付会社4社の最低格付をもとに分類

事業債 最低格付別・ポートフォリオ指標 (2024年7月末、8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	11,080	95.16	95.31	7.19	0.62	1.11	1.07	5.91	5.87	5.88	34
短期(1-3)	3,535	99.43	99.53	1.99	0.43	0.70	0.70	1.98	1.97	1.98	31
中期(3-7)	4,497	98.30	98.44	4.54	0.59	0.97	0.97	4.47	4.45	4.47	36
長期(7-)	3,048	85.56	85.78	17.14	0.89	1.89	1.73	13.64	13.51	13.50	34
長期(7-11)	1,266	96.52	96.71	8.63	0.84	1.31	1.29	8.31	8.26	8.31	35
超長期(11-)	1,782	77.78	78.01	23.18	0.93	2.39	2.12	18.34	18.14	18.07	33
AAA~A格	67,078	95.45	95.61	7.58	0.72	1.20	1.16	6.46	6.41	6.42	37
短期(1-3)	20,022	99.37	99.47	2.05	0.44	0.75	0.74	2.04	2.03	2.04	35
中期(3-7)	24,104	98.40	98.56	4.73	0.67	1.00	0.99	4.65	4.62	4.65	37
長期(7-)	22,952	88.93	89.15	15.38	1.03	1.88	1.75	12.85	12.73	12.76	41
長期(7-11)	9,809	96.68	96.90	8.63	0.98	1.43	1.40	8.26	8.20	8.26	46
超長期(11-)	13,143	83.14	83.37	20.41	1.07	2.27	2.06	16.84	16.66	16.66	37
AAA~BBB格	69,240	95.45	95.61	7.55	0.72	1.20	1.16	6.44	6.39	6.41	38
短期(1-3)	20,611	99.36	99.45	2.05	0.44	0.75	0.75	2.04	2.03	2.04	35
中期(3-7)	25,048	98.40	98.55	4.73	0.67	1.00	0.99	4.65	4.62	4.64	37
長期(7-)	23,580	88.91	89.13	15.34	1.03	1.88	1.76	12.83	12.71	12.74	41
長期(7-11)	10,121	96.65	96.87	8.63	0.98	1.43	1.40	8.26	8.20	8.26	47
超長期(11-)	13,459	83.09	83.32	20.38	1.07	2.27	2.07	16.83	16.65	16.66	37
AAA~BB格	69,480	95.47	95.63	7.54	0.73	1.21	1.16	6.43	6.38	6.40	38
短期(1-3)	20,611	99.36	99.45	2.05	0.44	0.75	0.75	2.04	2.03	2.04	35
中期(3-7)	25,263	98.42	98.58	4.73	0.68	1.01	1.00	4.64	4.62	4.64	38
長期(7-)	23,605	88.91	89.14	15.34	1.03	1.88	1.76	12.83	12.71	12.74	41
長期(7-11)	10,121	96.65	96.87	8.63	0.98	1.43	1.40	8.26	8.20	8.26	47
超長期(11-)	13,484	83.11	83.34	20.37	1.07	2.27	2.07	16.82	16.64	16.65	37
AAA格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA格	11,080	95.16	95.31	7.19	0.62	1.11	1.07	5.91	5.87	5.88	34
短期(1-3)	3,535	99.43	99.53	1.99	0.43	0.70	0.70	1.98	1.97	1.98	31
中期(3-7)	4,497	98.30	98.44	4.54	0.59	0.97	0.97	4.47	4.45	4.47	36
長期(7-)	3,048	85.56	85.78	17.14	0.89	1.89	1.73	13.64	13.51	13.50	34
長期(7-11)	1,266	96.52	96.71	8.63	0.84	1.31	1.29	8.31	8.26	8.31	35
超長期(11-)	1,782	77.78	78.01	23.18	0.93	2.39	2.12	18.34	18.14	18.07	33
A格	55,998	95.51	95.67	7.65	0.74	1.22	1.18	6.56	6.51	6.53	38
短期(1-3)	16,487	99.36	99.46	2.06	0.44	0.76	0.75	2.05	2.04	2.05	35
中期(3-7)	19,607	98.43	98.59	4.78	0.68	1.00	0.99	4.69	4.66	4.69	37
長期(7-)	19,903	89.44	89.67	15.11	1.05	1.87	1.76	12.74	12.62	12.65	42
長期(7-11)	8,542	96.71	96.93	8.64	1.00	1.45	1.42	8.25	8.19	8.25	48
超長期(11-)	11,361	83.98	84.21	19.98	1.09	2.25	2.06	16.62	16.45	16.46	37
BBB格	2,162	95.52	95.68	6.61	0.68	1.27	1.23	5.90	5.85	5.88	49
短期(1-3)	589	98.82	98.94	2.11	0.43	0.96	0.96	2.10	2.09	2.10	55
中期(3-7)	944	98.24	98.39	4.66	0.66	1.06	1.05	4.58	4.56	4.58	44
長期(7-)	629	88.34	88.55	13.76	0.94	1.95	1.81	12.07	11.95	12.01	53
長期(7-11)	313	95.54	95.75	8.63	0.91	1.53	1.48	8.29	8.23	8.29	55
超長期(11-)	316	81.22	81.42	18.82	0.97	2.43	2.20	16.46	16.28	16.35	50
BB格	240	100.33	100.90	5.83	2.26	2.04	2.04	5.26	5.20	5.25	134
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	215	101.28	101.87	4.66	2.25	1.93	1.94	4.43	4.38	4.42	133
長期(7-)	25	92.16	92.57	15.82	2.37	3.11	2.99	13.10	12.91	13.02	146
長期(7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期(11-)	25	92.16	92.57	15.82	2.37	3.11	2.99	13.10	12.91	13.02	146
B格以下	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
格付なし	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

出所:NFRC

- 格付は、格付会社4社の最低格付をもとに分類

事業債 R&I 格付別・ポートフォリオ指標 (2024年7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	38,076	95.02	95.19	8.88	0.76	1.15	1.10	7.25	7.19	7.20	25
短期 (1-3)	10,689	99.55	99.64	2.01	0.41	0.64	0.63	2.00	1.99	2.00	24
中期 (3-7)	12,773	99.22	99.40	4.66	0.71	0.87	0.87	4.57	4.55	4.57	26
長期 (7-)	14,614	88.04	88.27	17.59	1.07	1.84	1.71	14.23	14.09	14.09	26
長期 (7-11)	5,038	98.15	98.38	8.70	0.99	1.23	1.22	8.32	8.27	8.32	28
超長期 (11-)	9,575	82.71	82.95	22.26	1.11	2.23	2.02	17.91	17.72	17.69	25
AAA~A 格	62,890	95.36	95.53	7.75	0.73	1.19	1.15	6.57	6.52	6.53	36
短期 (1-3)	18,501	99.39	99.48	2.03	0.42	0.72	0.72	2.02	2.01	2.02	32
中期 (3-7)	22,297	98.56	98.72	4.70	0.68	0.98	0.98	4.61	4.59	4.61	36
長期 (7-)	22,093	88.77	88.99	15.63	1.03	1.86	1.74	13.02	12.89	12.92	39
長期 (7-11)	9,143	96.82	97.05	8.61	0.95	1.38	1.36	8.24	8.19	8.24	42
超長期 (11-)	12,950	83.08	83.31	20.58	1.08	2.26	2.06	16.94	16.76	16.76	36
AAA~BBB 格	63,030	95.36	95.53	7.74	0.73	1.19	1.15	6.56	6.51	6.53	36
短期 (1-3)	18,564	99.38	99.48	2.03	0.42	0.72	0.72	2.02	2.01	2.02	33
中期 (3-7)	22,363	98.55	98.71	4.70	0.68	0.99	0.98	4.61	4.59	4.61	36
長期 (7-)	22,104	88.76	88.99	15.62	1.03	1.87	1.74	13.01	12.89	12.91	39
長期 (7-11)	9,154	96.80	97.02	8.60	0.95	1.38	1.36	8.24	8.18	8.24	43
超長期 (11-)	12,950	83.08	83.31	20.58	1.08	2.26	2.06	16.94	16.76	16.76	36
AAA~BB 格	63,030	95.36	95.53	7.74	0.73	1.19	1.15	6.56	6.51	6.53	36
短期 (1-3)	18,564	99.38	99.48	2.03	0.42	0.72	0.72	2.02	2.01	2.02	33
中期 (3-7)	22,363	98.55	98.71	4.70	0.68	0.99	0.98	4.61	4.59	4.61	36
長期 (7-)	22,104	88.76	88.99	15.62	1.03	1.87	1.74	13.01	12.89	12.91	39
長期 (7-11)	9,154	96.80	97.02	8.60	0.95	1.38	1.36	8.24	8.18	8.24	43
超長期 (11-)	12,950	83.08	83.31	20.58	1.08	2.26	2.06	16.94	16.76	16.76	36
AAA 格	955	97.95	98.03	3.78	0.31	0.81	0.80	3.69	3.67	3.68	26
短期 (1-3)	505	99.03	99.07	2.10	0.19	0.66	0.66	2.09	2.09	2.09	25
中期 (3-7)	350	97.84	97.96	4.54	0.41	0.88	0.87	4.48	4.46	4.48	26
長期 (7-)	100	92.88	92.97	9.64	0.57	1.37	1.32	9.31	9.25	9.30	29
長期 (7-11)	70	95.30	95.40	8.55	0.62	1.23	1.20	8.32	8.27	8.32	27
超長期 (11-)	30	87.22	87.30	12.17	0.45	1.72	1.61	11.82	11.73	11.81	32
AA 格	37,121	94.95	95.12	9.01	0.78	1.16	1.11	7.35	7.29	7.30	25
短期 (1-3)	10,184	99.58	99.67	2.00	0.42	0.63	0.63	1.99	1.99	1.99	24
中期 (3-7)	12,423	99.26	99.44	4.66	0.72	0.87	0.87	4.58	4.56	4.58	26
長期 (7-)	14,514	88.00	88.24	17.64	1.07	1.85	1.72	14.26	14.13	14.12	26
長期 (7-11)	4,968	98.19	98.42	8.70	1.00	1.23	1.22	8.32	8.27	8.32	28
超長期 (11-)	9,545	82.70	82.94	22.29	1.11	2.23	2.02	17.93	17.74	17.71	25
A 格	24,815	95.89	96.04	6.03	0.67	1.25	1.22	5.53	5.48	5.52	51
短期 (1-3)	7,812	99.18	99.27	2.06	0.44	0.84	0.83	2.05	2.04	2.05	43
中期 (3-7)	9,524	97.66	97.81	4.75	0.64	1.13	1.12	4.66	4.63	4.66	50
長期 (7-)	7,479	90.19	90.41	11.80	0.94	1.90	1.80	10.70	10.60	10.68	63
長期 (7-11)	4,104	95.19	95.41	8.49	0.91	1.57	1.53	8.14	8.08	8.14	61
超長期 (11-)	3,375	84.11	84.33	15.83	0.98	2.36	2.17	14.23	14.07	14.17	64
BBB 格	140	95.29	95.48	3.66	0.95	2.21	2.14	3.51	3.47	3.51	160
短期 (1-3)	63	97.24	97.38	2.30	0.82	2.07	2.04	2.28	2.26	2.28	161
中期 (3-7)	66	96.50	96.74	4.32	1.06	1.91	1.87	4.22	4.18	4.22	128
長期 (7-)	11	76.92	77.05	7.38	1.07	5.46	4.82	7.06	6.89	7.06	401
長期 (7-11)	11	76.92	77.05	7.38	1.07	5.46	4.82	7.06	6.89	7.06	401
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
BB 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
B 格以下	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
格付なし	5,899	96.22	96.37	5.19	0.68	1.32	1.27	4.87	4.83	4.87	63
短期 (1-3)	1,860	99.17	99.31	1.94	0.58	0.99	0.98	1.92	1.91	1.92	60
中期 (3-7)	2,663	97.40	97.54	4.67	0.59	1.16	1.14	4.59	4.56	4.59	52
長期 (7-)	1,376	89.93	90.12	10.61	1.00	2.14	1.98	9.85	9.75	9.83	89
長期 (7-11)	866	94.00	94.21	8.36	1.10	1.98	1.86	7.97	7.90	7.97	96
超長期 (11-)	510	83.02	83.18	14.42	0.85	2.46	2.20	13.44	13.30	13.41	75

出所:NFRC

- 格付は、R&Iの格付をもとに NFRC で分類

事業債 R&I 格付別・ポートフォリオ指標 (2024年7月末、8月ポートフォリオ)

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
AAA~AA 格	38,507	95.07	95.25	8.88	0.77	1.15	1.10	7.26	7.21	7.22	25
短期 (1-3)	10,785	99.54	99.63	2.03	0.41	0.64	0.64	2.02	2.02	2.02	24
中期 (3-7)	12,915	99.24	99.41	4.68	0.72	0.88	0.87	4.60	4.58	4.60	26
長期 (7-)	14,807	88.19	88.42	17.52	1.08	1.84	1.71	14.18	14.05	14.05	26
長期 (7-11)	5,197	98.21	98.44	8.74	1.00	1.23	1.22	8.35	8.30	8.35	28
超長期 (11-)	9,609	82.77	83.00	22.27	1.11	2.23	2.02	17.92	17.73	17.70	25
AAA~A 格	63,424	95.40	95.56	7.77	0.73	1.19	1.15	6.59	6.54	6.55	36
短期 (1-3)	18,697	99.38	99.48	2.06	0.42	0.72	0.72	2.05	2.04	2.05	32
中期 (3-7)	22,509	98.55	98.71	4.74	0.69	0.99	0.98	4.65	4.63	4.65	36
長期 (7-)	22,218	88.86	89.08	15.63	1.03	1.86	1.74	13.02	12.90	12.92	38
長期 (7-11)	9,244	96.92	97.14	8.66	0.97	1.38	1.36	8.29	8.23	8.28	42
超長期 (11-)	12,974	83.11	83.34	20.60	1.08	2.26	2.06	16.96	16.78	16.78	36
AAA~BBB 格	63,563	95.40	95.56	7.76	0.73	1.19	1.15	6.58	6.53	6.55	36
短期 (1-3)	18,759	99.37	99.47	2.06	0.43	0.73	0.73	2.05	2.04	2.05	33
中期 (3-7)	22,575	98.54	98.70	4.74	0.69	0.99	0.98	4.65	4.63	4.65	36
長期 (7-)	22,229	88.85	89.08	15.63	1.03	1.86	1.74	13.02	12.90	12.92	39
長期 (7-11)	9,255	96.89	97.11	8.66	0.97	1.38	1.36	8.29	8.23	8.28	42
超長期 (11-)	12,974	83.11	83.34	20.60	1.08	2.26	2.06	16.96	16.78	16.78	36
AAA~BB 格	63,563	95.40	95.56	7.76	0.73	1.19	1.15	6.58	6.53	6.55	36
短期 (1-3)	18,759	99.37	99.47	2.06	0.43	0.73	0.73	2.05	2.04	2.05	33
中期 (3-7)	22,575	98.54	98.70	4.74	0.69	0.99	0.98	4.65	4.63	4.65	36
長期 (7-)	22,229	88.85	89.08	15.63	1.03	1.86	1.74	13.02	12.90	12.92	39
長期 (7-11)	9,255	96.89	97.11	8.66	0.97	1.38	1.36	8.29	8.23	8.28	42
超長期 (11-)	12,974	83.11	83.34	20.60	1.08	2.26	2.06	16.96	16.78	16.78	36
AAA 格	955	97.95	98.03	3.78	0.31	0.81	0.80	3.69	3.67	3.68	26
短期 (1-3)	505	99.03	99.07	2.10	0.19	0.66	0.66	2.09	2.09	2.09	25
中期 (3-7)	350	97.84	97.96	4.54	0.41	0.88	0.87	4.48	4.46	4.48	26
長期 (7-)	100	92.88	92.97	9.64	0.57	1.37	1.32	9.31	9.25	9.30	29
長期 (7-11)	70	95.30	95.40	8.55	0.62	1.23	1.20	8.32	8.27	8.32	27
超長期 (11-)	30	87.22	87.30	12.17	0.45	1.72	1.61	11.82	11.73	11.81	32
AA 格	37,552	95.00	95.18	9.01	0.78	1.16	1.11	7.36	7.30	7.31	25
短期 (1-3)	10,280	99.56	99.65	2.03	0.42	0.64	0.64	2.02	2.01	2.02	24
中期 (3-7)	12,565	99.28	99.45	4.69	0.73	0.88	0.87	4.60	4.58	4.60	26
長期 (7-)	14,707	88.16	88.39	17.57	1.08	1.84	1.71	14.22	14.08	14.08	26
長期 (7-11)	5,127	98.25	98.48	8.75	1.01	1.23	1.22	8.36	8.30	8.35	28
超長期 (11-)	9,579	82.75	82.99	22.30	1.12	2.23	2.03	17.94	17.75	17.72	25
A 格	24,917	95.90	96.05	6.05	0.67	1.26	1.22	5.55	5.51	5.54	51
短期 (1-3)	7,911	99.17	99.27	2.10	0.45	0.84	0.84	2.09	2.08	2.09	43
中期 (3-7)	9,594	97.62	97.76	4.81	0.64	1.14	1.13	4.72	4.70	4.72	50
長期 (7-)	7,412	90.19	90.40	11.87	0.95	1.90	1.80	10.76	10.66	10.73	62
長期 (7-11)	4,047	95.25	95.47	8.56	0.92	1.57	1.53	8.20	8.14	8.20	61
超長期 (11-)	3,365	84.10	84.32	15.84	0.98	2.36	2.17	14.24	14.09	14.18	65
BBB 格	140	95.29	95.48	3.66	0.95	2.21	2.14	3.51	3.47	3.51	160
短期 (1-3)	63	97.24	97.38	2.30	0.82	2.07	2.04	2.28	2.26	2.28	161
中期 (3-7)	66	96.50	96.74	4.32	1.06	1.91	1.87	4.22	4.18	4.22	128
長期 (7-)	11	76.92	77.05	7.38	1.07	5.46	4.82	7.06	6.89	7.06	401
長期 (7-11)	11	76.92	77.05	7.38	1.07	5.46	4.82	7.06	6.89	7.06	401
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
BB 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
B 格以下	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
格付なし	5,916	96.23	96.38	5.20	0.69	1.32	1.27	4.88	4.84	4.88	63
短期 (1-3)	1,852	99.16	99.31	1.96	0.59	1.00	0.99	1.94	1.93	1.94	60
中期 (3-7)	2,688	97.42	97.56	4.67	0.59	1.16	1.14	4.59	4.57	4.59	52
長期 (7-)	1,376	89.93	90.12	10.61	1.00	2.14	1.98	9.85	9.75	9.83	89
長期 (7-11)	866	94.00	94.21	8.36	1.10	1.98	1.86	7.97	7.90	7.97	96
超長期 (11-)	510	83.02	83.18	14.42	0.85	2.46	2.20	13.44	13.30	13.41	75

出所:NFRC

- 格付は、R&Iの格付をもとに NFRC で分類

事業債 JCR 格付別・ポートフォリオ指標 (2024年7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	29,202	96.18	96.31	6.02	0.54	1.05	1.02	5.34	5.30	5.32	33
短期 (1-3)	9,952	99.30	99.37	1.99	0.35	0.69	0.69	1.98	1.98	1.98	30
中期 (3-7)	11,729	97.96	98.08	4.65	0.52	0.95	0.94	4.58	4.56	4.58	33
長期 (7-)	7,521	89.29	89.47	13.47	0.84	1.74	1.63	11.57	11.47	11.51	40
長期 (7-11)	4,100	95.81	95.99	8.39	0.76	1.34	1.31	8.11	8.06	8.11	40
超長期 (11-)	3,421	81.47	81.66	19.56	0.93	2.30	2.07	16.46	16.28	16.31	40
AAA~A 格	41,050	96.05	96.19	5.97	0.62	1.16	1.13	5.36	5.33	5.35	44
短期 (1-3)	13,380	99.23	99.33	2.00	0.39	0.76	0.76	1.99	1.98	1.99	37
中期 (3-7)	16,450	97.91	98.06	4.66	0.60	1.04	1.03	4.58	4.55	4.58	42
長期 (7-)	11,220	89.51	89.72	12.64	0.92	1.88	1.77	11.08	10.98	11.04	57
長期 (7-11)	6,259	95.09	95.29	8.48	0.87	1.54	1.50	8.15	8.09	8.15	58
超長期 (11-)	4,960	82.47	82.69	17.90	0.97	2.37	2.15	15.35	15.18	15.24	56
AAA~BBB 格	41,050	96.05	96.19	5.97	0.62	1.16	1.13	5.36	5.33	5.35	44
短期 (1-3)	13,380	99.23	99.33	2.00	0.39	0.76	0.76	1.99	1.98	1.99	37
中期 (3-7)	16,450	97.91	98.06	4.66	0.60	1.04	1.03	4.58	4.55	4.58	42
長期 (7-)	11,220	89.51	89.72	12.64	0.92	1.88	1.77	11.08	10.98	11.04	57
長期 (7-11)	6,259	95.09	95.29	8.48	0.87	1.54	1.50	8.15	8.09	8.15	58
超長期 (11-)	4,960	82.47	82.69	17.90	0.97	2.37	2.15	15.35	15.18	15.24	56
AAA~BB 格	41,050	96.05	96.19	5.97	0.62	1.16	1.13	5.36	5.33	5.35	44
短期 (1-3)	13,380	99.23	99.33	2.00	0.39	0.76	0.76	1.99	1.98	1.99	37
中期 (3-7)	16,450	97.91	98.06	4.66	0.60	1.04	1.03	4.58	4.55	4.58	42
長期 (7-)	11,220	89.51	89.72	12.64	0.92	1.88	1.77	11.08	10.98	11.04	57
長期 (7-11)	6,259	95.09	95.29	8.48	0.87	1.54	1.50	8.15	8.09	8.15	58
超長期 (11-)	4,960	82.47	82.69	17.90	0.97	2.37	2.15	15.35	15.18	15.24	56
AAA 格	10,515	96.65	96.75	5.64	0.40	0.86	0.84	4.84	4.81	4.81	20
短期 (1-3)	4,025	99.17	99.22	1.92	0.16	0.58	0.58	1.92	1.91	1.92	20
中期 (3-7)	4,622	98.15	98.28	4.60	0.42	0.81	0.81	4.54	4.52	4.54	20
長期 (7-)	1,869	87.51	87.69	16.24	0.84	1.68	1.54	12.77	12.65	12.63	25
長期 (7-11)	1,067	96.37	96.51	8.41	0.71	1.19	1.17	8.15	8.10	8.15	26
超長期 (11-)	802	75.73	75.96	26.67	1.02	2.49	2.16	20.58	20.35	20.22	25
AA 格	18,686	95.92	96.05	6.22	0.63	1.15	1.12	5.63	5.59	5.61	41
短期 (1-3)	5,928	99.38	99.48	2.04	0.48	0.77	0.77	2.03	2.02	2.03	37
中期 (3-7)	7,108	97.84	97.96	4.68	0.58	1.04	1.03	4.61	4.58	4.61	41
長期 (7-)	5,651	89.88	90.06	12.55	0.84	1.76	1.66	11.19	11.09	11.15	45
長期 (7-11)	3,033	95.62	95.80	8.38	0.79	1.39	1.36	8.09	8.04	8.09	45
超長期 (11-)	2,619	83.22	83.41	17.39	0.90	2.24	2.05	15.31	15.15	15.22	45
A 格	11,848	95.72	95.91	5.87	0.80	1.44	1.40	5.43	5.38	5.42	70
短期 (1-3)	3,428	99.06	99.19	2.02	0.52	0.97	0.96	2.01	2.00	2.01	57
中期 (3-7)	4,721	97.80	97.99	4.68	0.79	1.27	1.25	4.58	4.55	4.58	64
長期 (7-)	3,699	89.96	90.21	10.96	1.07	2.18	2.04	10.09	9.99	10.07	91
長期 (7-11)	2,160	93.71	93.95	8.65	1.07	1.94	1.86	8.23	8.15	8.22	92
超長期 (11-)	1,540	84.71	84.97	14.20	1.07	2.54	2.33	12.98	12.83	12.95	90
BBB 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
BB 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
B 格以下	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
格付なし	27,880	94.54	94.73	9.81	0.88	1.27	1.21	7.98	7.92	7.93	30
短期 (1-3)	7,044	99.61	99.72	2.06	0.52	0.72	0.72	2.05	2.04	2.05	32
中期 (3-7)	8,576	99.41	99.61	4.76	0.82	0.94	0.93	4.66	4.64	4.66	31
長期 (7-)	12,260	88.21	88.45	17.79	1.12	1.88	1.75	14.44	14.30	14.30	28
長期 (7-11)	3,760	99.01	99.27	8.76	1.13	1.26	1.25	8.33	8.28	8.32	30
超長期 (11-)	8,500	83.43	83.66	21.78	1.12	2.21	2.02	17.65	17.47	17.44	26

出所:NFRC

- 格付は、JCR の格付をもとに NFRC で分類

事業債 JCR 格付別・ポートフォリオ指標 (2024年7月末、8月ポートフォリオ)

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
AAA~AA 格	29,686	96.23	96.35	6.03	0.55	1.05	1.02	5.36	5.32	5.34	34
短期 (1-3)	10,165	99.28	99.36	2.02	0.35	0.70	0.69	2.01	2.01	2.01	30
中期 (3-7)	11,856	97.98	98.10	4.68	0.53	0.95	0.95	4.61	4.58	4.61	33
長期 (7-)	7,665	89.47	89.65	13.42	0.85	1.73	1.63	11.54	11.44	11.48	40
長期 (7-11)	4,217	95.95	96.12	8.43	0.79	1.34	1.32	8.14	8.09	8.14	40
超長期 (11-)	3,448	81.53	81.73	19.53	0.93	2.30	2.07	16.43	16.26	16.28	41
AAA~A 格	41,461	96.08	96.23	5.99	0.62	1.16	1.13	5.38	5.34	5.37	44
短期 (1-3)	13,654	99.23	99.32	2.04	0.40	0.77	0.76	2.02	2.02	2.02	37
中期 (3-7)	16,573	97.90	98.04	4.71	0.60	1.05	1.04	4.63	4.60	4.62	42
長期 (7-)	11,234	89.59	89.79	12.68	0.93	1.88	1.76	11.11	11.01	11.06	57
長期 (7-11)	6,266	95.21	95.41	8.53	0.89	1.54	1.50	8.20	8.13	8.19	57
超長期 (11-)	4,967	82.49	82.71	17.90	0.98	2.37	2.15	15.35	15.18	15.24	56
AAA~BBB 格	41,461	96.08	96.23	5.99	0.62	1.16	1.13	5.38	5.34	5.37	44
短期 (1-3)	13,654	99.23	99.32	2.04	0.40	0.77	0.76	2.02	2.02	2.02	37
中期 (3-7)	16,573	97.90	98.04	4.71	0.60	1.05	1.04	4.63	4.60	4.62	42
長期 (7-)	11,234	89.59	89.79	12.68	0.93	1.88	1.76	11.11	11.01	11.06	57
長期 (7-11)	6,266	95.21	95.41	8.53	0.89	1.54	1.50	8.20	8.13	8.19	57
超長期 (11-)	4,967	82.49	82.71	17.90	0.98	2.37	2.15	15.35	15.18	15.24	56
AAA~BB 格	41,461	96.08	96.23	5.99	0.62	1.16	1.13	5.38	5.34	5.37	44
短期 (1-3)	13,654	99.23	99.32	2.04	0.40	0.77	0.76	2.02	2.02	2.02	37
中期 (3-7)	16,573	97.90	98.04	4.71	0.60	1.05	1.04	4.63	4.60	4.62	42
長期 (7-)	11,234	89.59	89.79	12.68	0.93	1.88	1.76	11.11	11.01	11.06	57
長期 (7-11)	6,266	95.21	95.41	8.53	0.89	1.54	1.50	8.20	8.13	8.19	57
超長期 (11-)	4,967	82.49	82.71	17.90	0.98	2.37	2.15	15.35	15.18	15.24	56
AAA 格	10,887	96.76	96.87	5.65	0.42	0.87	0.84	4.86	4.83	4.84	21
短期 (1-3)	4,192	99.17	99.21	1.97	0.17	0.58	0.58	1.96	1.95	1.96	19
中期 (3-7)	4,727	98.21	98.34	4.63	0.45	0.82	0.82	4.57	4.55	4.57	20
長期 (7-)	1,969	88.17	88.35	15.91	0.87	1.66	1.53	12.55	12.44	12.42	26
長期 (7-11)	1,167	96.72	96.87	8.51	0.77	1.21	1.20	8.23	8.18	8.22	27
超長期 (11-)	802	75.73	75.96	26.67	1.02	2.49	2.16	20.58	20.35	20.22	25
AA 格	18,798	95.92	96.05	6.25	0.63	1.16	1.12	5.65	5.61	5.64	41
短期 (1-3)	5,974	99.36	99.47	2.06	0.48	0.77	0.77	2.05	2.04	2.05	37
中期 (3-7)	7,130	97.82	97.95	4.71	0.58	1.04	1.03	4.63	4.61	4.63	41
長期 (7-)	5,695	89.91	90.10	12.56	0.84	1.76	1.66	11.20	11.10	11.16	45
長期 (7-11)	3,050	95.66	95.84	8.40	0.79	1.39	1.36	8.11	8.05	8.10	45
超長期 (11-)	2,646	83.29	83.48	17.36	0.90	2.24	2.05	15.29	15.13	15.20	45
A 格	11,775	95.72	95.91	5.89	0.80	1.45	1.40	5.44	5.40	5.44	70
短期 (1-3)	3,489	99.06	99.19	2.07	0.53	0.98	0.97	2.06	2.05	2.06	57
中期 (3-7)	4,716	97.70	97.88	4.78	0.79	1.28	1.26	4.67	4.64	4.67	64
長期 (7-)	3,569	89.85	90.10	11.08	1.08	2.20	2.06	10.19	10.09	10.17	92
長期 (7-11)	2,050	93.69	93.93	8.75	1.09	1.96	1.88	8.31	8.24	8.31	93
超長期 (11-)	1,520	84.67	84.93	14.22	1.08	2.55	2.33	12.99	12.84	12.96	90
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	28,019	94.56	94.75	9.84	0.89	1.27	1.22	8.02	7.95	7.96	30
短期 (1-3)	6,957	99.61	99.72	2.08	0.53	0.72	0.72	2.07	2.06	2.07	32
中期 (3-7)	8,690	99.42	99.61	4.78	0.83	0.94	0.93	4.68	4.66	4.68	31
長期 (7-)	12,372	88.30	88.54	17.75	1.13	1.88	1.75	14.42	14.28	14.28	28
長期 (7-11)	3,855	98.98	99.24	8.80	1.13	1.26	1.25	8.36	8.31	8.36	30
超長期 (11-)	8,517	83.47	83.70	21.81	1.13	2.21	2.02	17.67	17.49	17.46	26

出所:NFRC

- 格付は、JCRの格付をもとに NFRC で分類

事業債 Moody's 格付別・ポートフォリオ指標 (2024年7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	22,918	95.63	95.78	8.69	0.78	1.14	1.10	7.28	7.22	7.23	25
短期 (1-3)	6,666	99.51	99.58	2.02	0.39	0.63	0.63	2.01	2.01	2.01	24
中期 (3-7)	7,278	99.02	99.17	4.63	0.66	0.85	0.84	4.55	4.53	4.55	23
長期 (7-)	8,974	90.01	90.20	16.95	1.16	1.83	1.72	14.02	13.89	13.90	28
長期 (7-11)	3,073	98.31	98.51	8.76	1.03	1.26	1.25	8.37	8.32	8.36	30
超長期 (11-)	5,901	85.69	85.88	21.21	1.22	2.17	2.01	17.40	17.22	17.21	27
AAA~BBB 格	24,942	95.64	95.79	8.58	0.78	1.16	1.12	7.21	7.15	7.16	27
短期 (1-3)	6,996	99.48	99.56	2.03	0.39	0.64	0.64	2.02	2.01	2.02	24
中期 (3-7)	8,334	99.01	99.17	4.64	0.70	0.89	0.89	4.56	4.54	4.56	27
長期 (7-)	9,613	89.92	90.11	16.75	1.15	1.84	1.73	13.90	13.77	13.79	29
長期 (7-11)	3,370	98.13	98.33	8.76	1.02	1.27	1.26	8.37	8.31	8.36	31
超長期 (11-)	6,243	85.49	85.68	21.06	1.21	2.19	2.02	17.33	17.15	17.15	28
AAA~BB 格	24,942	95.64	95.79	8.58	0.78	1.16	1.12	7.21	7.15	7.16	27
短期 (1-3)	6,996	99.48	99.56	2.03	0.39	0.64	0.64	2.02	2.01	2.02	24
中期 (3-7)	8,334	99.01	99.17	4.64	0.70	0.89	0.89	4.56	4.54	4.56	27
長期 (7-)	9,613	89.92	90.11	16.75	1.15	1.84	1.73	13.90	13.77	13.79	29
長期 (7-11)	3,370	98.13	98.33	8.76	1.02	1.27	1.26	8.37	8.31	8.36	31
超長期 (11-)	6,243	85.49	85.68	21.06	1.21	2.19	2.02	17.33	17.15	17.15	28
AAA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
A 格	22,918	95.63	95.78	8.69	0.78	1.14	1.10	7.28	7.22	7.23	25
短期 (1-3)	6,666	99.51	99.58	2.02	0.39	0.63	0.63	2.01	2.01	2.01	24
中期 (3-7)	7,278	99.02	99.17	4.63	0.66	0.85	0.84	4.55	4.53	4.55	23
長期 (7-)	8,974	90.01	90.20	16.95	1.16	1.83	1.72	14.02	13.89	13.90	28
長期 (7-11)	3,073	98.31	98.51	8.76	1.03	1.26	1.25	8.37	8.32	8.36	30
超長期 (11-)	5,901	85.69	85.88	21.21	1.22	2.17	2.01	17.40	17.22	17.21	27
BBB 格	2,024	95.72	95.92	7.23	0.86	1.33	1.29	6.42	6.37	6.40	50
短期 (1-3)	330	99.05	99.12	2.16	0.29	0.72	0.72	2.15	2.15	2.15	30
中期 (3-7)	1,056	98.96	99.18	4.72	0.96	1.19	1.18	4.61	4.58	4.61	56
長期 (7-)	638	88.65	88.87	13.99	0.99	1.94	1.82	12.22	12.10	12.16	51
長期 (7-11)	297	96.26	96.48	8.69	0.91	1.40	1.38	8.34	8.28	8.33	44
超長期 (11-)	341	82.03	82.24	18.60	1.07	2.49	2.26	16.18	16.00	16.07	58
BB 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
B 格以下	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
格付なし	43,987	95.32	95.49	6.93	0.69	1.23	1.18	5.96	5.92	5.94	45
短期 (1-3)	13,428	99.30	99.41	2.02	0.46	0.81	0.80	2.01	2.00	2.01	41
中期 (3-7)	16,692	98.14	98.30	4.72	0.66	1.06	1.05	4.63	4.61	4.63	43
長期 (7-)	13,867	88.07	88.32	14.35	0.94	1.91	1.78	12.06	11.95	11.98	51
長期 (7-11)	6,649	95.76	95.99	8.50	0.94	1.52	1.48	8.14	8.08	8.14	56
超長期 (11-)	7,218	80.99	81.25	19.74	0.94	2.35	2.11	16.33	16.16	16.16	45

出所:NFRFC

- 格付は、Moody's の格付をもとに NFRFC で分類

事業債 Moody's 格付別・ポートフォリオ指標 (2024年7月末、8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	23,831	95.65	95.80	8.75	0.79	1.15	1.11	7.35	7.29	7.30	25
短期 (1-3)	6,811	99.49	99.57	2.05	0.39	0.64	0.64	2.04	2.04	2.04	24
中期 (3-7)	7,525	99.17	99.32	4.68	0.69	0.85	0.84	4.60	4.58	4.60	23
長期 (7-)	9,496	90.11	90.30	16.77	1.14	1.81	1.71	13.93	13.80	13.82	27
長期 (7-11)	3,267	98.38	98.57	8.78	1.03	1.25	1.24	8.38	8.33	8.38	29
超長期 (11-)	6,229	85.77	85.96	20.96	1.20	2.15	1.99	17.27	17.09	17.09	26
AAA~BBB 格	25,836	95.65	95.80	8.63	0.79	1.16	1.12	7.28	7.22	7.24	27
短期 (1-3)	7,121	99.47	99.55	2.06	0.39	0.64	0.64	2.05	2.05	2.05	24
中期 (3-7)	8,581	99.14	99.30	4.69	0.72	0.89	0.89	4.60	4.58	4.60	27
長期 (7-)	10,134	90.02	90.21	16.59	1.13	1.82	1.72	13.83	13.70	13.72	29
長期 (7-11)	3,564	98.20	98.40	8.77	1.02	1.26	1.25	8.38	8.32	8.37	30
超長期 (11-)	6,571	85.58	85.77	20.84	1.20	2.17	2.01	17.22	17.04	17.04	27
AAA~BB 格	25,836	95.65	95.80	8.63	0.79	1.16	1.12	7.28	7.22	7.24	27
短期 (1-3)	7,121	99.47	99.55	2.06	0.39	0.64	0.64	2.05	2.05	2.05	24
中期 (3-7)	8,581	99.14	99.30	4.69	0.72	0.89	0.89	4.60	4.58	4.60	27
長期 (7-)	10,134	90.02	90.21	16.59	1.13	1.82	1.72	13.83	13.70	13.72	29
長期 (7-11)	3,564	98.20	98.40	8.77	1.02	1.26	1.25	8.38	8.32	8.37	30
超長期 (11-)	6,571	85.58	85.77	20.84	1.20	2.17	2.01	17.22	17.04	17.04	27
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	23,831	95.65	95.80	8.75	0.79	1.15	1.11	7.35	7.29	7.30	25
短期 (1-3)	6,811	99.49	99.57	2.05	0.39	0.64	0.64	2.04	2.04	2.04	24
中期 (3-7)	7,525	99.17	99.32	4.68	0.69	0.85	0.84	4.60	4.58	4.60	23
長期 (7-)	9,496	90.11	90.30	16.77	1.14	1.81	1.71	13.93	13.80	13.82	27
長期 (7-11)	3,267	98.38	98.57	8.78	1.03	1.25	1.24	8.38	8.33	8.38	29
超長期 (11-)	6,229	85.77	85.96	20.96	1.20	2.15	1.99	17.27	17.09	17.09	26
BBB 格	2,004	95.68	95.88	7.29	0.86	1.34	1.30	6.47	6.42	6.46	51
短期 (1-3)	310	99.01	99.07	2.23	0.29	0.73	0.73	2.22	2.22	2.22	30
中期 (3-7)	1,056	98.96	99.18	4.72	0.96	1.19	1.18	4.61	4.58	4.61	56
長期 (7-)	638	88.65	88.87	13.99	0.99	1.94	1.82	12.22	12.10	12.16	51
長期 (7-11)	297	96.26	96.48	8.69	0.91	1.40	1.38	8.34	8.28	8.33	44
超長期 (11-)	341	82.03	82.24	18.60	1.07	2.49	2.26	16.18	16.00	16.07	58
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	43,644	95.36	95.53	6.89	0.69	1.23	1.19	5.93	5.89	5.91	45
短期 (1-3)	13,491	99.29	99.40	2.05	0.47	0.81	0.81	2.03	2.03	2.03	41
中期 (3-7)	16,682	98.05	98.21	4.75	0.66	1.07	1.06	4.67	4.64	4.67	44
長期 (7-)	13,471	88.08	88.33	14.39	0.95	1.92	1.79	12.07	11.95	11.99	51
長期 (7-11)	6,558	95.80	96.03	8.56	0.96	1.52	1.48	8.20	8.14	8.19	56
超長期 (11-)	6,914	80.76	81.03	19.92	0.95	2.37	2.13	16.43	16.25	16.25	47

出所:NFRC

- 格付は、Moody's の格付をもとに NFRC で分類

事業債 S&P 格付別・ポートフォリオ指標 (2024年7月末)

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
AAA~AA 格	851	84.49	84.70	17.79	0.98	1.87	1.68	13.69	13.55	13.55	31
短期 (1-3)	40	102.72	102.93	2.40	1.75	0.69	0.69	2.36	2.35	2.36	25
中期 (3-7)	115	95.77	95.82	5.66	0.22	0.99	0.97	5.61	5.58	5.61	29
長期 (7-)	696	81.58	81.81	20.68	1.06	2.13	1.89	16.07	15.90	15.90	32
長期 (7-11)	212	99.92	100.22	8.87	1.25	1.26	1.26	8.39	8.33	8.38	30
超長期 (11-)	484	73.54	73.75	25.85	0.98	2.65	2.27	20.65	20.41	20.38	33
AAA~A 格	16,203	94.18	94.38	9.08	0.74	1.18	1.12	7.42	7.36	7.37	26
短期 (1-3)	3,995	99.65	99.76	2.01	0.43	0.63	0.63	2.00	2.00	2.00	23
中期 (3-7)	5,446	98.86	99.03	4.92	0.67	0.89	0.89	4.83	4.81	4.83	26
長期 (7-)	6,762	87.17	87.45	16.61	0.96	1.80	1.66	13.43	13.31	13.31	28
長期 (7-11)	2,738	98.40	98.67	8.59	1.02	1.22	1.21	8.21	8.16	8.20	28
超長期 (11-)	4,025	79.53	79.82	22.07	0.93	2.29	2.04	17.83	17.64	17.61	28
AAA~BBB 格	16,675	94.29	94.49	8.92	0.73	1.17	1.12	7.30	7.24	7.25	27
短期 (1-3)	4,251	99.62	99.72	2.01	0.44	0.65	0.64	2.00	1.99	2.00	25
中期 (3-7)	5,617	98.84	99.02	4.90	0.67	0.90	0.89	4.80	4.78	4.80	26
長期 (7-)	6,807	87.22	87.50	16.56	0.96	1.80	1.66	13.40	13.27	13.28	28
長期 (7-11)	2,772	98.38	98.65	8.58	1.02	1.22	1.21	8.20	8.15	8.20	29
超長期 (11-)	4,035	79.55	79.84	22.05	0.93	2.29	2.04	17.81	17.62	17.60	28
AAA~BB 格	16,915	94.38	94.59	8.88	0.75	1.18	1.13	7.27	7.21	7.22	28
短期 (1-3)	4,251	99.62	99.72	2.01	0.44	0.65	0.64	2.00	1.99	2.00	25
中期 (3-7)	5,832	98.93	99.12	4.89	0.73	0.94	0.93	4.79	4.77	4.79	30
長期 (7-)	6,832	87.23	87.51	16.56	0.97	1.81	1.66	13.40	13.27	13.28	29
長期 (7-11)	2,772	98.38	98.65	8.58	1.02	1.22	1.21	8.20	8.15	8.20	29
超長期 (11-)	4,060	79.63	79.91	22.01	0.94	2.30	2.04	17.78	17.59	17.56	29
AAA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA 格	851	84.49	84.70	17.79	0.98	1.87	1.68	13.69	13.55	13.55	31
短期 (1-3)	40	102.72	102.93	2.40	1.75	0.69	0.69	2.36	2.35	2.36	25
中期 (3-7)	115	95.77	95.82	5.66	0.22	0.99	0.97	5.61	5.58	5.61	29
長期 (7-)	696	81.58	81.81	20.68	1.06	2.13	1.89	16.07	15.90	15.90	32
長期 (7-11)	212	99.92	100.22	8.87	1.25	1.26	1.26	8.39	8.33	8.38	30
超長期 (11-)	484	73.54	73.75	25.85	0.98	2.65	2.27	20.65	20.41	20.38	33
A 格	15,352	94.71	94.91	8.60	0.72	1.14	1.09	7.11	7.06	7.07	26
短期 (1-3)	3,955	99.62	99.72	2.01	0.42	0.63	0.63	2.00	1.99	2.00	23
中期 (3-7)	5,331	98.93	99.10	4.91	0.68	0.89	0.89	4.81	4.79	4.81	25
長期 (7-)	6,066	87.81	88.10	16.14	0.95	1.77	1.63	13.15	13.03	13.04	28
長期 (7-11)	2,526	98.27	98.54	8.57	1.00	1.22	1.21	8.19	8.14	8.19	28
超長期 (11-)	3,541	80.35	80.65	21.55	0.92	2.25	2.01	17.47	17.29	17.26	27
BBB 格	473	98.31	98.50	3.35	0.58	1.04	1.03	3.24	3.22	3.24	53
短期 (1-3)	257	99.05	99.22	1.88	0.48	0.93	0.93	1.87	1.86	1.87	55
中期 (3-7)	172	98.29	98.46	3.97	0.63	1.07	1.06	3.91	3.89	3.91	49
長期 (7-)	45	94.16	94.47	9.42	0.97	1.62	1.57	8.84	8.76	8.83	57
長期 (7-11)	35	96.73	97.08	8.13	0.97	1.43	1.41	7.79	7.74	7.79	52
超長期 (11-)	10	85.31	85.43	13.87	0.95	2.36	2.18	12.92	12.78	12.89	77
BB 格	240	100.33	100.90	5.83	2.26	2.04	2.04	5.26	5.20	5.25	134
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	215	101.28	101.87	4.66	2.25	1.93	1.94	4.43	4.38	4.42	133
長期 (7-)	25	92.16	92.57	15.82	2.37	3.11	2.99	13.10	12.91	13.02	146
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	25	92.16	92.57	15.82	2.37	3.11	2.99	13.10	12.91	13.02	146
B 格以下	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
格付なし	52,014	95.78	95.93	7.09	0.71	1.21	1.17	6.14	6.09	6.12	41
短期 (1-3)	16,173	99.30	99.39	2.03	0.44	0.78	0.77	2.01	2.01	2.01	38
中期 (3-7)	19,194	98.27	98.43	4.64	0.66	1.03	1.02	4.55	4.53	4.55	40
長期 (7-)	16,648	89.48	89.69	14.83	1.05	1.91	1.80	12.59	12.47	12.51	47
長期 (7-11)	7,247	95.86	96.07	8.58	0.95	1.51	1.48	8.22	8.16	8.22	54
超長期 (11-)	9,400	84.57	84.77	19.64	1.12	2.26	2.08	16.41	16.24	16.26	40

出所:NFRC

- 格付は、S&P の格付をもとに NFRC で分類

事業債 S&P 格付別・ポートフォリオ指標 (2024年7月末、8月ポートフォリオ)

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
AAA~AA 格	851	84.49	84.70	17.79	0.98	1.87	1.68	13.69	13.55	13.55	31
短期 (1-3)	40	102.72	102.93	2.40	1.75	0.69	0.69	2.36	2.35	2.36	25
中期 (3-7)	115	95.77	95.82	5.66	0.22	0.99	0.97	5.61	5.58	5.61	29
長期 (7-)	696	81.58	81.81	20.68	1.06	2.13	1.89	16.07	15.90	15.90	32
長期 (7-11)	212	99.92	100.22	8.87	1.25	1.26	1.26	8.39	8.33	8.38	30
超長期 (11-)	484	73.54	73.75	25.85	0.98	2.65	2.27	20.65	20.41	20.38	33
AAA~A 格	16,488	94.28	94.48	9.05	0.74	1.18	1.12	7.41	7.35	7.36	26
短期 (1-3)	4,005	99.65	99.75	2.03	0.44	0.63	0.63	2.02	2.02	2.02	23
中期 (3-7)	5,611	98.89	99.07	4.94	0.68	0.90	0.89	4.84	4.82	4.84	26
長期 (7-)	6,872	87.38	87.66	16.50	0.97	1.80	1.65	13.35	13.23	13.23	28
長期 (7-11)	2,868	98.47	98.74	8.65	1.04	1.23	1.22	8.25	8.20	8.25	29
超長期 (11-)	4,005	79.44	79.73	22.12	0.93	2.30	2.04	17.87	17.68	17.65	28
AAA~BBB 格	16,960	94.39	94.59	8.89	0.74	1.17	1.12	7.29	7.23	7.24	27
短期 (1-3)	4,271	99.61	99.72	2.03	0.44	0.65	0.65	2.02	2.01	2.02	25
中期 (3-7)	5,772	98.88	99.05	4.91	0.68	0.90	0.90	4.82	4.79	4.82	26
長期 (7-)	6,917	87.42	87.70	16.45	0.97	1.79	1.65	13.32	13.20	13.20	28
長期 (7-11)	2,902	98.45	98.72	8.64	1.04	1.23	1.22	8.25	8.20	8.24	29
超長期 (11-)	4,015	79.45	79.74	22.10	0.93	2.30	2.04	17.86	17.67	17.64	28
AAA~BB 格	17,200	94.47	94.68	8.85	0.76	1.18	1.13	7.26	7.20	7.21	28
短期 (1-3)	4,271	99.61	99.72	2.03	0.44	0.65	0.65	2.02	2.01	2.02	25
中期 (3-7)	5,987	98.96	99.15	4.90	0.74	0.94	0.93	4.80	4.78	4.80	30
長期 (7-)	6,942	87.44	87.72	16.45	0.98	1.80	1.66	13.32	13.20	13.20	29
長期 (7-11)	2,902	98.45	98.72	8.64	1.04	1.23	1.22	8.25	8.20	8.24	29
超長期 (11-)	4,040	79.53	79.82	22.06	0.94	2.30	2.05	17.83	17.64	17.61	29
AAA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA 格	851	84.49	84.70	17.79	0.98	1.87	1.68	13.69	13.55	13.55	31
短期 (1-3)	40	102.72	102.93	2.40	1.75	0.69	0.69	2.36	2.35	2.36	25
中期 (3-7)	115	95.77	95.82	5.66	0.22	0.99	0.97	5.61	5.58	5.61	29
長期 (7-)	696	81.58	81.81	20.68	1.06	2.13	1.89	16.07	15.90	15.90	32
長期 (7-11)	212	99.92	100.22	8.87	1.25	1.26	1.26	8.39	8.33	8.38	30
超長期 (11-)	484	73.54	73.75	25.85	0.98	2.65	2.27	20.65	20.41	20.38	33
A 格	15,637	94.81	95.01	8.57	0.73	1.14	1.09	7.11	7.05	7.06	26
短期 (1-3)	3,965	99.62	99.72	2.03	0.42	0.63	0.63	2.02	2.01	2.02	23
中期 (3-7)	5,496	98.96	99.13	4.92	0.69	0.89	0.89	4.82	4.80	4.82	26
長期 (7-)	6,176	88.03	88.32	16.03	0.96	1.76	1.63	13.07	12.95	12.96	28
長期 (7-11)	2,656	98.36	98.62	8.63	1.02	1.23	1.22	8.24	8.19	8.24	28
超長期 (11-)	3,521	80.25	80.55	21.61	0.92	2.25	2.01	17.52	17.34	17.31	27
BBB 格	473	98.31	98.50	3.35	0.58	1.04	1.03	3.24	3.22	3.24	53
短期 (1-3)	267	99.00	99.18	1.93	0.48	0.94	0.94	1.91	1.91	1.91	55
中期 (3-7)	162	98.31	98.48	4.02	0.65	1.06	1.05	3.97	3.95	3.97	48
長期 (7-)	45	94.16	94.47	9.42	0.97	1.62	1.57	8.84	8.76	8.83	57
長期 (7-11)	35	96.73	97.08	8.13	0.97	1.43	1.41	7.79	7.74	7.79	52
超長期 (11-)	10	85.31	85.43	13.87	0.95	2.36	2.18	12.92	12.78	12.89	77
BB 格	240	100.33	100.90	5.83	2.26	2.04	2.04	5.26	5.20	5.25	134
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	215	101.28	101.87	4.66	2.25	1.93	1.94	4.43	4.38	4.42	133
長期 (7-)	25	92.16	92.57	15.82	2.37	3.11	2.99	13.10	12.91	13.02	146
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	25	92.16	92.57	15.82	2.37	3.11	2.99	13.10	12.91	13.02	146
B 格以下	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
格付なし	52,280	95.80	95.94	7.11	0.72	1.21	1.17	6.17	6.12	6.14	41
短期 (1-3)	16,340	99.29	99.38	2.06	0.44	0.78	0.78	2.05	2.04	2.05	38
中期 (3-7)	19,276	98.25	98.40	4.68	0.66	1.03	1.02	4.59	4.57	4.59	40
長期 (7-)	16,664	89.53	89.73	14.87	1.05	1.91	1.80	12.64	12.51	12.55	47
長期 (7-11)	7,219	95.92	96.12	8.63	0.96	1.51	1.47	8.27	8.21	8.26	54
超長期 (11-)	9,444	84.64	84.84	19.64	1.13	2.26	2.08	16.42	16.25	16.26	40

出所:NFRC

- 格付は、S&P の格付をもとに NFRC で分類

円建外債 最高格付別・ポートフォリオ指標 (2024年7月末)

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
AAA～AA格	1,355	99.18	99.34	3.29	0.83	1.09	1.08	3.21	3.19	3.21	58
短期(1-3)	683	99.52	99.63	2.00	0.71	0.95	0.95	1.99	1.98	1.99	56
中期(3-7)	601	98.99	99.21	4.11	0.92	1.18	1.17	4.03	4.00	4.03	59
長期(7-)	71	97.39	97.61	8.76	1.21	1.58	1.56	8.26	8.20	8.25	62
長期(7-11)	67	97.48	97.71	8.42	1.16	1.53	1.52	8.02	7.96	8.01	60
超長期(11-)	4	95.85	95.92	14.17	1.99	2.38	2.34	12.22	12.08	12.16	94
AAA～A格	3,078	98.85	99.06	3.67	1.04	1.34	1.33	3.50	3.47	3.50	79
短期(1-3)	1,605	99.49	99.66	2.13	0.94	1.16	1.16	2.10	2.09	2.10	75
中期(3-7)	1,197	98.44	98.65	4.09	0.98	1.37	1.36	4.00	3.97	4.00	78
長期(7-)	276	96.92	97.32	10.82	1.86	2.26	2.22	9.60	9.49	9.57	111
長期(7-11)	150	96.37	96.64	8.46	1.34	1.86	1.83	7.98	7.91	7.97	91
超長期(11-)	126	97.58	98.14	13.65	2.49	2.73	2.68	11.51	11.36	11.45	133
AAA～BBB格	3,078	98.85	99.06	3.67	1.04	1.34	1.33	3.50	3.47	3.50	79
短期(1-3)	1,605	99.49	99.66	2.13	0.94	1.16	1.16	2.10	2.09	2.10	75
中期(3-7)	1,197	98.44	98.65	4.09	0.98	1.37	1.36	4.00	3.97	4.00	78
長期(7-)	276	96.92	97.32	10.82	1.86	2.26	2.22	9.60	9.49	9.57	111
長期(7-11)	150	96.37	96.64	8.46	1.34	1.86	1.83	7.98	7.91	7.97	91
超長期(11-)	126	97.58	98.14	13.65	2.49	2.73	2.68	11.51	11.36	11.45	133
AAA～BB格	3,078	98.85	99.06	3.67	1.04	1.34	1.33	3.50	3.47	3.50	79
短期(1-3)	1,605	99.49	99.66	2.13	0.94	1.16	1.16	2.10	2.09	2.10	75
中期(3-7)	1,197	98.44	98.65	4.09	0.98	1.37	1.36	4.00	3.97	4.00	78
長期(7-)	276	96.92	97.32	10.82	1.86	2.26	2.22	9.60	9.49	9.57	111
長期(7-11)	150	96.37	96.64	8.46	1.34	1.86	1.83	7.98	7.91	7.97	91
超長期(11-)	126	97.58	98.14	13.65	2.49	2.73	2.68	11.51	11.36	11.45	133
AAA格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA格	1,355	99.18	99.34	3.29	0.83	1.09	1.08	3.21	3.19	3.21	58
短期(1-3)	683	99.52	99.63	2.00	0.71	0.95	0.95	1.99	1.98	1.99	56
中期(3-7)	601	98.99	99.21	4.11	0.92	1.18	1.17	4.03	4.00	4.03	59
長期(7-)	71	97.39	97.61	8.76	1.21	1.58	1.56	8.26	8.20	8.25	62
長期(7-11)	67	97.48	97.71	8.42	1.16	1.53	1.52	8.02	7.96	8.01	60
超長期(11-)	4	95.85	95.92	14.17	1.99	2.38	2.34	12.22	12.08	12.16	94
A格	1,723	98.60	98.84	3.97	1.20	1.54	1.53	3.73	3.70	3.72	97
短期(1-3)	922	99.46	99.69	2.22	1.10	1.32	1.32	2.19	2.18	2.19	90
中期(3-7)	596	97.89	98.08	4.06	1.03	1.57	1.55	3.98	3.95	3.98	98
長期(7-)	205	96.77	97.22	11.54	2.09	2.49	2.45	10.07	9.94	10.03	127
長期(7-11)	84	95.49	95.78	8.49	1.47	2.13	2.08	7.95	7.87	7.94	116
超長期(11-)	122	97.64	98.21	13.63	2.51	2.74	2.70	11.48	11.33	11.43	135
BBB格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
BB格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
B格以下	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
格付なし	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

出所:NFRC

- 格付は、格付会社4社の最高格付をもとに分類

円建外債 最高格付別・ポートフォリオ指標 (2024年7月末、8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	1,457	99.21	99.36	3.28	0.83	1.08	1.07	3.20	3.19	3.20	57
短期 (1-3)	773	99.54	99.64	2.11	0.72	0.95	0.95	2.09	2.08	2.09	54
中期 (3-7)	613	99.01	99.23	4.12	0.93	1.18	1.17	4.04	4.02	4.04	59
長期 (7-)	71	97.39	97.61	8.76	1.21	1.58	1.56	8.26	8.20	8.25	62
長期 (7-11)	67	97.48	97.71	8.42	1.16	1.53	1.52	8.02	7.96	8.01	60
超長期 (11-)	4	95.85	95.92	14.17	1.99	2.38	2.34	12.22	12.08	12.16	94
AAA~A 格	3,180	98.88	99.08	3.65	1.03	1.33	1.32	3.49	3.46	3.49	78
短期 (1-3)	1,695	99.49	99.66	2.17	0.93	1.15	1.15	2.15	2.13	2.15	74
中期 (3-7)	1,209	98.46	98.66	4.09	0.98	1.37	1.36	4.01	3.98	4.01	78
長期 (7-)	276	96.92	97.32	10.82	1.86	2.26	2.22	9.60	9.49	9.57	111
長期 (7-11)	150	96.37	96.64	8.46	1.34	1.86	1.83	7.98	7.91	7.97	91
超長期 (11-)	126	97.58	98.14	13.65	2.49	2.73	2.68	11.51	11.36	11.45	133
AAA~BBB 格	3,180	98.88	99.08	3.65	1.03	1.33	1.32	3.49	3.46	3.49	78
短期 (1-3)	1,695	99.49	99.66	2.17	0.93	1.15	1.15	2.15	2.13	2.15	74
中期 (3-7)	1,209	98.46	98.66	4.09	0.98	1.37	1.36	4.01	3.98	4.01	78
長期 (7-)	276	96.92	97.32	10.82	1.86	2.26	2.22	9.60	9.49	9.57	111
長期 (7-11)	150	96.37	96.64	8.46	1.34	1.86	1.83	7.98	7.91	7.97	91
超長期 (11-)	126	97.58	98.14	13.65	2.49	2.73	2.68	11.51	11.36	11.45	133
AAA~BB 格	3,180	98.88	99.08	3.65	1.03	1.33	1.32	3.49	3.46	3.49	78
短期 (1-3)	1,695	99.49	99.66	2.17	0.93	1.15	1.15	2.15	2.13	2.15	74
中期 (3-7)	1,209	98.46	98.66	4.09	0.98	1.37	1.36	4.01	3.98	4.01	78
長期 (7-)	276	96.92	97.32	10.82	1.86	2.26	2.22	9.60	9.49	9.57	111
長期 (7-11)	150	96.37	96.64	8.46	1.34	1.86	1.83	7.98	7.91	7.97	91
超長期 (11-)	126	97.58	98.14	13.65	2.49	2.73	2.68	11.51	11.36	11.45	133
AAA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA 格	1,457	99.21	99.36	3.28	0.83	1.08	1.07	3.20	3.19	3.20	57
短期 (1-3)	773	99.54	99.64	2.11	0.72	0.95	0.95	2.09	2.08	2.09	54
中期 (3-7)	613	99.01	99.23	4.12	0.93	1.18	1.17	4.04	4.02	4.04	59
長期 (7-)	71	97.39	97.61	8.76	1.21	1.58	1.56	8.26	8.20	8.25	62
長期 (7-11)	67	97.48	97.71	8.42	1.16	1.53	1.52	8.02	7.96	8.01	60
超長期 (11-)	4	95.85	95.92	14.17	1.99	2.38	2.34	12.22	12.08	12.16	94
A 格	1,723	98.60	98.84	3.97	1.20	1.54	1.53	3.73	3.70	3.72	97
短期 (1-3)	922	99.46	99.69	2.22	1.10	1.32	1.32	2.19	2.18	2.19	90
中期 (3-7)	596	97.89	98.08	4.06	1.03	1.57	1.55	3.98	3.95	3.98	98
長期 (7-)	205	96.77	97.22	11.54	2.09	2.49	2.45	10.07	9.94	10.03	127
長期 (7-11)	84	95.49	95.78	8.49	1.47	2.13	2.08	7.95	7.87	7.94	116
超長期 (11-)	122	97.64	98.21	13.63	2.51	2.74	2.70	11.48	11.33	11.43	135
BBB 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
BB 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
B 格以下	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
格付なし	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

出所:NFRG

- 格付は、格付会社 4 社の最高格付をもとに分類

円建外債 最低格付別・ポートフォリオ指標 (2024年7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	276	99.02	99.17	3.14	0.76	1.07	1.06	3.08	3.06	3.08	58
短期(1-3)	158	99.49	99.61	1.95	0.73	0.99	0.99	1.94	1.93	1.94	60
中期(3-7)	104	98.55	98.70	4.26	0.78	1.15	1.14	4.19	4.17	4.19	55
長期(7-)	14	97.19	97.57	8.29	0.94	1.36	1.34	7.96	7.91	7.96	44
長期(7-11)	14	97.19	97.57	8.29	0.94	1.36	1.34	7.96	7.91	7.96	44
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AAA~A格	2,031	99.41	99.60	3.50	0.96	1.17	1.17	3.37	3.35	3.37	64
短期(1-3)	1,128	99.61	99.77	2.11	0.87	1.05	1.05	2.09	2.08	2.09	64
中期(3-7)	751	98.96	99.16	4.11	0.95	1.20	1.20	4.03	4.00	4.03	62
長期(7-)	152	100.08	100.44	10.72	1.76	1.85	1.86	9.61	9.52	9.58	74
長期(7-11)	91	96.96	97.18	8.46	1.09	1.54	1.52	8.07	8.01	8.07	60
超長期(11-)	62	104.65	105.22	14.04	2.73	2.27	2.32	11.70	11.56	11.63	94
AAA~BBB格	3,078	98.85	99.06	3.67	1.04	1.34	1.33	3.50	3.47	3.50	79
短期(1-3)	1,605	99.49	99.66	2.13	0.94	1.16	1.16	2.10	2.09	2.10	75
中期(3-7)	1,197	98.44	98.65	4.09	0.98	1.37	1.36	4.00	3.97	4.00	78
長期(7-)	276	96.92	97.32	10.82	1.86	2.26	2.22	9.60	9.49	9.57	111
長期(7-11)	150	96.37	96.64	8.46	1.34	1.86	1.83	7.98	7.91	7.97	91
超長期(11-)	126	97.58	98.14	13.65	2.49	2.73	2.68	11.51	11.36	11.45	133
AAA~BB格	3,078	98.85	99.06	3.67	1.04	1.34	1.33	3.50	3.47	3.50	79
短期(1-3)	1,605	99.49	99.66	2.13	0.94	1.16	1.16	2.10	2.09	2.10	75
中期(3-7)	1,197	98.44	98.65	4.09	0.98	1.37	1.36	4.00	3.97	4.00	78
長期(7-)	276	96.92	97.32	10.82	1.86	2.26	2.22	9.60	9.49	9.57	111
長期(7-11)	150	96.37	96.64	8.46	1.34	1.86	1.83	7.98	7.91	7.97	91
超長期(11-)	126	97.58	98.14	13.65	2.49	2.73	2.68	11.51	11.36	11.45	133
AAA格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA格	276	99.02	99.17	3.14	0.76	1.07	1.06	3.08	3.06	3.08	58
短期(1-3)	158	99.49	99.61	1.95	0.73	0.99	0.99	1.94	1.93	1.94	60
中期(3-7)	104	98.55	98.70	4.26	0.78	1.15	1.14	4.19	4.17	4.19	55
長期(7-)	14	97.19	97.57	8.29	0.94	1.36	1.34	7.96	7.91	7.96	44
長期(7-11)	14	97.19	97.57	8.29	0.94	1.36	1.34	7.96	7.91	7.96	44
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
A格	1,755	99.47	99.66	3.55	1.00	1.18	1.18	3.42	3.40	3.42	65
短期(1-3)	970	99.63	99.80	2.14	0.89	1.06	1.06	2.12	2.11	2.12	65
中期(3-7)	647	99.02	99.24	4.08	0.97	1.21	1.21	4.00	3.98	4.00	63
長期(7-)	139	100.36	100.72	10.97	1.84	1.90	1.91	9.77	9.67	9.74	77
長期(7-11)	77	96.92	97.11	8.49	1.12	1.57	1.55	8.10	8.03	8.09	63
超長期(11-)	62	104.65	105.22	14.04	2.73	2.27	2.32	11.70	11.56	11.63	94
BBB格	1,048	97.78	98.02	4.00	1.17	1.68	1.66	3.75	3.71	3.75	110
短期(1-3)	477	99.19	99.41	2.16	1.10	1.42	1.42	2.13	2.11	2.13	101
中期(3-7)	447	97.58	97.79	4.05	1.03	1.66	1.64	3.96	3.93	3.96	107
長期(7-)	124	93.06	93.50	10.95	1.99	2.80	2.70	9.59	9.45	9.56	158
長期(7-11)	60	95.49	95.82	8.45	1.70	2.35	2.30	7.83	7.74	7.83	139
超長期(11-)	64	90.79	91.34	13.27	2.26	3.24	3.09	11.30	11.13	11.25	177
BB格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
B格以下	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
格付なし	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

出所:NFRC

- 格付は、格付会社4社の最低格付をもとに分類

円建外債 最低格付別・ポートフォリオ指標 (2024年7月末、8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	336	99.11	99.25	3.09	0.77	1.05	1.05	3.04	3.02	3.04	56
短期 (1-3)	218	99.50	99.62	2.21	0.75	0.99	0.98	2.19	2.18	2.19	57
中期 (3-7)	104	98.55	98.70	4.26	0.78	1.15	1.14	4.19	4.17	4.19	55
長期 (7-)	14	97.19	97.57	8.29	0.94	1.36	1.34	7.96	7.91	7.96	44
長期 (7-11)	14	97.19	97.57	8.29	0.94	1.36	1.34	7.96	7.91	7.96	44
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AAA~A 格	2,132	99.42	99.60	3.48	0.96	1.16	1.16	3.36	3.34	3.36	63
短期 (1-3)	1,218	99.61	99.77	2.17	0.87	1.05	1.05	2.15	2.14	2.15	63
中期 (3-7)	762	98.97	99.18	4.12	0.95	1.20	1.20	4.04	4.01	4.04	61
長期 (7-)	152	100.08	100.44	10.72	1.76	1.85	1.86	9.61	9.52	9.58	74
長期 (7-11)	91	96.96	97.18	8.46	1.09	1.54	1.52	8.07	8.01	8.07	60
超長期 (11-)	62	104.65	105.22	14.04	2.73	2.27	2.32	11.70	11.56	11.63	94
AAA~BBB 格	3,180	98.88	99.08	3.65	1.03	1.33	1.32	3.49	3.46	3.49	78
短期 (1-3)	1,695	99.49	99.66	2.17	0.93	1.15	1.15	2.15	2.13	2.15	74
中期 (3-7)	1,209	98.46	98.66	4.09	0.98	1.37	1.36	4.01	3.98	4.01	78
長期 (7-)	276	96.92	97.32	10.82	1.86	2.26	2.22	9.60	9.49	9.57	111
長期 (7-11)	150	96.37	96.64	8.46	1.34	1.86	1.83	7.98	7.91	7.97	91
超長期 (11-)	126	97.58	98.14	13.65	2.49	2.73	2.68	11.51	11.36	11.45	133
AAA~BB 格	3,180	98.88	99.08	3.65	1.03	1.33	1.32	3.49	3.46	3.49	78
短期 (1-3)	1,695	99.49	99.66	2.17	0.93	1.15	1.15	2.15	2.13	2.15	74
中期 (3-7)	1,209	98.46	98.66	4.09	0.98	1.37	1.36	4.01	3.98	4.01	78
長期 (7-)	276	96.92	97.32	10.82	1.86	2.26	2.22	9.60	9.49	9.57	111
長期 (7-11)	150	96.37	96.64	8.46	1.34	1.86	1.83	7.98	7.91	7.97	91
超長期 (11-)	126	97.58	98.14	13.65	2.49	2.73	2.68	11.51	11.36	11.45	133
AAA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA 格	336	99.11	99.25	3.09	0.77	1.05	1.05	3.04	3.02	3.04	56
短期 (1-3)	218	99.50	99.62	2.21	0.75	0.99	0.98	2.19	2.18	2.19	57
中期 (3-7)	104	98.55	98.70	4.26	0.78	1.15	1.14	4.19	4.17	4.19	55
長期 (7-)	14	97.19	97.57	8.29	0.94	1.36	1.34	7.96	7.91	7.96	44
長期 (7-11)	14	97.19	97.57	8.29	0.94	1.36	1.34	7.96	7.91	7.96	44
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
A 格	1,796	99.47	99.67	3.55	0.99	1.18	1.18	3.42	3.40	3.42	65
短期 (1-3)	1,000	99.64	99.80	2.17	0.89	1.06	1.06	2.14	2.13	2.14	64
中期 (3-7)	658	99.04	99.25	4.10	0.97	1.21	1.20	4.01	3.99	4.01	62
長期 (7-)	139	100.36	100.72	10.97	1.84	1.90	1.91	9.77	9.67	9.74	77
長期 (7-11)	77	96.92	97.11	8.49	1.12	1.57	1.55	8.10	8.03	8.09	63
超長期 (11-)	62	104.65	105.22	14.04	2.73	2.27	2.32	11.70	11.56	11.63	94
BBB 格	1,048	97.78	98.02	4.00	1.17	1.68	1.66	3.75	3.71	3.75	110
短期 (1-3)	477	99.19	99.41	2.16	1.10	1.42	1.42	2.13	2.11	2.13	101
中期 (3-7)	447	97.58	97.79	4.05	1.03	1.66	1.64	3.96	3.93	3.96	107
長期 (7-)	124	93.06	93.50	10.95	1.99	2.80	2.70	9.59	9.45	9.56	158
長期 (7-11)	60	95.49	95.82	8.45	1.70	2.35	2.30	7.83	7.74	7.83	139
超長期 (11-)	64	90.79	91.34	13.27	2.26	3.24	3.09	11.30	11.13	11.25	177
BB 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
B 格以下	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
格付なし	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

出所:NFRC

- 格付は、格付会社 4 社の最低格付をもとに分類

円建外債 R&I 格付別・ポートフォリオ指標 (2024年7月末)

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
AAA~AA 格	30	100.14	100.22	1.93	1.37	1.31	1.31	1.91	1.89	1.91	92
短期 (1-3)	30	100.14	100.22	1.93	1.37	1.31	1.31	1.91	1.89	1.91	92
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AAA~A 格	754	98.76	98.87	3.22	0.98	1.34	1.33	3.15	3.12	3.15	83
短期 (1-3)	408	99.30	99.42	2.20	0.95	1.24	1.23	2.17	2.16	2.17	82
中期 (3-7)	317	98.41	98.52	4.07	1.02	1.44	1.43	3.99	3.96	3.99	85
長期 (7-)	29	95.04	95.12	8.26	0.96	1.66	1.62	7.94	7.88	7.94	73
長期 (7-11)	29	95.04	95.12	8.26	0.96	1.66	1.62	7.94	7.88	7.94	73
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AAA~BBB 格	754	98.76	98.87	3.22	0.98	1.34	1.33	3.15	3.12	3.15	83
短期 (1-3)	408	99.30	99.42	2.20	0.95	1.24	1.23	2.17	2.16	2.17	82
中期 (3-7)	317	98.41	98.52	4.07	1.02	1.44	1.43	3.99	3.96	3.99	85
長期 (7-)	29	95.04	95.12	8.26	0.96	1.66	1.62	7.94	7.88	7.94	73
長期 (7-11)	29	95.04	95.12	8.26	0.96	1.66	1.62	7.94	7.88	7.94	73
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AAA~BB 格	754	98.76	98.87	3.22	0.98	1.34	1.33	3.15	3.12	3.15	83
短期 (1-3)	408	99.30	99.42	2.20	0.95	1.24	1.23	2.17	2.16	2.17	82
中期 (3-7)	317	98.41	98.52	4.07	1.02	1.44	1.43	3.99	3.96	3.99	85
長期 (7-)	29	95.04	95.12	8.26	0.96	1.66	1.62	7.94	7.88	7.94	73
長期 (7-11)	29	95.04	95.12	8.26	0.96	1.66	1.62	7.94	7.88	7.94	73
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AAA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA 格	30	100.14	100.22	1.93	1.37	1.31	1.31	1.91	1.89	1.91	92
短期 (1-3)	30	100.14	100.22	1.93	1.37	1.31	1.31	1.91	1.89	1.91	92
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
A 格	724	98.71	98.82	3.27	0.97	1.34	1.33	3.20	3.18	3.20	82
短期 (1-3)	378	99.24	99.35	2.22	0.92	1.23	1.23	2.19	2.18	2.19	81
中期 (3-7)	317	98.41	98.52	4.07	1.02	1.44	1.43	3.99	3.96	3.99	85
長期 (7-)	29	95.04	95.12	8.26	0.96	1.66	1.62	7.94	7.88	7.94	73
長期 (7-11)	29	95.04	95.12	8.26	0.96	1.66	1.62	7.94	7.88	7.94	73
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
BBB 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
BB 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
B 格以下	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
格付なし	2,324	98.88	99.12	3.82	1.05	1.34	1.33	3.62	3.59	3.61	78
短期 (1-3)	1,196	99.55	99.75	2.10	0.93	1.14	1.13	2.08	2.07	2.08	73
中期 (3-7)	881	98.46	98.70	4.09	0.96	1.35	1.34	4.01	3.98	4.01	76
長期 (7-)	247	97.15	97.58	11.13	1.97	2.33	2.29	9.79	9.68	9.76	115
長期 (7-11)	121	96.70	97.00	8.50	1.43	1.91	1.87	7.99	7.91	7.98	96
超長期 (11-)	126	97.58	98.14	13.65	2.49	2.73	2.68	11.51	11.36	11.45	133

出所:NFRC

- 格付は、R&Iの格付をもとにNFRCで分類

円建外債 R&I 格付別・ポートフォリオ指標 (2024年7月末、8月ポートフォリオ)

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
AAA~AA 格	30	100.14	100.22	1.93	1.37	1.31	1.31	1.91	1.89	1.91	92
短期 (1-3)	30	100.14	100.22	1.93	1.37	1.31	1.31	1.91	1.89	1.91	92
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AAA~A 格	754	98.76	98.87	3.22	0.98	1.34	1.33	3.15	3.12	3.15	83
短期 (1-3)	408	99.30	99.42	2.20	0.95	1.24	1.23	2.17	2.16	2.17	82
中期 (3-7)	317	98.41	98.52	4.07	1.02	1.44	1.43	3.99	3.96	3.99	85
長期 (7-)	29	95.04	95.12	8.26	0.96	1.66	1.62	7.94	7.88	7.94	73
長期 (7-11)	29	95.04	95.12	8.26	0.96	1.66	1.62	7.94	7.88	7.94	73
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AAA~BBB 格	754	98.76	98.87	3.22	0.98	1.34	1.33	3.15	3.12	3.15	83
短期 (1-3)	408	99.30	99.42	2.20	0.95	1.24	1.23	2.17	2.16	2.17	82
中期 (3-7)	317	98.41	98.52	4.07	1.02	1.44	1.43	3.99	3.96	3.99	85
長期 (7-)	29	95.04	95.12	8.26	0.96	1.66	1.62	7.94	7.88	7.94	73
長期 (7-11)	29	95.04	95.12	8.26	0.96	1.66	1.62	7.94	7.88	7.94	73
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AAA~BB 格	754	98.76	98.87	3.22	0.98	1.34	1.33	3.15	3.12	3.15	83
短期 (1-3)	408	99.30	99.42	2.20	0.95	1.24	1.23	2.17	2.16	2.17	82
中期 (3-7)	317	98.41	98.52	4.07	1.02	1.44	1.43	3.99	3.96	3.99	85
長期 (7-)	29	95.04	95.12	8.26	0.96	1.66	1.62	7.94	7.88	7.94	73
長期 (7-11)	29	95.04	95.12	8.26	0.96	1.66	1.62	7.94	7.88	7.94	73
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AAA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA 格	30	100.14	100.22	1.93	1.37	1.31	1.31	1.91	1.89	1.91	92
短期 (1-3)	30	100.14	100.22	1.93	1.37	1.31	1.31	1.91	1.89	1.91	92
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
A 格	724	98.71	98.82	3.27	0.97	1.34	1.33	3.20	3.18	3.20	82
短期 (1-3)	378	99.24	99.35	2.22	0.92	1.23	1.23	2.19	2.18	2.19	81
中期 (3-7)	317	98.41	98.52	4.07	1.02	1.44	1.43	3.99	3.96	3.99	85
長期 (7-)	29	95.04	95.12	8.26	0.96	1.66	1.62	7.94	7.88	7.94	73
長期 (7-11)	29	95.04	95.12	8.26	0.96	1.66	1.62	7.94	7.88	7.94	73
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	2,426	98.91	99.14	3.79	1.04	1.33	1.32	3.59	3.57	3.59	77
短期 (1-3)	1,286	99.55	99.74	2.16	0.92	1.13	1.12	2.14	2.13	2.14	71
中期 (3-7)	892	98.47	98.71	4.10	0.96	1.35	1.34	4.02	3.99	4.02	76
長期 (7-)	247	97.15	97.58	11.13	1.97	2.33	2.29	9.79	9.68	9.76	115
長期 (7-11)	121	96.70	97.00	8.50	1.43	1.91	1.87	7.99	7.91	7.98	96
超長期 (11-)	126	97.58	98.14	13.65	2.49	2.73	2.68	11.51	11.36	11.45	133

出所:NFRC

- 格付は、R&Iの格付をもとに NFRC で分類

円建外債 JCR 格付別・ポートフォリオ指標 (2024年7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	255	99.10	99.18	3.39	1.04	1.29	1.28	3.28	3.26	3.28	76
短期 (1-3)	160	99.61	99.67	2.26	0.96	1.16	1.15	2.23	2.22	2.23	73
中期 (3-7)	73	98.90	99.01	4.17	1.12	1.40	1.39	4.08	4.05	4.08	81
長期 (7-)	22	96.10	96.24	9.05	1.36	1.89	1.86	8.38	8.30	8.36	90
長期 (7-11)	18	96.15	96.31	7.85	1.21	1.78	1.75	7.49	7.42	7.48	89
超長期 (11-)	4	95.85	95.92	14.17	1.99	2.38	2.34	12.22	12.08	12.16	94
AAA~A 格	994	98.53	98.80	4.53	1.33	1.66	1.64	4.16	4.12	4.15	104
短期 (1-3)	521	99.65	99.87	2.18	1.16	1.34	1.34	2.16	2.14	2.16	92
中期 (3-7)	288	97.68	97.95	4.09	1.10	1.69	1.67	3.99	3.96	3.99	109
長期 (7-)	186	96.69	97.13	11.78	2.14	2.55	2.50	10.22	10.09	10.18	131
長期 (7-11)	73	95.84	96.17	8.42	1.62	2.22	2.18	7.83	7.75	7.83	127
超長期 (11-)	113	97.23	97.75	13.94	2.48	2.76	2.70	11.73	11.57	11.66	133
AAA~BBB 格	994	98.53	98.80	4.53	1.33	1.66	1.64	4.16	4.12	4.15	104
短期 (1-3)	521	99.65	99.87	2.18	1.16	1.34	1.34	2.16	2.14	2.16	92
中期 (3-7)	288	97.68	97.95	4.09	1.10	1.69	1.67	3.99	3.96	3.99	109
長期 (7-)	186	96.69	97.13	11.78	2.14	2.55	2.50	10.22	10.09	10.18	131
長期 (7-11)	73	95.84	96.17	8.42	1.62	2.22	2.18	7.83	7.75	7.83	127
超長期 (11-)	113	97.23	97.75	13.94	2.48	2.76	2.70	11.73	11.57	11.66	133
AAA~BB 格	994	98.53	98.80	4.53	1.33	1.66	1.64	4.16	4.12	4.15	104
短期 (1-3)	521	99.65	99.87	2.18	1.16	1.34	1.34	2.16	2.14	2.16	92
中期 (3-7)	288	97.68	97.95	4.09	1.10	1.69	1.67	3.99	3.96	3.99	109
長期 (7-)	186	96.69	97.13	11.78	2.14	2.55	2.50	10.22	10.09	10.18	131
長期 (7-11)	73	95.84	96.17	8.42	1.62	2.22	2.18	7.83	7.75	7.83	127
超長期 (11-)	113	97.23	97.75	13.94	2.48	2.76	2.70	11.73	11.57	11.66	133
AAA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA 格	255	99.10	99.18	3.39	1.04	1.29	1.28	3.28	3.26	3.28	76
短期 (1-3)	160	99.61	99.67	2.26	0.96	1.16	1.15	2.23	2.22	2.23	73
中期 (3-7)	73	98.90	99.01	4.17	1.12	1.40	1.39	4.08	4.05	4.08	81
長期 (7-)	22	96.10	96.24	9.05	1.36	1.89	1.86	8.38	8.30	8.36	90
長期 (7-11)	18	96.15	96.31	7.85	1.21	1.78	1.75	7.49	7.42	7.48	89
超長期 (11-)	4	95.85	95.92	14.17	1.99	2.38	2.34	12.22	12.08	12.16	94
A 格	739	98.33	98.67	4.92	1.43	1.79	1.77	4.47	4.42	4.46	114
短期 (1-3)	361	99.67	99.96	2.15	1.25	1.42	1.42	2.12	2.11	2.12	101
中期 (3-7)	215	97.27	97.59	4.07	1.10	1.79	1.76	3.96	3.93	3.96	119
長期 (7-)	163	96.77	97.25	12.15	2.25	2.64	2.59	10.47	10.33	10.42	136
長期 (7-11)	55	95.73	96.13	8.61	1.75	2.37	2.32	7.95	7.86	7.94	140
超長期 (11-)	109	97.28	97.82	13.93	2.50	2.77	2.72	11.71	11.55	11.65	134
BBB 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
BB 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
B 格以下	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
格付なし	2,084	99.00	99.18	3.26	0.89	1.19	1.18	3.19	3.17	3.19	68
短期 (1-3)	1,084	99.41	99.56	2.10	0.83	1.08	1.08	2.08	2.07	2.08	67
中期 (3-7)	910	98.68	98.87	4.08	0.94	1.27	1.27	4.01	3.98	4.00	69
長期 (7-)	91	97.41	97.71	8.87	1.29	1.67	1.65	8.34	8.27	8.34	70
長期 (7-11)	78	96.88	97.07	8.49	1.07	1.52	1.50	8.11	8.05	8.11	58
超長期 (11-)	13	100.62	101.53	11.15	2.60	2.52	2.53	9.68	9.56	9.65	138

出所:NFRC

- 格付は、JCR の格付をもとに NFRC で分類

円建外債 JCR 格付別・ポートフォリオ指標 (2024年7月末、8月ポートフォリオ)

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
AAA~AA 格	255	99.10	99.18	3.39	1.04	1.29	1.28	3.28	3.26	3.28	76
短期 (1-3)	160	99.61	99.67	2.26	0.96	1.16	1.15	2.23	2.22	2.23	73
中期 (3-7)	73	98.90	99.01	4.17	1.12	1.40	1.39	4.08	4.05	4.08	81
長期 (7-)	22	96.10	96.24	9.05	1.36	1.89	1.86	8.38	8.30	8.36	90
長期 (7-11)	18	96.15	96.31	7.85	1.21	1.78	1.75	7.49	7.42	7.48	89
超長期 (11-)	4	95.85	95.92	14.17	1.99	2.38	2.34	12.22	12.08	12.16	94
AAA~A 格	994	98.53	98.80	4.53	1.33	1.66	1.64	4.16	4.12	4.15	104
短期 (1-3)	521	99.65	99.87	2.18	1.16	1.34	1.34	2.16	2.14	2.16	92
中期 (3-7)	288	97.68	97.95	4.09	1.10	1.69	1.67	3.99	3.96	3.99	109
長期 (7-)	186	96.69	97.13	11.78	2.14	2.55	2.50	10.22	10.09	10.18	131
長期 (7-11)	73	95.84	96.17	8.42	1.62	2.22	2.18	7.83	7.75	7.83	127
超長期 (11-)	113	97.23	97.75	13.94	2.48	2.76	2.70	11.73	11.57	11.66	133
AAA~BBB 格	994	98.53	98.80	4.53	1.33	1.66	1.64	4.16	4.12	4.15	104
短期 (1-3)	521	99.65	99.87	2.18	1.16	1.34	1.34	2.16	2.14	2.16	92
中期 (3-7)	288	97.68	97.95	4.09	1.10	1.69	1.67	3.99	3.96	3.99	109
長期 (7-)	186	96.69	97.13	11.78	2.14	2.55	2.50	10.22	10.09	10.18	131
長期 (7-11)	73	95.84	96.17	8.42	1.62	2.22	2.18	7.83	7.75	7.83	127
超長期 (11-)	113	97.23	97.75	13.94	2.48	2.76	2.70	11.73	11.57	11.66	133
AAA~BB 格	994	98.53	98.80	4.53	1.33	1.66	1.64	4.16	4.12	4.15	104
短期 (1-3)	521	99.65	99.87	2.18	1.16	1.34	1.34	2.16	2.14	2.16	92
中期 (3-7)	288	97.68	97.95	4.09	1.10	1.69	1.67	3.99	3.96	3.99	109
長期 (7-)	186	96.69	97.13	11.78	2.14	2.55	2.50	10.22	10.09	10.18	131
長期 (7-11)	73	95.84	96.17	8.42	1.62	2.22	2.18	7.83	7.75	7.83	127
超長期 (11-)	113	97.23	97.75	13.94	2.48	2.76	2.70	11.73	11.57	11.66	133
AAA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA 格	255	99.10	99.18	3.39	1.04	1.29	1.28	3.28	3.26	3.28	76
短期 (1-3)	160	99.61	99.67	2.26	0.96	1.16	1.15	2.23	2.22	2.23	73
中期 (3-7)	73	98.90	99.01	4.17	1.12	1.40	1.39	4.08	4.05	4.08	81
長期 (7-)	22	96.10	96.24	9.05	1.36	1.89	1.86	8.38	8.30	8.36	90
長期 (7-11)	18	96.15	96.31	7.85	1.21	1.78	1.75	7.49	7.42	7.48	89
超長期 (11-)	4	95.85	95.92	14.17	1.99	2.38	2.34	12.22	12.08	12.16	94
A 格	739	98.33	98.67	4.92	1.43	1.79	1.77	4.47	4.42	4.46	114
短期 (1-3)	361	99.67	99.96	2.15	1.25	1.42	1.42	2.12	2.11	2.12	101
中期 (3-7)	215	97.27	97.59	4.07	1.10	1.79	1.76	3.96	3.93	3.96	119
長期 (7-)	163	96.77	97.25	12.15	2.25	2.64	2.59	10.47	10.33	10.42	136
長期 (7-11)	55	95.73	96.13	8.61	1.75	2.37	2.32	7.95	7.86	7.94	140
超長期 (11-)	109	97.28	97.82	13.93	2.50	2.77	2.72	11.71	11.55	11.65	134
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	2,186	99.03	99.21	3.26	0.89	1.18	1.17	3.18	3.16	3.18	67
短期 (1-3)	1,174	99.42	99.57	2.16	0.83	1.07	1.07	2.14	2.13	2.14	65
中期 (3-7)	921	98.70	98.89	4.09	0.94	1.27	1.26	4.01	3.99	4.01	68
長期 (7-)	91	97.41	97.71	8.87	1.29	1.67	1.65	8.34	8.27	8.34	70
長期 (7-11)	78	96.88	97.07	8.49	1.07	1.52	1.50	8.11	8.05	8.11	58
超長期 (11-)	13	100.62	101.53	11.15	2.60	2.52	2.53	9.68	9.56	9.65	138

出所:NFRC

- 格付は、JCR の格付をもとに NFRC で分類

円建外債 Moody's 格付別・ポートフォリオ指標 (2024年7月末)

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
AAA~AA 格	1,185	99.16	99.34	3.24	0.78	1.05	1.05	3.17	3.16	3.17	55
短期 (1-3)	575	99.48	99.60	1.91	0.64	0.91	0.90	1.90	1.89	1.90	52
中期 (3-7)	554	99.00	99.23	4.10	0.90	1.16	1.15	4.02	3.99	4.02	57
長期 (7-)	56	97.40	97.66	8.49	1.07	1.46	1.44	8.10	8.05	8.10	52
長期 (7-11)	56	97.40	97.66	8.49	1.07	1.46	1.44	8.10	8.05	8.10	52
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AAA~A 格	2,106	99.39	99.59	3.53	0.97	1.17	1.17	3.41	3.38	3.40	64
短期 (1-3)	1,148	99.65	99.82	2.10	0.87	1.03	1.03	2.08	2.07	2.08	62
中期 (3-7)	790	98.89	99.10	4.09	0.94	1.22	1.22	4.01	3.99	4.01	64
長期 (7-)	168	99.95	100.35	10.68	1.79	1.89	1.90	9.57	9.48	9.54	79
長期 (7-11)	96	96.90	97.12	8.49	1.10	1.55	1.53	8.09	8.03	8.09	61
超長期 (11-)	72	104.06	104.69	13.64	2.72	2.32	2.36	11.42	11.28	11.36	101
AAA~BBB 格	2,833	98.92	99.12	3.75	1.02	1.30	1.29	3.58	3.55	3.57	75
短期 (1-3)	1,422	99.58	99.74	2.13	0.89	1.09	1.08	2.11	2.10	2.11	67
中期 (3-7)	1,142	98.53	98.73	4.09	0.97	1.34	1.33	4.00	3.98	4.00	76
長期 (7-)	269	97.05	97.44	10.92	1.88	2.26	2.22	9.67	9.56	9.64	110
長期 (7-11)	143	96.58	96.83	8.51	1.35	1.84	1.81	8.02	7.95	8.01	89
超長期 (11-)	126	97.58	98.14	13.65	2.49	2.73	2.68	11.51	11.36	11.45	133
AAA~BB 格	2,833	98.92	99.12	3.75	1.02	1.30	1.29	3.58	3.55	3.57	75
短期 (1-3)	1,422	99.58	99.74	2.13	0.89	1.09	1.08	2.11	2.10	2.11	67
中期 (3-7)	1,142	98.53	98.73	4.09	0.97	1.34	1.33	4.00	3.98	4.00	76
長期 (7-)	269	97.05	97.44	10.92	1.88	2.26	2.22	9.67	9.56	9.64	110
長期 (7-11)	143	96.58	96.83	8.51	1.35	1.84	1.81	8.02	7.95	8.01	89
超長期 (11-)	126	97.58	98.14	13.65	2.49	2.73	2.68	11.51	11.36	11.45	133
AAA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA 格	1,185	99.16	99.34	3.24	0.78	1.05	1.05	3.17	3.16	3.17	55
短期 (1-3)	575	99.48	99.60	1.91	0.64	0.91	0.90	1.90	1.89	1.90	52
中期 (3-7)	554	99.00	99.23	4.10	0.90	1.16	1.15	4.02	3.99	4.02	57
長期 (7-)	56	97.40	97.66	8.49	1.07	1.46	1.44	8.10	8.05	8.10	52
長期 (7-11)	56	97.40	97.66	8.49	1.07	1.46	1.44	8.10	8.05	8.10	52
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
A 格	921	99.69	99.91	3.91	1.21	1.32	1.32	3.70	3.67	3.69	76
短期 (1-3)	573	99.82	100.03	2.30	1.10	1.15	1.15	2.27	2.26	2.27	71
中期 (3-7)	236	98.65	98.78	4.08	1.04	1.37	1.36	4.00	3.97	4.00	78
長期 (7-)	112	101.23	101.69	11.78	2.15	2.10	2.11	10.28	10.17	10.24	92
長期 (7-11)	40	96.20	96.36	8.48	1.13	1.68	1.65	8.08	8.01	8.07	73
超長期 (11-)	72	104.06	104.69	13.64	2.72	2.32	2.36	11.42	11.28	11.36	101
BBB 格	727	97.55	97.75	4.39	1.16	1.68	1.65	4.08	4.04	4.08	106
短期 (1-3)	274	99.29	99.43	2.26	0.99	1.33	1.33	2.23	2.22	2.23	90
中期 (3-7)	353	97.72	97.91	4.07	1.03	1.62	1.60	3.99	3.95	3.99	103
長期 (7-)	101	92.19	92.58	11.31	2.04	2.93	2.81	9.84	9.70	9.81	166
長期 (7-11)	46	95.90	96.22	8.55	1.86	2.44	2.39	7.86	7.77	7.86	148
超長期 (11-)	54	89.03	89.49	13.67	2.19	3.37	3.19	11.65	11.47	11.59	183
BB 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
B 格以下	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
格付なし	245	98.10	98.39	2.70	1.22	1.83	1.82	2.63	2.60	2.63	137
短期 (1-3)	182	98.78	99.04	2.08	1.27	1.77	1.76	2.04	2.03	2.04	137
中期 (3-7)	55	96.61	96.97	4.09	1.09	1.98	1.95	3.98	3.94	3.98	137
長期 (7-)	8	92.70	93.20	7.57	1.15	2.28	2.20	7.22	7.14	7.22	137
長期 (7-11)	8	92.70	93.20	7.57	1.15	2.28	2.20	7.22	7.14	7.22	137
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

出所:NFRC

- 格付は、Moody's の格付をもとに NFRC で分類

円建外債 Moody's 格付別・ポートフォリオ指標 (2024年7月末、8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	1,287	99.20	99.37	3.23	0.79	1.04	1.04	3.17	3.15	3.17	54
短期 (1-3)	665	99.50	99.61	2.04	0.66	0.91	0.91	2.03	2.02	2.03	51
中期 (3-7)	566	99.02	99.24	4.11	0.91	1.16	1.15	4.03	4.01	4.03	57
長期 (7-)	56	97.40	97.66	8.49	1.07	1.46	1.44	8.10	8.05	8.10	52
長期 (7-11)	56	97.40	97.66	8.49	1.07	1.46	1.44	8.10	8.05	8.10	52
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AAA~A 格	2,208	99.40	99.60	3.52	0.97	1.16	1.16	3.39	3.37	3.39	63
短期 (1-3)	1,238	99.65	99.81	2.16	0.87	1.02	1.02	2.14	2.13	2.14	61
中期 (3-7)	801	98.91	99.11	4.10	0.95	1.22	1.21	4.02	4.00	4.02	63
長期 (7-)	168	99.95	100.35	10.68	1.79	1.89	1.90	9.57	9.48	9.54	79
長期 (7-11)	96	96.90	97.12	8.49	1.10	1.55	1.53	8.09	8.03	8.09	61
超長期 (11-)	72	104.06	104.69	13.64	2.72	2.32	2.36	11.42	11.28	11.36	101
AAA~BBB 格	2,935	98.94	99.14	3.73	1.01	1.29	1.28	3.56	3.53	3.56	74
短期 (1-3)	1,512	99.58	99.74	2.18	0.89	1.08	1.08	2.16	2.15	2.16	66
中期 (3-7)	1,154	98.54	98.74	4.09	0.97	1.34	1.33	4.01	3.98	4.01	75
長期 (7-)	269	97.05	97.44	10.92	1.88	2.26	2.22	9.67	9.56	9.64	110
長期 (7-11)	143	96.58	96.83	8.51	1.35	1.84	1.81	8.02	7.95	8.01	89
超長期 (11-)	126	97.58	98.14	13.65	2.49	2.73	2.68	11.51	11.36	11.45	133
AAA~BB 格	2,935	98.94	99.14	3.73	1.01	1.29	1.28	3.56	3.53	3.56	74
短期 (1-3)	1,512	99.58	99.74	2.18	0.89	1.08	1.08	2.16	2.15	2.16	66
中期 (3-7)	1,154	98.54	98.74	4.09	0.97	1.34	1.33	4.01	3.98	4.01	75
長期 (7-)	269	97.05	97.44	10.92	1.88	2.26	2.22	9.67	9.56	9.64	110
長期 (7-11)	143	96.58	96.83	8.51	1.35	1.84	1.81	8.02	7.95	8.01	89
超長期 (11-)	126	97.58	98.14	13.65	2.49	2.73	2.68	11.51	11.36	11.45	133
AAA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA 格	1,287	99.20	99.37	3.23	0.79	1.04	1.04	3.17	3.15	3.17	54
短期 (1-3)	665	99.50	99.61	2.04	0.66	0.91	0.91	2.03	2.02	2.03	51
中期 (3-7)	566	99.02	99.24	4.11	0.91	1.16	1.15	4.03	4.01	4.03	57
長期 (7-)	56	97.40	97.66	8.49	1.07	1.46	1.44	8.10	8.05	8.10	52
長期 (7-11)	56	97.40	97.66	8.49	1.07	1.46	1.44	8.10	8.05	8.10	52
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
A 格	921	99.69	99.91	3.91	1.21	1.32	1.32	3.70	3.67	3.69	76
短期 (1-3)	573	99.82	100.03	2.30	1.10	1.15	1.15	2.27	2.26	2.27	71
中期 (3-7)	236	98.65	98.78	4.08	1.04	1.37	1.36	4.00	3.97	4.00	78
長期 (7-)	112	101.23	101.69	11.78	2.15	2.10	2.11	10.28	10.17	10.24	92
長期 (7-11)	40	96.20	96.36	8.48	1.13	1.68	1.65	8.08	8.01	8.07	73
超長期 (11-)	72	104.06	104.69	13.64	2.72	2.32	2.36	11.42	11.28	11.36	101
BBB 格	727	97.55	97.75	4.39	1.16	1.68	1.65	4.08	4.04	4.08	106
短期 (1-3)	274	99.29	99.43	2.26	0.99	1.33	1.33	2.23	2.22	2.23	90
中期 (3-7)	353	97.72	97.91	4.07	1.03	1.62	1.60	3.99	3.95	3.99	103
長期 (7-)	101	92.19	92.58	11.31	2.04	2.93	2.81	9.84	9.70	9.81	166
長期 (7-11)	46	95.90	96.22	8.55	1.86	2.44	2.39	7.86	7.77	7.86	148
超長期 (11-)	54	89.03	89.49	13.67	2.19	3.37	3.19	11.65	11.47	11.59	183
BB 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
B 格以下	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
格付なし	245	98.10	98.39	2.70	1.22	1.83	1.82	2.63	2.60	2.63	137
短期 (1-3)	182	98.78	99.04	2.08	1.27	1.77	1.76	2.04	2.03	2.04	137
中期 (3-7)	55	96.61	96.97	4.09	1.09	1.98	1.95	3.98	3.94	3.98	137
長期 (7-)	8	92.70	93.20	7.57	1.15	2.28	2.20	7.22	7.14	7.22	137
長期 (7-11)	8	92.70	93.20	7.57	1.15	2.28	2.20	7.22	7.14	7.22	137
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

出所:NFRC

- 格付は、Moody's の格付をもとに NFRC で分類

円建外債 S&P 格付別・ポートフォリオ指標 (2024年7月末)

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
AAA~AA 格	233	98.96	99.11	3.37	0.73	1.03	1.02	3.30	3.29	3.30	51
短期 (1-3)	122	99.51	99.63	2.05	0.69	0.93	0.93	2.03	2.02	2.03	52
中期 (3-7)	98	98.54	98.67	4.33	0.74	1.11	1.10	4.26	4.24	4.26	51
長期 (7-)	14	97.19	97.57	8.29	0.94	1.36	1.34	7.96	7.91	7.96	44
長期 (7-11)	14	97.19	97.57	8.29	0.94	1.36	1.34	7.96	7.91	7.96	44
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AAA~A 格	2,015	99.39	99.58	3.53	0.95	1.16	1.16	3.41	3.38	3.40	63
短期 (1-3)	1,090	99.62	99.78	2.14	0.84	1.02	1.02	2.12	2.11	2.12	61
中期 (3-7)	775	98.91	99.12	4.08	0.94	1.21	1.21	4.00	3.98	4.00	63
長期 (7-)	150	100.19	100.55	10.77	1.78	1.85	1.86	9.64	9.55	9.61	74
長期 (7-11)	88	97.07	97.29	8.49	1.11	1.54	1.52	8.09	8.03	8.09	60
超長期 (11-)	62	104.65	105.22	14.04	2.73	2.27	2.32	11.70	11.56	11.63	94
AAA~BBB 格	3,003	98.85	99.06	3.70	1.03	1.33	1.32	3.53	3.51	3.53	78
短期 (1-3)	1,544	99.49	99.66	2.14	0.91	1.14	1.13	2.12	2.11	2.12	72
中期 (3-7)	1,185	98.45	98.66	4.09	0.98	1.37	1.36	4.00	3.98	4.00	78
長期 (7-)	274	96.96	97.36	10.85	1.88	2.26	2.23	9.62	9.51	9.59	111
長期 (7-11)	148	96.43	96.69	8.47	1.35	1.86	1.83	7.99	7.92	7.98	91
超長期 (11-)	126	97.58	98.14	13.65	2.49	2.73	2.68	11.51	11.36	11.45	133
AAA~BB 格	3,003	98.85	99.06	3.70	1.03	1.33	1.32	3.53	3.51	3.53	78
短期 (1-3)	1,544	99.49	99.66	2.14	0.91	1.14	1.13	2.12	2.11	2.12	72
中期 (3-7)	1,185	98.45	98.66	4.09	0.98	1.37	1.36	4.00	3.98	4.00	78
長期 (7-)	274	96.96	97.36	10.85	1.88	2.26	2.23	9.62	9.51	9.59	111
長期 (7-11)	148	96.43	96.69	8.47	1.35	1.86	1.83	7.99	7.92	7.98	91
超長期 (11-)	126	97.58	98.14	13.65	2.49	2.73	2.68	11.51	11.36	11.45	133
AAA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA 格	233	98.96	99.11	3.37	0.73	1.03	1.02	3.30	3.29	3.30	51
短期 (1-3)	122	99.51	99.63	2.05	0.69	0.93	0.93	2.03	2.02	2.03	52
中期 (3-7)	98	98.54	98.67	4.33	0.74	1.11	1.10	4.26	4.24	4.26	51
長期 (7-)	14	97.19	97.57	8.29	0.94	1.36	1.34	7.96	7.91	7.96	44
長期 (7-11)	14	97.19	97.57	8.29	0.94	1.36	1.34	7.96	7.91	7.96	44
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
A 格	1,782	99.44	99.64	3.55	0.98	1.17	1.17	3.42	3.40	3.42	64
短期 (1-3)	968	99.63	99.80	2.15	0.86	1.03	1.03	2.13	2.12	2.13	62
中期 (3-7)	678	98.96	99.18	4.05	0.97	1.23	1.22	3.97	3.94	3.97	65
長期 (7-)	136	100.49	100.85	11.02	1.86	1.90	1.91	9.81	9.71	9.77	77
長期 (7-11)	75	97.05	97.24	8.52	1.14	1.57	1.55	8.12	8.05	8.11	62
超長期 (11-)	62	104.65	105.22	14.04	2.73	2.27	2.32	11.70	11.56	11.63	94
BBB 格	988	97.75	97.98	4.06	1.18	1.69	1.66	3.79	3.76	3.79	110
短期 (1-3)	454	99.17	99.38	2.14	1.08	1.41	1.41	2.12	2.10	2.12	100
中期 (3-7)	410	97.59	97.79	4.10	1.05	1.67	1.65	4.00	3.97	4.00	107
長期 (7-)	124	93.06	93.50	10.95	1.99	2.80	2.70	9.59	9.45	9.56	158
長期 (7-11)	60	95.49	95.82	8.45	1.70	2.35	2.30	7.83	7.74	7.83	139
超長期 (11-)	64	90.79	91.34	13.27	2.26	3.24	3.09	11.30	11.13	11.25	177
BB 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
B 格以下	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
格付なし	75	98.95	99.15	2.30	1.41	1.79	1.78	2.25	2.23	2.25	137
短期 (1-3)	61	99.47	99.67	1.77	1.53	1.84	1.83	1.74	1.73	1.74	147
中期 (3-7)	13	97.55	97.80	3.98	0.97	1.58	1.57	3.90	3.87	3.90	100
長期 (7-)	2	92.55	92.80	7.52	0.51	1.62	1.57	7.36	7.30	7.35	74
長期 (7-11)	2	92.55	92.80	7.52	0.51	1.62	1.57	7.36	7.30	7.35	74
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

出所:NFRC

- 格付は、S&P の格付をもとに NFRC で分類

円建外債 S&P 格付別・ポートフォリオ指標 (2024年7月末、8月ポートフォリオ)

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
AAA~AA 格	293	99.08	99.21	3.27	0.74	1.02	1.01	3.21	3.20	3.21	50
短期 (1-3)	182	99.52	99.62	2.33	0.73	0.94	0.94	2.31	2.30	2.31	51
中期 (3-7)	98	98.54	98.67	4.33	0.74	1.11	1.10	4.26	4.24	4.26	51
長期 (7-)	14	97.19	97.57	8.29	0.94	1.36	1.34	7.96	7.91	7.96	44
長期 (7-11)	14	97.19	97.57	8.29	0.94	1.36	1.34	7.96	7.91	7.96	44
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AAA~A 格	2,117	99.40	99.59	3.51	0.94	1.15	1.15	3.39	3.37	3.39	62
短期 (1-3)	1,180	99.62	99.77	2.20	0.84	1.02	1.02	2.18	2.17	2.18	60
中期 (3-7)	787	98.92	99.13	4.09	0.94	1.21	1.21	4.01	3.99	4.01	63
長期 (7-)	150	100.19	100.55	10.77	1.78	1.85	1.86	9.64	9.55	9.61	74
長期 (7-11)	88	97.07	97.29	8.49	1.11	1.54	1.52	8.09	8.03	8.09	60
超長期 (11-)	62	104.65	105.22	14.04	2.73	2.27	2.32	11.70	11.56	11.63	94
AAA~BBB 格	3,105	98.87	99.08	3.69	1.02	1.32	1.31	3.52	3.49	3.52	77
短期 (1-3)	1,634	99.49	99.66	2.18	0.91	1.13	1.12	2.16	2.15	2.16	71
中期 (3-7)	1,196	98.47	98.67	4.09	0.98	1.37	1.36	4.01	3.98	4.01	78
長期 (7-)	274	96.96	97.36	10.85	1.88	2.26	2.23	9.62	9.51	9.59	111
長期 (7-11)	148	96.43	96.69	8.47	1.35	1.86	1.83	7.99	7.92	7.98	91
超長期 (11-)	126	97.58	98.14	13.65	2.49	2.73	2.68	11.51	11.36	11.45	133
AAA~BB 格	3,105	98.87	99.08	3.69	1.02	1.32	1.31	3.52	3.49	3.52	77
短期 (1-3)	1,634	99.49	99.66	2.18	0.91	1.13	1.12	2.16	2.15	2.16	71
中期 (3-7)	1,196	98.47	98.67	4.09	0.98	1.37	1.36	4.01	3.98	4.01	78
長期 (7-)	274	96.96	97.36	10.85	1.88	2.26	2.23	9.62	9.51	9.59	111
長期 (7-11)	148	96.43	96.69	8.47	1.35	1.86	1.83	7.99	7.92	7.98	91
超長期 (11-)	126	97.58	98.14	13.65	2.49	2.73	2.68	11.51	11.36	11.45	133
AAA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA 格	293	99.08	99.21	3.27	0.74	1.02	1.01	3.21	3.20	3.21	50
短期 (1-3)	182	99.52	99.62	2.33	0.73	0.94	0.94	2.31	2.30	2.31	51
中期 (3-7)	98	98.54	98.67	4.33	0.74	1.11	1.10	4.26	4.24	4.26	51
長期 (7-)	14	97.19	97.57	8.29	0.94	1.36	1.34	7.96	7.91	7.96	44
長期 (7-11)	14	97.19	97.57	8.29	0.94	1.36	1.34	7.96	7.91	7.96	44
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
A 格	1,824	99.45	99.65	3.55	0.98	1.17	1.17	3.42	3.40	3.42	64
短期 (1-3)	998	99.64	99.80	2.18	0.86	1.03	1.03	2.15	2.14	2.15	61
中期 (3-7)	689	98.98	99.19	4.06	0.97	1.23	1.22	3.98	3.95	3.98	64
長期 (7-)	136	100.49	100.85	11.02	1.86	1.90	1.91	9.81	9.71	9.77	77
長期 (7-11)	75	97.05	97.24	8.52	1.14	1.57	1.55	8.12	8.05	8.11	62
超長期 (11-)	62	104.65	105.22	14.04	2.73	2.27	2.32	11.70	11.56	11.63	94
BBB 格	988	97.75	97.98	4.06	1.18	1.69	1.66	3.79	3.76	3.79	110
短期 (1-3)	454	99.17	99.38	2.14	1.08	1.41	1.41	2.12	2.10	2.12	100
中期 (3-7)	410	97.59	97.79	4.10	1.05	1.67	1.65	4.00	3.97	4.00	107
長期 (7-)	124	93.06	93.50	10.95	1.99	2.80	2.70	9.59	9.45	9.56	158
長期 (7-11)	60	95.49	95.82	8.45	1.70	2.35	2.30	7.83	7.74	7.83	139
超長期 (11-)	64	90.79	91.34	13.27	2.26	3.24	3.09	11.30	11.13	11.25	177
BB 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
B 格以下	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
格付なし	75	98.95	99.15	2.30	1.41	1.79	1.78	2.25	2.23	2.25	137
短期 (1-3)	61	99.47	99.67	1.77	1.53	1.84	1.83	1.74	1.73	1.74	147
中期 (3-7)	13	97.55	97.80	3.98	0.97	1.58	1.57	3.90	3.87	3.90	100
長期 (7-)	2	92.55	92.80	7.52	0.51	1.62	1.57	7.36	7.30	7.35	74
長期 (7-11)	2	92.55	92.80	7.52	0.51	1.62	1.57	7.36	7.30	7.35	74
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

出所:NFRC

- 格付は、S&P の格付をもとに NFRC で分類

NOMURA-BPI 総合・ポートフォリオ指標の推移

	2020年3月末	2021年3月末	2022年3月末	2023年3月末	2024年3月末	2024年7月末
銘柄数	13,875	14,702	15,303	15,524	16,009	16,095
額面(10億円)	970,751	1,016,799	1,055,162	1,084,026	1,123,852	1,137,092
時価単価(円)	108.41	106.49	104.20	101.51	98.40	95.54
利含単価(円)	108.53	106.60	104.31	101.62	98.50	95.74
残存年数(年)	9.85	9.89	10.02	10.17	10.21	10.19
利率(%)	0.89	0.83	0.79	0.77	0.78	0.79
単利(%)	0.08	0.14	0.27	0.43	0.73	1.05
複利(%)	0.08	0.14	0.27	0.43	0.72	1.02
Dur(年)	9.47	9.36	9.32	9.19	8.93	8.67
M-Dur	9.46	9.35	9.30	9.16	8.88	8.60
E-Dur	9.46	9.34	9.29	9.16	8.90	8.62
Tspd(bp)	5	4	3	5	4	4

出所:NFRG

NOMURA-BPI の定義

NOMURA-BPI の銘柄組入基準

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

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

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

累積投資収益指数の計算方法

ある時点における投資収益指数は以下の計算式から算出される。

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

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

各ポートフォリオの累積投資収益指数は以下の基準日を 100 としている。

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

ただし、

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

投資収益率の計算方法

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

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

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

レポートの表記等について

投資収益率 投資収益指数

- 「前月末からの投資収益率」は、「2024年6月の月末営業日から2024年7月の月末営業日までの投資収益率(年率換算,%)」を指す。
- 「前年度末からの投資収益率」は、「2024年3月の月末営業日から2024年7月の月末営業日までの投資収益率(年率換算,%)」を指す。
- 「前年末からの投資収益率」は、「2023年12月の月末営業日から2024年7月の月末営業日までの投資収益率(年率換算,%)」を指す。

月間投資収益率

- 2024年6月の月末営業日から2024年7月の月末営業日までの投資収益率(年率換算,%)
- 2024年6月の月末営業日において、7月ポートフォリオに組み入れられるべき銘柄がない場合には「-」と表記。

ポートフォリオ指標

- 時価単価・利含単価・残存年数・利率は額面加重平均。単利・複利・Tspdは時価総額加重平均。Dur・M-Dur・E-Durは経過利子込時価総額加重平均。
- 「残存年数」は、「途中償還を考慮した平均残存年数」を指す。
- 「Dur」は、「デュレーション」を指す。
- 「M-Dur」は、「修正デュレーション」を指す。
- 「E-Dur」は、「実効デュレーション」を指す。
- 「Tspd」は、「Tスプレッド」を指す。
- 左ページには7月ポートフォリオの、右ページには8月ポートフォリオの、2024年7月の月末営業日における指標を掲載。

現存額

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

格付会社別ポートフォリオ指標

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

その他

- 短期・中期・長期などの残存別ポートフォリオは、2024年7月末(暦上)における残存年数(至最終償還日)で区分。ただし8月ポートフォリオでは、2024年8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