

月間投資収益率（2024年9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 362.344 | 3.32 | 2.50 | 0.81 | -2.24 | -2.17 |

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(%)

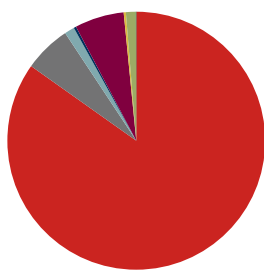
ポートフォリオ指標（2024年9月末）

| | 翌月ポート (2024年10月) | 当月ポート (2024年9月) | 差 |
|------------|---------------------|--------------------|------|
| 額面[兆円] | 1145.50 | 1137.19 | 8.31 |
| デュレーション[年] | 8.81 | 8.79 | 0.02 |
| 修正デュレーション | 8.75 | 8.73 | 0.02 |
| 時価単価[円] | 96.83 | 96.80 | 0.03 |
| 利含単価[円] | 96.94 | 96.91 | 0.03 |
| 残存年数[年] | 10.27 | 10.25 | 0.03 |
| 利率[%] | 0.81 | 0.81 | 0.00 |
| 単利[%] | 0.92 | 0.92 | 0.00 |
| 複利[%] | 0.90 | 0.89 | 0.00 |
| Tスプレッド[bp] | 4 | 4 | 0 |

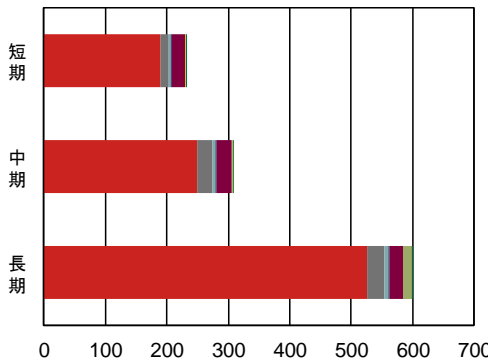
出所: NFRC

(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9月末）



残存別額面構成（2024年9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 | 84.8% | 5.9% | 1.3% | 0.3% | 6.2% | 0.3% | 1.2% | 0.1% |
| 全体 | 964.49 | 66.95 | 14.22 | 3.44 | 70.30 | 3.11 | 14.02 | 0.66 |
| 短期 | 189.67 | 12.79 | 3.31 | 2.00 | 20.90 | 1.66 | - | 0.19 |
| 中期 | 249.79 | 24.57 | 4.31 | 1.27 | 25.82 | 1.17 | - | 0.29 |
| 長期 | 525.03 | 29.59 | 6.61 | 0.17 | 23.58 | 0.28 | 14.02 | 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 |
| ディスクレーマー | 59 |

銘柄別・投資収益率(2024年9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 | 362.344 | 3.32 | 2.50 | 0.81 | -2.24 | -2.17 |
| 国債 | 372.840 | 3.50 | 2.66 | 0.84 | -2.44 | -2.38 |
| 地方債 | 389.729 | 2.35 | 1.74 | 0.61 | -0.94 | -1.00 |
| 政保債 | 364.301 | 2.84 | 2.09 | 0.75 | -1.86 | -1.62 |
| 金融債 | 273.331 | 0.80 | 0.50 | 0.30 | -0.07 | -0.37 |
| 事業債 | 387.914 | 2.21 | 1.44 | 0.76 | -1.13 | -0.82 |
| 円建外債 | 357.782 | 1.32 | 0.30 | 1.02 | 1.39 | 1.39 |
| MBS | 124.344 | 2.80 | 2.15 | 0.65 | -1.56 | -1.58 |
| ABS | 113.809 | 2.60 | 1.86 | 0.74 | -0.01 | -0.36 |

出所:NFRC

投資収益率は年率換算(%)

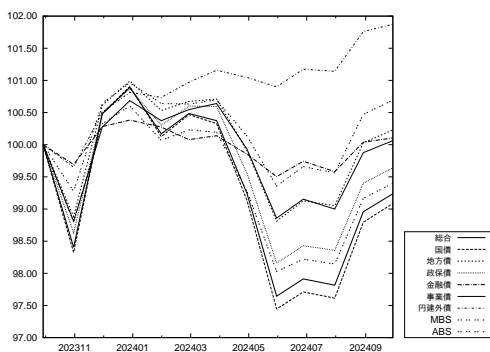
銘柄別・累積投資収益指数の推移

| 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 |
|------------|---------|---------|---------|---------|---------|---------|---------|---------|---------|
| 2023/09/29 | 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 |
| 2024/07/31 | 357.155 | 367.297 | 385.149 | 359.607 | 271.899 | 383.791 | 355.212 | 122.774 | 112.532 |
| 2024/08/30 | 361.325 | 371.736 | 388.953 | 363.424 | 273.145 | 387.188 | 357.382 | 124.049 | 113.559 |
| 2024/09/02 | 360.894 | 371.269 | 388.609 | 363.034 | 273.090 | 386.881 | 357.309 | 123.924 | 113.490 |
| 2024/09/03 | 360.670 | 371.050 | 388.255 | 362.733 | 272.934 | 386.622 | 357.170 | 123.791 | 113.400 |
| 2024/09/04 | 361.575 | 372.021 | 389.065 | 363.542 | 273.112 | 387.298 | 357.538 | 124.067 | 113.585 |
| 2024/09/05 | 361.957 | 372.440 | 389.344 | 363.881 | 273.142 | 387.513 | 357.582 | 124.170 | 113.642 |
| 2024/09/06 | 362.609 | 373.150 | 389.830 | 364.458 | 273.187 | 387.961 | 357.745 | 124.339 | 113.742 |
| 2024/09/09 | 361.677 | 372.152 | 388.994 | 363.616 | 273.000 | 387.263 | 357.375 | 124.056 | 113.558 |
| 2024/09/10 | 361.474 | 371.923 | 388.927 | 363.438 | 273.008 | 387.147 | 357.349 | 124.029 | 113.552 |
| 2024/09/11 | 362.385 | 372.892 | 389.796 | 364.285 | 273.222 | 387.855 | 357.594 | 124.328 | 113.758 |
| 2024/09/12 | 362.157 | 372.658 | 389.513 | 364.061 | 273.137 | 387.639 | 357.455 | 124.234 | 113.686 |
| 2024/09/13 | 362.861 | 373.429 | 390.003 | 364.693 | 273.209 | 388.104 | 357.490 | 124.406 | 113.783 |
| 2024/09/17 | 363.401 | 374.018 | 390.375 | 365.134 | 273.312 | 388.497 | 357.731 | 124.531 | 113.875 |
| 2024/09/18 | 363.355 | 373.963 | 390.377 | 365.085 | 273.378 | 388.492 | 357.765 | 124.527 | 113.893 |
| 2024/09/19 | 362.229 | 372.719 | 389.676 | 364.130 | 273.271 | 387.774 | 357.665 | 124.302 | 113.764 |
| 2024/09/20 | 361.850 | 372.305 | 389.396 | 363.849 | 273.200 | 387.510 | 357.637 | 124.221 | 113.702 |
| 2024/09/24 | 363.161 | 373.690 | 390.697 | 365.091 | 273.632 | 388.624 | 358.167 | 124.624 | 114.022 |
| 2024/09/25 | 363.358 | 373.929 | 390.616 | 365.242 | 273.586 | 388.684 | 358.121 | 124.626 | 114.005 |
| 2024/09/26 | 362.673 | 373.165 | 390.227 | 364.645 | 273.594 | 388.288 | 358.170 | 124.486 | 113.944 |
| 2024/09/27 | 363.007 | 373.496 | 390.753 | 365.003 | 273.805 | 388.679 | 357.839 | 124.652 | 114.086 |
| 2024/09/30 | 362.344 | 372.840 | 389.729 | 364.301 | 273.331 | 387.914 | 357.782 | 124.344 | 113.809 |

出所:NFRC

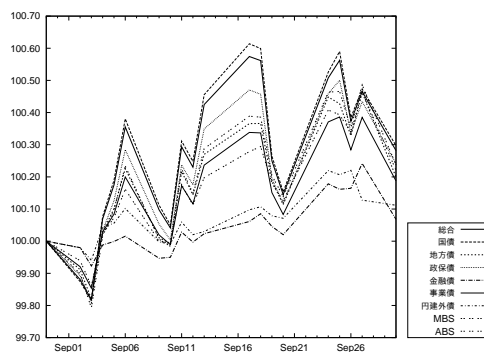
1983年12月末=100。MBSセクターは2003年3月末=100。ABSセクターは2008年3月末=100。

指数の推移(月次) 2023年9月末=100に補正。



出所:NFRC

指数の推移(日次) 2024年8月末=100に補正。



出所:NFRC

総合 残存別・投資収益率 (2024年9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 | 362.344 | 3.32 | 2.50 | 0.81 | -2.24 | -2.17 |
| 短期 (1-3) | 233.664 | 0.24 | -0.15 | 0.39 | -0.23 | -0.40 |
| 中期 (3-7) | 336.709 | 0.90 | 0.26 | 0.64 | -0.40 | -0.83 |
| 長期 (7-) | 531.914 | 5.92 | 4.84 | 1.09 | -4.05 | -3.61 |
| 長期 (7-11) | 194.109 | 4.54 | 3.56 | 0.98 | -0.36 | -0.71 |
| 超長期 (11-) | 234.596 | 6.76 | 5.61 | 1.16 | -6.22 | -5.30 |
| (11-15) | 224.573 | 6.70 | 5.73 | 0.97 | -2.40 | -2.01 |
| (15-) | 240.212 | 6.79 | 5.57 | 1.22 | -7.59 | -6.47 |

出所:NFRC

投資収益率は年率換算 (%)

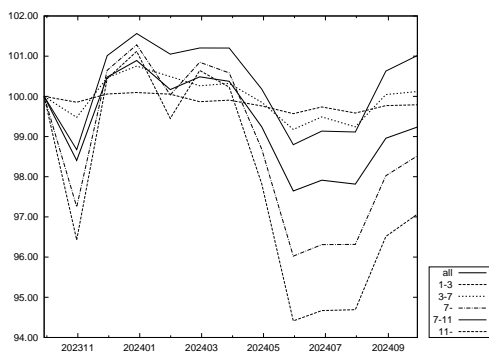
総合 残存別・投資収益指数の推移

| 総合 年/月/日 | 全体 | 短期 (1-3) | 中期 (3-7) | 長期 (7-) | 長期* | | | |
|-------------|---------|-------------|-------------|------------|---------|---------|----------|---------|
| | | | | | (7-11) | 超長期* | (11-15)* | (15-)* |
| 2023/09/29 | 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 |
| 2024/07/31 | 357.155 | 233.183 | 333.757 | 520.024 | 190.452 | 228.852 | 219.331 | 234.235 |
| 2024/08/30 | 361.325 | 233.616 | 336.453 | 529.251 | 193.364 | 233.256 | 223.302 | 238.836 |
| 2024/09/02 | 360.894 | 233.600 | 336.280 | 528.175 | 193.137 | 232.661 | 222.833 | 238.188 |
| 2024/09/03 | 360.670 | 233.515 | 335.971 | 527.878 | 192.866 | 232.648 | 222.584 | 238.266 |
| 2024/09/04 | 361.575 | 233.563 | 336.425 | 530.043 | 193.482 | 233.729 | 223.554 | 239.399 |
| 2024/09/05 | 361.957 | 233.561 | 336.528 | 531.053 | 193.705 | 234.282 | 223.914 | 240.029 |
| 2024/09/06 | 362.609 | 233.541 | 336.708 | 532.791 | 194.060 | 235.252 | 224.549 | 241.136 |
| 2024/09/09 | 361.677 | 233.477 | 336.248 | 530.569 | 193.458 | 234.120 | 223.580 | 239.932 |
| 2024/09/10 | 361.474 | 233.485 | 336.253 | 529.976 | 193.453 | 233.704 | 223.474 | 239.394 |
| 2024/09/11 | 362.385 | 233.552 | 336.779 | 532.077 | 194.108 | 234.712 | 224.438 | 240.426 |
| 2024/09/12 | 362.157 | 233.532 | 336.539 | 531.648 | 193.909 | 234.554 | 224.131 | 240.324 |
| 2024/09/13 | 362.861 | 233.555 | 336.695 | 533.515 | 194.220 | 235.647 | 224.734 | 241.615 |
| 2024/09/17 | 363.401 | 233.589 | 336.913 | 534.847 | 194.472 | 236.405 | 225.120 | 242.522 |
| 2024/09/18 | 363.355 | 233.637 | 337.004 | 534.591 | 194.496 | 236.207 | 225.048 | 242.273 |
| 2024/09/19 | 362.229 | 233.599 | 336.734 | 531.623 | 194.114 | 234.386 | 224.247 | 240.046 |
| 2024/09/20 | 361.850 | 233.582 | 336.524 | 530.729 | 193.886 | 233.921 | 224.138 | 239.441 |
| 2024/09/24 | 363.161 | 233.801 | 337.366 | 533.566 | 194.784 | 235.272 | 225.383 | 240.842 |
| 2024/09/25 | 363.358 | 233.788 | 337.238 | 534.257 | 194.709 | 235.815 | 225.599 | 241.516 |
| 2024/09/26 | 362.673 | 233.832 | 337.179 | 532.294 | 194.451 | 234.615 | 224.960 | 240.090 |
| 2024/09/27 | 363.007 | 233.933 | 337.608 | 532.790 | 194.876 | 234.656 | 225.381 | 239.985 |
| 2024/09/30 | 362.344 | 233.664 | 336.709 | 531.914 | 194.109 | 234.596 | 224.573 | 240.212 |

出所:NFRC

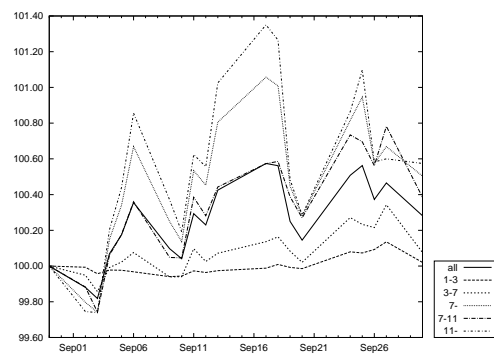
* は 1995年12月末=100。それ以外は、1983年12月末=100。

指数の推移 (月次) 2023年9月末=100に補正。



出所:NFRC

指数の推移 (日次) 2024年8月末=100に補正。



出所:NFRC

国債 残存別・投資収益率 (2024年9月末)

| | 累積投資 収益指数 | 前月末からの投資収益率 | | | 過去からの投資収益率 | |
|-----------|--------------|-------------|-------|------|------------|-------|
| | | トータル | キャピタル | インカム | 前年度末 | 前年末 |
| 国債 | 372.840 | 3.50 | 2.66 | 0.84 | -2.44 | -2.38 |
| 短期 (1-3) | 220.946 | 0.20 | -0.18 | 0.38 | -0.28 | -0.46 |
| 中期 (3-7) | 335.557 | 0.92 | 0.27 | 0.64 | -0.45 | -0.92 |
| 長期 (7-) | 542.274 | 6.10 | 4.99 | 1.11 | -4.28 | -3.86 |
| 長期 (7-11) | 192.631 | 4.61 | 3.62 | 0.99 | -0.41 | -0.81 |
| 超長期 (11-) | 233.479 | 7.00 | 5.81 | 1.19 | -6.54 | -5.62 |
| (11-15) | 223.103 | 6.73 | 5.75 | 0.98 | -2.47 | -2.13 |
| (15-) | 239.305 | 7.09 | 5.83 | 1.26 | -8.01 | -6.87 |

出所:NFRC

投資収益率は年率換算 (%)

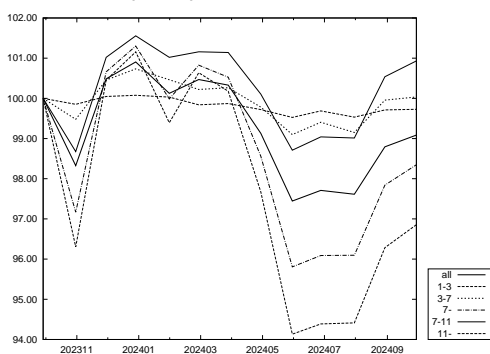
国債 残存別・投資収益指数の推移

| 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-)* |
| 2023/09/29 | 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 |
| 2024/07/31 | 367.297 | 220.511 | 332.596 | 529.860 | 188.969 | 227.590 | 217.871 | 233.119 |
| 2024/08/30 | 371.736 | 220.909 | 335.296 | 539.477 | 191.879 | 232.100 | 221.835 | 237.873 |
| 2024/09/02 | 371.269 | 220.892 | 335.120 | 538.350 | 191.654 | 231.488 | 221.365 | 237.200 |
| 2024/09/03 | 371.050 | 220.812 | 334.813 | 538.076 | 191.388 | 231.493 | 221.117 | 237.303 |
| 2024/09/04 | 372.021 | 220.858 | 335.271 | 540.332 | 192.002 | 232.599 | 222.086 | 238.471 |
| 2024/09/05 | 372.440 | 220.856 | 335.375 | 541.405 | 192.225 | 233.176 | 222.445 | 239.137 |
| 2024/09/06 | 373.150 | 220.835 | 335.556 | 543.235 | 192.576 | 234.179 | 223.079 | 240.291 |
| 2024/09/09 | 372.152 | 220.775 | 335.093 | 540.919 | 191.976 | 233.021 | 222.110 | 239.051 |
| 2024/09/10 | 371.923 | 220.782 | 335.098 | 540.277 | 191.972 | 232.583 | 222.004 | 238.480 |
| 2024/09/11 | 372.892 | 220.846 | 335.627 | 542.454 | 192.625 | 233.608 | 222.974 | 239.535 |
| 2024/09/12 | 372.658 | 220.826 | 335.385 | 542.027 | 192.427 | 233.457 | 222.667 | 239.442 |
| 2024/09/13 | 373.429 | 220.848 | 335.542 | 544.004 | 192.736 | 234.593 | 223.270 | 240.794 |
| 2024/09/17 | 374.018 | 220.879 | 335.760 | 545.420 | 192.986 | 235.384 | 223.653 | 241.750 |
| 2024/09/18 | 373.963 | 220.925 | 335.852 | 545.149 | 193.013 | 235.180 | 223.584 | 241.491 |
| 2024/09/19 | 372.719 | 220.888 | 335.580 | 541.976 | 192.632 | 233.274 | 222.780 | 239.144 |
| 2024/09/20 | 372.305 | 220.872 | 335.367 | 541.023 | 192.402 | 232.785 | 222.672 | 238.504 |
| 2024/09/24 | 373.690 | 221.077 | 336.211 | 543.954 | 193.295 | 234.154 | 223.912 | 239.934 |
| 2024/09/25 | 373.929 | 221.065 | 336.087 | 544.727 | 193.230 | 234.732 | 224.133 | 240.655 |
| 2024/09/26 | 373.165 | 221.106 | 336.027 | 542.631 | 192.972 | 233.478 | 223.490 | 239.154 |
| 2024/09/27 | 373.496 | 221.202 | 336.460 | 543.094 | 193.394 | 233.491 | 223.908 | 239.010 |
| 2024/09/30 | 372.840 | 220.946 | 335.557 | 542.274 | 192.631 | 233.479 | 223.103 | 239.305 |

出所:NFRC

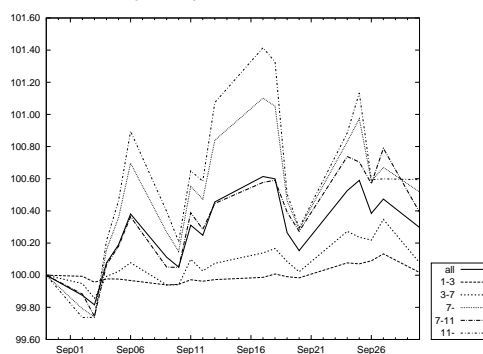
* は1995年12月末=100。それ以外は、1983年12月末=100。

指数の推移 (月次) 2023年9月末=100に補正。



出所:NFRC

指数の推移 (日次) 2024年8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9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 | 362.228 | 3.32 | 2.51 | 0.82 | -2.24 | -2.18 |
| 短期(1-3) | 233.664 | 0.24 | -0.15 | 0.39 | -0.23 | -0.40 |
| 中期(3-7) | 336.709 | 0.90 | 0.26 | 0.64 | -0.40 | -0.83 |
| 長期(7-) | 533.823 | 6.00 | 4.90 | 1.10 | -4.11 | -3.66 |
| 長期(7-11) | 194.105 | 4.54 | 3.56 | 0.98 | -0.36 | -0.71 |
| 超長期(11-) | 236.343 | 6.92 | 5.74 | 1.17 | -6.41 | -5.44 |
| (11-15) | 224.562 | 6.70 | 5.73 | 0.97 | -2.40 | -2.01 |
| (15-) | 242.227 | 7.00 | 5.75 | 1.25 | -7.92 | -6.73 |

出所:NFRC

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

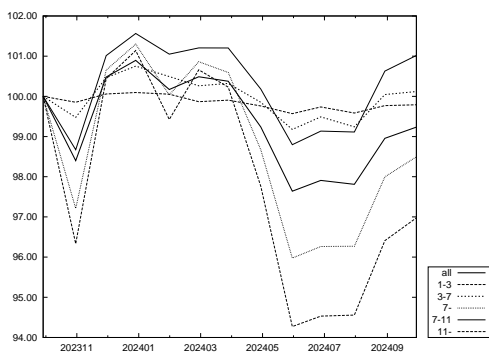
「除くMBS」残存別・投資収益指数の推移

| 除くMBS 年/月/日 | 全体 | 短期 (1-3) | 中期 (3-7) | 長期 (7-) | 長期* | | | |
|----------------|---------|-------------|-------------|------------|---------|---------------|----------|---------|
| | | | | | (7-11) | 超長期* (11-) | (11-15)* | (15-)* |
| 2023/09/29 | 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 |
| 2024/07/31 | 357.033 | 233.183 | 333.757 | 521.764 | 190.445 | 230.448 | 219.320 | 236.041 |
| 2024/08/30 | 361.208 | 233.616 | 336.453 | 531.116 | 193.359 | 234.962 | 223.291 | 240.795 |
| 2024/09/02 | 360.776 | 233.600 | 336.280 | 530.023 | 193.132 | 234.349 | 222.822 | 240.119 |
| 2024/09/03 | 360.553 | 233.515 | 335.971 | 529.732 | 192.861 | 234.346 | 222.573 | 240.217 |
| 2024/09/04 | 361.460 | 233.563 | 336.425 | 531.928 | 193.478 | 235.457 | 223.543 | 241.391 |
| 2024/09/05 | 361.842 | 233.561 | 336.528 | 532.957 | 193.701 | 236.027 | 223.903 | 242.050 |
| 2024/09/06 | 362.496 | 233.541 | 336.708 | 534.726 | 194.056 | 237.031 | 224.538 | 243.209 |
| 2024/09/09 | 361.563 | 233.477 | 336.248 | 532.470 | 193.453 | 235.866 | 223.569 | 241.959 |
| 2024/09/10 | 361.359 | 233.485 | 336.253 | 531.863 | 193.448 | 235.433 | 223.463 | 241.390 |
| 2024/09/11 | 362.270 | 233.552 | 336.779 | 533.992 | 194.103 | 236.466 | 224.427 | 242.455 |
| 2024/09/12 | 362.043 | 233.532 | 336.539 | 533.561 | 193.905 | 236.307 | 224.120 | 242.357 |
| 2024/09/13 | 362.749 | 233.555 | 336.695 | 535.463 | 194.216 | 237.439 | 224.723 | 243.711 |
| 2024/09/17 | 363.290 | 233.589 | 336.913 | 536.819 | 194.468 | 238.223 | 225.108 | 244.662 |
| 2024/09/18 | 363.244 | 233.637 | 337.004 | 536.557 | 194.492 | 238.016 | 225.037 | 244.398 |
| 2024/09/19 | 362.113 | 233.599 | 336.734 | 533.528 | 194.110 | 236.127 | 224.236 | 242.054 |
| 2024/09/20 | 361.732 | 233.582 | 336.524 | 532.618 | 193.881 | 235.646 | 224.127 | 241.419 |
| 2024/09/24 | 363.044 | 233.801 | 337.366 | 535.492 | 194.780 | 237.030 | 225.372 | 242.866 |
| 2024/09/25 | 363.244 | 233.788 | 337.238 | 536.203 | 194.705 | 237.599 | 225.587 | 243.582 |
| 2024/09/26 | 362.555 | 233.832 | 337.179 | 534.199 | 194.447 | 236.353 | 224.949 | 242.082 |
| 2024/09/27 | 362.888 | 233.933 | 337.608 | 534.692 | 194.872 | 236.383 | 225.370 | 241.952 |
| 2024/09/30 | 362.228 | 233.664 | 336.709 | 533.823 | 194.105 | 236.343 | 224.562 | 242.227 |

出所:NFRC

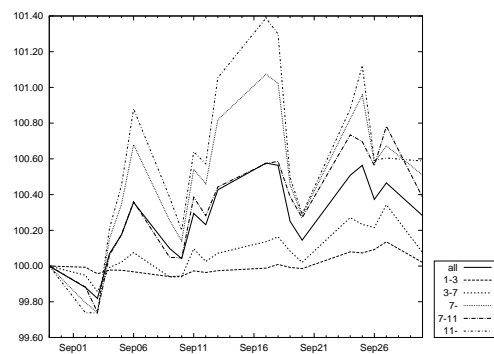
* は1995年12月末=100。それ以外は、1983年12月末=100。

指数の推移(月次) 2023年9月末=100に補正。



出所:NFRC

指数の推移(日次) 2024年8月末=100に補正。



出所:NFRC

「除くABS」「SDGs」残存別・投資収益率(2024年9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 | 362.369 | 3.32 | 2.50 | 0.81 | -2.24 | -2.17 |
| 短期(1-3) | 233.628 | 0.24 | -0.15 | 0.39 | -0.23 | -0.40 |
| 中期(3-7) | 336.701 | 0.90 | 0.26 | 0.64 | -0.40 | -0.83 |
| 長期(7-) | 531.912 | 5.92 | 4.84 | 1.09 | -4.05 | -3.61 |
| 長期(7-11) | 194.103 | 4.54 | 3.56 | 0.98 | -0.36 | -0.71 |
| 超長期(11-) | 234.593 | 6.76 | 5.61 | 1.16 | -6.22 | -5.30 |
| (11-15) | 224.564 | 6.70 | 5.73 | 0.97 | -2.41 | -2.01 |
| (15-) | 240.214 | 6.79 | 5.57 | 1.22 | -7.59 | -6.47 |
| SDGs | 99.099 | 2.27 | 1.69 | 0.58 | -1.09 | -1.00 |

出所:NFRC

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

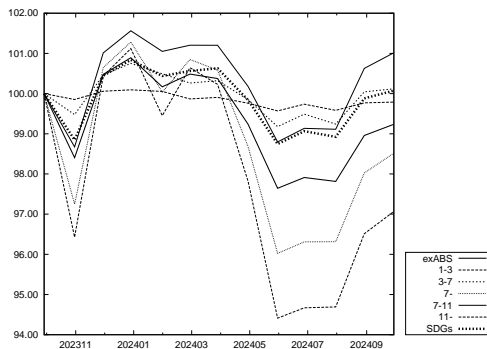
「除くABS」「SDGs」残存別投資収益指数の推移

| 除くABS 年/月/日 | 除くABS | 短期 (1-3) | 中期 (3-7) | 長期 (7-) | 長期* | | | | SDGs** |
|----------------|---------|-------------|-------------|------------|---------------|---------------|----------|---------|--------|
| | | | | | 長期* (7-11) | 超長期* (11-) | (11-15)* | (15-)* | |
| 2023/09/29 | 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 |
| 2024/07/31 | 357.179 | 233.148 | 333.748 | 520.022 | 190.445 | 228.850 | 219.323 | 234.237 | 97.961 |
| 2024/08/30 | 361.350 | 233.581 | 336.445 | 529.249 | 193.358 | 233.253 | 223.294 | 238.838 | 98.908 |
| 2024/09/02 | 360.919 | 233.565 | 336.272 | 528.173 | 193.131 | 232.658 | 222.824 | 238.190 | 98.828 |
| 2024/09/03 | 360.695 | 233.480 | 335.963 | 527.876 | 192.860 | 232.646 | 222.576 | 238.268 | 98.743 |
| 2024/09/04 | 361.600 | 233.528 | 336.417 | 530.041 | 193.476 | 233.727 | 223.545 | 239.400 | 98.931 |
| 2024/09/05 | 361.982 | 233.526 | 336.519 | 531.052 | 193.699 | 234.279 | 223.906 | 240.031 | 98.997 |
| 2024/09/06 | 362.634 | 233.506 | 336.699 | 532.790 | 194.054 | 235.250 | 224.540 | 241.138 | 99.111 |
| 2024/09/09 | 361.702 | 233.442 | 336.240 | 530.567 | 193.451 | 234.117 | 223.571 | 239.934 | 98.909 |
| 2024/09/10 | 361.499 | 233.450 | 336.244 | 529.974 | 193.446 | 233.701 | 223.466 | 239.395 | 98.890 |
| 2024/09/11 | 362.411 | 233.517 | 336.770 | 532.075 | 194.101 | 234.709 | 224.430 | 240.428 | 99.093 |
| 2024/09/12 | 362.182 | 233.496 | 336.530 | 531.646 | 193.903 | 234.551 | 224.122 | 240.326 | 99.028 |
| 2024/09/13 | 362.886 | 233.520 | 336.686 | 533.513 | 194.213 | 235.645 | 224.725 | 241.617 | 99.143 |
| 2024/09/17 | 363.426 | 233.553 | 336.904 | 534.846 | 194.466 | 236.403 | 225.111 | 242.524 | 99.241 |
| 2024/09/18 | 363.380 | 233.602 | 336.995 | 534.590 | 194.490 | 236.204 | 225.040 | 242.275 | 99.238 |
| 2024/09/19 | 362.254 | 233.563 | 336.725 | 531.621 | 194.108 | 234.383 | 224.238 | 240.048 | 99.065 |
| 2024/09/20 | 361.875 | 233.547 | 336.515 | 530.727 | 193.879 | 233.919 | 224.130 | 239.442 | 98.993 |
| 2024/09/24 | 363.186 | 233.766 | 337.357 | 533.564 | 194.777 | 235.269 | 225.374 | 240.844 | 99.307 |
| 2024/09/25 | 363.384 | 233.752 | 337.230 | 534.255 | 194.703 | 235.813 | 225.590 | 241.518 | 99.311 |
| 2024/09/26 | 362.698 | 233.797 | 337.170 | 532.292 | 194.445 | 234.613 | 224.951 | 240.092 | 99.214 |
| 2024/09/27 | 363.032 | 233.897 | 337.599 | 532.788 | 194.870 | 234.653 | 225.372 | 239.987 | 99.335 |
| 2024/09/30 | 362.369 | 233.628 | 336.701 | 531.912 | 194.103 | 234.593 | 224.564 | 240.214 | 99.099 |

出所:NFRC

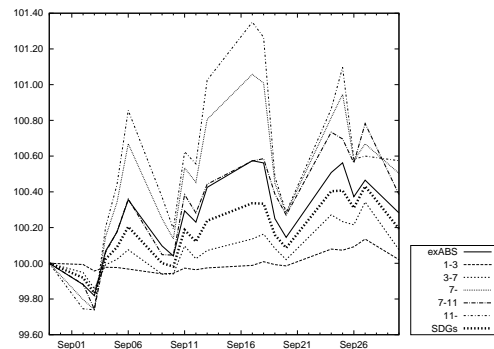
*は1995年12月末=100。**は2017年12月末=100。それ以外は、1983年12月末=100。

指数の推移(月次) 2023年9月末=100に補正。



出所:NFRC

指数の推移(日次) 2024年8月末=100に補正。



出所:NFRC

「除く国債」残存別・投資収益率(2024年9月末)

| | 累積投資 収益指数 | 前月末からの投資収益率 | | | 過去からの投資収益率 | |
|----------|--------------|-------------|-------|------|------------|-------|
| | | トータル | キャピタル | インカム | 前年度末 | 前年末 |
| 除く国債 | 170.378 | 2.32 | 1.63 | 0.69 | -1.08 | -0.97 |
| 短期(1-3) | 133.374 | 0.43 | 0.02 | 0.41 | 0.02 | -0.13 |
| 中期(3-7) | 166.796 | 0.80 | 0.20 | 0.60 | -0.15 | -0.43 |
| 長期(7-) | 232.197 | 4.67 | 3.74 | 0.93 | -2.46 | -1.87 |
| 長期(7-11) | 199.705 | 4.04 | 3.12 | 0.93 | -0.05 | -0.05 |
| 超長期(11-) | 234.967 | 5.07 | 4.15 | 0.93 | -3.94 | -2.99 |

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(%)

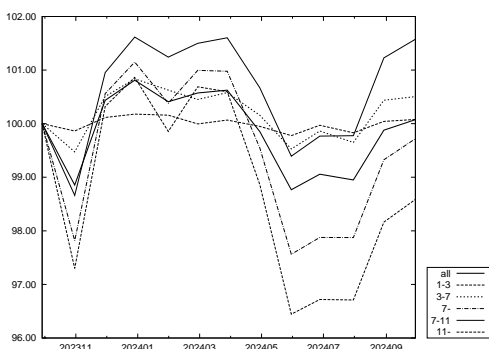
「除く国債」残存別・投資収益指数の推移

| 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-) |
| 2023/09/29 | 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 |
| 2024/07/31 | 168.463 | 133.042 | 165.375 | 227.898 | 196.168 | 230.494 |
| 2024/08/30 | 170.044 | 133.325 | 166.683 | 231.281 | 199.021 | 233.959 |
| 2024/09/02 | 169.900 | 133.318 | 166.605 | 230.906 | 198.788 | 233.511 |
| 2024/09/03 | 169.763 | 133.269 | 166.449 | 230.687 | 198.493 | 233.371 |
| 2024/09/04 | 170.090 | 133.298 | 166.662 | 231.484 | 199.104 | 234.235 |
| 2024/09/05 | 170.201 | 133.297 | 166.708 | 231.795 | 199.327 | 234.585 |
| 2024/09/06 | 170.407 | 133.288 | 166.795 | 232.379 | 199.693 | 235.280 |
| 2024/09/09 | 170.070 | 133.253 | 166.578 | 231.560 | 199.089 | 234.374 |
| 2024/09/10 | 170.028 | 133.257 | 166.580 | 231.416 | 199.083 | 234.138 |
| 2024/09/11 | 170.374 | 133.295 | 166.829 | 232.224 | 199.736 | 234.988 |
| 2024/09/12 | 170.265 | 133.284 | 166.716 | 232.010 | 199.534 | 234.784 |
| 2024/09/13 | 170.476 | 133.300 | 166.790 | 232.600 | 199.853 | 235.527 |
| 2024/09/17 | 170.645 | 133.321 | 166.896 | 233.008 | 200.111 | 236.011 |
| 2024/09/18 | 170.643 | 133.348 | 166.938 | 232.926 | 200.119 | 235.868 |
| 2024/09/19 | 170.331 | 133.327 | 166.811 | 232.073 | 199.737 | 234.733 |
| 2024/09/20 | 170.215 | 133.320 | 166.715 | 231.811 | 199.521 | 234.462 |
| 2024/09/24 | 170.739 | 133.449 | 167.123 | 232.929 | 200.437 | 235.629 |
| 2024/09/25 | 170.741 | 133.441 | 167.051 | 233.026 | 200.295 | 235.899 |
| 2024/09/26 | 170.566 | 133.468 | 167.024 | 232.457 | 200.047 | 235.137 |
| 2024/09/27 | 170.758 | 133.522 | 167.224 | 232.802 | 200.479 | 235.384 |
| 2024/09/30 | 170.378 | 133.374 | 166.796 | 232.197 | 199.705 | 234.967 |

出所:NFRC

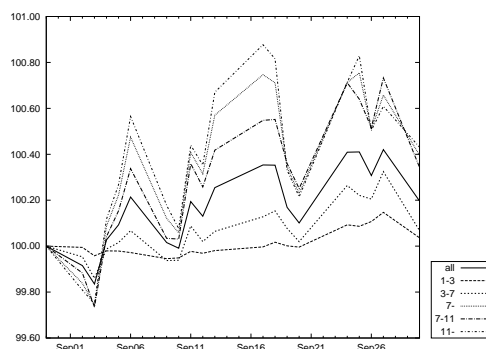
* は 1995年12月末=100。それ以外は、1993年12月末=100。

指数の推移(月次) 2023年9月末=100に補正。



出所:NFRC

指数の推移(日次) 2024年8月末=100に補正。



出所:NFRC

銘柄 残存別・月間投資収益率(2024年9月末)

| | 全体 | 短期 (1-3) | 中期 (3-7) | 長期 (7-) | 月間投資収益率 | |
|--------|------|-------------|-------------|------------|---------|-------|
| | | | | | (7-11) | (11-) |
| 総合 | 3.32 | 0.24 | 0.90 | 5.92 | 4.54 | 6.76 |
| 国債 | 3.50 | 0.20 | 0.92 | 6.10 | 4.61 | 7.00 |
| 30年国債 | 6.56 | - | 0.93 | 6.65 | 4.63 | 6.86 |
| 20年国債 | 4.65 | 0.13 | 1.05 | 6.57 | 4.62 | 7.82 |
| 10年国債 | 1.96 | 0.19 | 1.04 | 4.59 | 4.59 | - |
| 5年国債 | 0.31 | 0.19 | 0.46 | - | - | - |
| 中期国債 | 0.31 | 0.31 | - | - | - | - |
| 地方債 | 2.35 | 0.30 | 0.65 | 4.76 | 3.73 | 5.92 |
| 東京都債 | 2.21 | 0.29 | 0.82 | 5.03 | 3.80 | 6.85 |
| 五大都市債 | 2.76 | 0.28 | 0.67 | 5.42 | 3.81 | 6.28 |
| その他地方債 | 2.36 | 0.30 | 0.72 | 4.75 | 3.82 | 5.89 |
| 政保債 | 2.84 | 0.14 | 0.34 | 6.07 | 3.28 | 7.41 |
| 公営企業債券 | 0.08 | 0.14 | 0.02 | - | - | - |
| その他政保債 | 3.18 | 0.14 | 0.41 | 6.07 | 3.28 | 7.41 |
| 金融債 | 0.80 | 0.43 | 0.86 | 4.80 | 4.80 | - |
| 特定金融債 | - | - | - | - | - | - |
| 事業債 | 2.21 | 0.54 | 1.00 | 5.28 | 4.69 | 5.81 |
| 円建外債 | 1.32 | 0.55 | 1.17 | 6.51 | 4.77 | 8.86 |
| MBS | 2.80 | - | - | 2.80 | 0.51 | 2.83 |
| ABS | 2.60 | 0.84 | 1.69 | 6.04 | 4.96 | 7.55 |

出所:NFRC

「除く(銘柄)」残存別・月間投資収益率(2024年9月末)

| | 全体 | 短期 (1-3) | 中期 (3-7) | 長期 (7-) | 月間投資収益率 | |
|-----------|------|-------------|-------------|------------|---------|-------|
| | | | | | (7-11) | (11-) |
| 除く国債 | 2.32 | 0.43 | 0.80 | 4.67 | 4.04 | 5.07 |
| 除く30年国債 | 2.72 | 0.24 | 0.90 | 5.62 | 4.53 | 6.69 |
| 除く20年国債 | 2.83 | 0.25 | 0.85 | 5.58 | 4.48 | 6.22 |
| 除く10年国債 | 3.79 | 0.26 | 0.80 | 6.18 | 4.49 | 6.76 |
| 除く5年国債 | 3.67 | 0.26 | 0.99 | 5.92 | 4.54 | 6.76 |
| 除く中期国債 | 3.41 | 0.23 | 0.90 | 5.92 | 4.54 | 6.76 |
| 除く地方債 | 3.38 | 0.24 | 0.92 | 5.99 | 4.60 | 6.80 |
| 除く東京都債 | 3.32 | 0.24 | 0.90 | 5.93 | 4.54 | 6.76 |
| 除く五大都市債 | 3.32 | 0.24 | 0.90 | 5.93 | 4.54 | 6.77 |
| 除くその他地方債 | 3.36 | 0.24 | 0.91 | 5.97 | 4.57 | 6.79 |
| 除く政保債 | 3.32 | 0.24 | 0.90 | 5.92 | 4.55 | 6.76 |
| 除く公営企業債券 | 3.32 | 0.24 | 0.90 | 5.92 | 4.54 | 6.76 |
| 除くその他政保債 | 3.32 | 0.24 | 0.90 | 5.92 | 4.55 | 6.76 |
| 除く金融債 | 3.33 | 0.24 | 0.90 | 5.92 | 4.54 | 6.76 |
| 除く特定金融債 | 3.32 | 0.24 | 0.90 | 5.92 | 4.54 | 6.76 |
| 除く事業債 | 3.39 | 0.21 | 0.89 | 5.95 | 4.53 | 6.80 |
| 除く円建外債 | 3.32 | 0.24 | 0.89 | 5.92 | 4.54 | 6.76 |
| 除くMBS | 3.32 | 0.24 | 0.90 | 6.00 | 4.54 | 6.92 |
| 除くABS | 3.32 | 0.24 | 0.90 | 5.92 | 4.54 | 6.76 |
| 除くMBS・ABS | 3.33 | 0.24 | 0.90 | 6.00 | 4.54 | 6.92 |

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9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 | 2.21 | 0.54 | 1.00 | 5.28 | 4.69 | 5.81 |
| 水産・農林業 | - | - | - | - | - | - |
| 鉱業 | 2.19 | 0.67 | 2.31 | 3.66 | 3.66 | - |
| 建設業 | 1.38 | 0.42 | 0.93 | 6.00 | 4.85 | 7.61 |
| 食料品 | 1.82 | 0.49 | 0.94 | 5.77 | 4.81 | 7.51 |
| 繊維製品 | 1.64 | 0.47 | 0.91 | 6.73 | 5.15 | 8.17 |
| パルプ・紙 | 1.93 | 0.67 | 1.43 | 6.89 | 5.03 | 8.07 |
| 化学 | 2.22 | 0.67 | 1.10 | 6.30 | 4.85 | 8.32 |
| 医薬品 | 2.57 | 0.43 | 0.74 | 4.64 | 3.86 | 6.86 |
| 石油・石炭製品 | 3.22 | 0.44 | 1.83 | 5.53 | 5.00 | 7.77 |
| ゴム製品 | 1.05 | 0.52 | 1.00 | 4.85 | 4.85 | - |
| ガラス・土石製品 | 2.19 | 0.62 | 0.99 | 6.00 | 4.99 | 8.48 |
| 鉄鋼 | 1.33 | 0.43 | 0.83 | 6.31 | 5.29 | 11.31 |
| 非鉄金属 | 1.50 | 0.59 | 1.29 | 4.87 | 4.87 | - |
| 金属製品 | 1.00 | 0.59 | 0.97 | 5.01 | 5.01 | - |
| 機械 | 1.67 | 0.66 | 1.31 | 4.86 | 4.86 | - |
| 電気機器 | 1.29 | 0.53 | 0.93 | 4.76 | 4.76 | - |
| 輸送用機器 | 1.72 | 0.56 | 1.18 | 5.84 | 4.88 | 7.24 |
| 精密機器 | 1.59 | 0.52 | 1.40 | 4.78 | 4.78 | - |
| その他製品 | 2.67 | 0.55 | 1.20 | 7.96 | - | 7.96 |
| 電気・ガス業 | 3.31 | 0.54 | 1.41 | 6.44 | 5.17 | 7.75 |
| 陸運業 | 3.96 | 0.48 | 1.24 | 6.26 | 5.03 | 6.90 |
| 海運業 | 2.28 | 0.64 | 1.64 | 5.82 | 5.82 | - |
| 空運業 | 4.35 | 0.70 | 1.13 | 7.00 | 5.80 | 8.20 |
| 倉庫・運輸関連業 | 2.79 | 0.82 | 1.27 | 6.80 | 5.25 | 8.28 |
| 情報・通信業 | 2.11 | 1.05 | 1.72 | 5.88 | 5.41 | 7.21 |
| 卸売業 | 2.74 | 0.62 | 1.19 | 6.00 | 5.15 | 7.99 |
| 小売業 | 0.56 | 0.51 | 0.30 | 1.49 | -0.10 | 8.13 |
| 銀行業 | 1.12 | 0.82 | 1.22 | 5.21 | 5.21 | - |
| 証券、商品先物取引業 | 1.36 | 1.30 | 1.40 | 8.98 | 8.98 | - |
| 保険業 | 1.25 | 0.47 | 0.72 | 5.10 | 5.10 | - |
| その他金融業 | 1.27 | 0.59 | 1.10 | 5.26 | 4.94 | 7.90 |
| 不動産業 | 2.93 | 0.60 | 1.25 | 6.17 | 4.92 | 7.88 |
| サービス業 | 5.81 | 1.33 | 1.26 | 20.29 | 17.06 | 32.38 |
| 財投機関債 | 1.63 | 0.27 | 0.35 | 3.66 | 3.43 | 3.77 |

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9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 | 2.17 | 0.54 | 1.00 | 5.30 | 4.69 | 5.84 |
| AAA～AA 格 | 2.03 | 0.43 | 0.87 | 4.84 | 4.28 | 5.28 |
| AAA 格 | 1.03 | 0.35 | 0.65 | 3.90 | 3.49 | 4.62 |
| AA 格 | 2.32 | 0.46 | 0.94 | 4.95 | 4.42 | 5.33 |
| A 格 | 2.51 | 0.81 | 1.31 | 6.81 | 5.72 | 8.40 |
| 事業債 全体 | 2.21 | 0.54 | 1.00 | 5.28 | 4.69 | 5.81 |
| AAA～AA 格 | 2.07 | 0.44 | 0.86 | 4.85 | 4.28 | 5.28 |
| AAA 格 | 1.03 | 0.35 | 0.65 | 3.90 | 3.49 | 4.62 |
| AA 格 | 2.38 | 0.48 | 0.94 | 4.96 | 4.43 | 5.33 |
| A 格 | 2.57 | 0.80 | 1.31 | 6.78 | 5.72 | 8.36 |
| 円建外債 全体 | 1.32 | 0.55 | 1.17 | 6.51 | 4.77 | 8.86 |
| AAA～AA 格 | 0.69 | 0.16 | 1.03 | 3.52 | 3.47 | 4.35 |
| AAA 格 | - | - | - | - | - | - |
| AA 格 | 0.69 | 0.16 | 1.03 | 3.52 | 3.47 | 4.35 |
| A 格 | 1.87 | 0.89 | 1.32 | 7.54 | 5.70 | 9.02 |

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9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 | 0.44 | 0.86 | 4.85 | 4.28 | 5.28 |
| AAA~A格 | 2.21 | 0.54 | 1.00 | 5.28 | 4.69 | 5.81 |
| AAA~BBB格 | 2.21 | 0.54 | 1.00 | 5.28 | 4.69 | 5.81 |
| AAA~BB格 | 2.21 | 0.54 | 1.00 | 5.28 | 4.69 | 5.81 |
| AAA格 | 1.03 | 0.35 | 0.65 | 3.90 | 3.49 | 4.62 |
| AA格 | 2.38 | 0.48 | 0.94 | 4.96 | 4.43 | 5.33 |
| A格 | 2.57 | 0.80 | 1.31 | 6.78 | 5.72 | 8.36 |
| BBB格 | - | - | - | - | - | - |
| BB格 | - | - | - | - | - | - |
| B格以下 | - | - | - | - | - | - |
| 格付なし | - | - | - | - | - | - |
| 円建外債 | | | | | | |
| AAA~AA格 | 0.69 | 0.16 | 1.03 | 3.52 | 3.47 | 4.35 |
| AAA~A格 | 1.32 | 0.55 | 1.17 | 6.51 | 4.77 | 8.86 |
| AAA~BBB格 | 1.32 | 0.55 | 1.17 | 6.51 | 4.77 | 8.86 |
| AAA~BB格 | 1.32 | 0.55 | 1.17 | 6.51 | 4.77 | 8.86 |
| AAA格 | - | - | - | - | - | - |
| AA格 | 0.69 | 0.16 | 1.03 | 3.52 | 3.47 | 4.35 |
| A格 | 1.87 | 0.89 | 1.32 | 7.54 | 5.70 | 9.02 |
| 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9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 | 0.51 | 0.88 | 5.21 | 4.26 | 6.11 |
| AAA~A格 | 2.19 | 0.54 | 0.98 | 5.24 | 4.68 | 5.74 |
| AAA~BBB格 | 2.21 | 0.54 | 0.99 | 5.28 | 4.69 | 5.80 |
| AAA~BB格 | 2.21 | 0.54 | 1.00 | 5.28 | 4.69 | 5.81 |
| AAA格 | - | - | - | - | - | - |
| AA格 | 1.82 | 0.51 | 0.88 | 5.21 | 4.26 | 6.11 |
| A格 | 2.27 | 0.55 | 1.00 | 5.25 | 4.74 | 5.69 |
| BBB格 | 2.68 | 0.63 | 1.18 | 6.55 | 5.15 | 8.17 |
| BB格 | 2.48 | - | 1.77 | 9.10 | - | 9.10 |
| B格以下 | - | - | - | - | - | - |
| 格付なし | - | - | - | - | - | - |
| 円建外債 | | | | | | |
| AAA~AA格 | 0.93 | 0.74 | 1.04 | 3.26 | 3.26 | - |
| AAA~A格 | 0.84 | 0.32 | 1.06 | 3.86 | 3.52 | 4.31 |
| AAA~BBB格 | 1.32 | 0.55 | 1.17 | 6.51 | 4.77 | 8.86 |
| AAA~BB格 | 1.32 | 0.55 | 1.17 | 6.51 | 4.77 | 8.86 |
| AAA格 | - | - | - | - | - | - |
| AA格 | 0.93 | 0.74 | 1.04 | 3.26 | 3.26 | - |
| A格 | 0.83 | 0.24 | 1.06 | 3.92 | 3.57 | 4.31 |
| BBB格 | 2.36 | 1.19 | 1.38 | 9.94 | 6.38 | 14.68 |
| 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9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 | 2.00 | 0.39 | 0.74 | 4.60 | 4.16 | 4.90 |
| AAA~A 格 | 2.17 | 0.50 | 0.96 | 5.12 | 4.51 | 5.64 |
| AAA~BBB 格 | 2.17 | 0.51 | 0.96 | 5.12 | 4.51 | 5.64 |
| AAA~BB 格 | 2.17 | 0.51 | 0.96 | 5.12 | 4.51 | 5.64 |
| AAA 格 | 1.13 | 0.47 | 0.93 | 5.33 | 4.77 | 6.77 |
| AA 格 | 2.02 | 0.38 | 0.74 | 4.59 | 4.15 | 4.90 |
| A 格 | 2.49 | 0.70 | 1.30 | 6.29 | 5.07 | 7.90 |
| BBB 格 | 2.27 | 1.68 | 2.15 | 7.58 | 7.58 | - |
| BB 格 | - | - | - | - | - | - |
| B 格以下 | - | - | - | - | - | - |
| 格付なし | 2.55 | 0.89 | 1.25 | 7.99 | 6.90 | 9.94 |
| 円建外債 | | | | | | |
| AAA~AA 格 | 1.03 | 1.03 | - | - | - | - |
| AAA~A 格 | 1.15 | 0.97 | 1.15 | 3.59 | 3.59 | - |
| AAA~BBB 格 | 1.15 | 0.97 | 1.15 | 3.59 | 3.59 | - |
| AAA~BB 格 | 1.15 | 0.97 | 1.15 | 3.59 | 3.59 | - |
| AAA 格 | - | - | - | - | - | - |
| AA 格 | 1.03 | 1.03 | - | - | - | - |
| A 格 | 1.15 | 0.97 | 1.15 | 3.59 | 3.59 | - |
| BBB 格 | - | - | - | - | - | - |
| BB 格 | - | - | - | - | - | - |
| B 格以下 | - | - | - | - | - | - |
| 格付なし | 1.37 | 0.42 | 1.18 | 6.85 | 5.02 | 8.86 |

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、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9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 | 0.48 | 0.94 | 5.34 | 4.29 | 6.83 |
| AAA~A 格 | 2.11 | 0.56 | 1.08 | 5.91 | 4.87 | 7.37 |
| AAA~BBB 格 | 2.11 | 0.56 | 1.08 | 5.91 | 4.87 | 7.37 |
| AAA~BB 格 | 2.11 | 0.56 | 1.08 | 5.91 | 4.87 | 7.37 |
| AAA 格 | 1.05 | 0.34 | 0.65 | 3.90 | 3.49 | 4.62 |
| AA 格 | 2.27 | 0.58 | 1.13 | 5.82 | 4.59 | 7.44 |
| A 格 | 2.85 | 0.80 | 1.43 | 7.10 | 6.11 | 8.51 |
| BBB 格 | - | - | - | - | - | - |
| BB 格 | - | - | - | - | - | - |
| B 格以下 | - | - | - | - | - | - |
| 格付なし | 2.35 | 0.51 | 0.83 | 4.71 | 4.43 | 4.88 |
| 円建外債 | | | | | | |
| AAA~AA 格 | 1.21 | 0.87 | 1.25 | 3.62 | 3.45 | 4.35 |
| AAA~A 格 | 2.36 | 0.78 | 1.50 | 7.84 | 6.02 | 8.97 |
| AAA~BBB 格 | 2.36 | 0.78 | 1.50 | 7.84 | 6.02 | 8.97 |
| AAA~BB 格 | 2.36 | 0.78 | 1.50 | 7.84 | 6.02 | 8.97 |
| AAA 格 | - | - | - | - | - | - |
| AA 格 | 1.21 | 0.87 | 1.25 | 3.62 | 3.45 | 4.35 |
| A 格 | 2.78 | 0.74 | 1.61 | 8.39 | 6.86 | 9.14 |
| BBB 格 | - | - | - | - | - | - |
| BB 格 | - | - | - | - | - | - |
| B 格以下 | - | - | - | - | - | - |
| 格付なし | 0.86 | 0.45 | 1.08 | 3.78 | 3.74 | 4.98 |

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9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 | 2.02 | 0.37 | 0.66 | 4.51 | 4.19 | 4.72 |
| AAA~BBB格 | 2.07 | 0.38 | 0.73 | 4.64 | 4.26 | 4.90 |
| AAA~BB格 | 2.07 | 0.38 | 0.73 | 4.64 | 4.26 | 4.90 |
| AAA格 | - | - | - | - | - | - |
| AA格 | - | - | - | - | - | - |
| A格 | 2.02 | 0.37 | 0.66 | 4.51 | 4.19 | 4.72 |
| BBB格 | 2.69 | 0.44 | 1.24 | 6.63 | 5.08 | 8.24 |
| BB格 | - | - | - | - | - | - |
| B格以下 | - | - | - | - | - | - |
| 格付なし | 2.29 | 0.63 | 1.14 | 5.78 | 4.95 | 6.70 |
| 円建外債 | | | | | | |
| AAA~AA格 | 0.62 | 0.04 | 1.01 | 3.43 | 3.43 | - |
| AAA~A格 | 0.87 | 0.30 | 1.08 | 3.95 | 3.73 | 4.31 |
| AAA~BBB格 | 1.28 | 0.43 | 1.14 | 6.59 | 4.81 | 8.86 |
| AAA~BB格 | 1.28 | 0.43 | 1.14 | 6.59 | 4.81 | 8.86 |
| AAA格 | - | - | - | - | - | - |
| AA格 | 0.62 | 0.04 | 1.01 | 3.43 | 3.43 | - |
| A格 | 1.22 | 0.60 | 1.23 | 4.20 | 4.06 | 4.31 |
| BBB格 | 2.61 | 1.05 | 1.31 | 11.22 | 7.31 | 14.68 |
| BB格 | - | - | - | - | - | - |
| B格以下 | - | - | - | - | - | - |
| 格付なし | 1.72 | 1.59 | 1.93 | 3.84 | 3.84 | - |

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9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 | 5.30 | 0.37 | 1.58 | 6.36 | 4.91 | 7.22 |
| AAA~A格 | 2.34 | 0.32 | 0.81 | 5.09 | 4.19 | 5.88 |
| AAA~BBB格 | 2.33 | 0.33 | 0.82 | 5.10 | 4.20 | 5.89 |
| AAA~BB格 | 2.33 | 0.33 | 0.86 | 5.12 | 4.20 | 5.92 |
| AAA格 | - | - | - | - | - | - |
| AA格 | 5.30 | 0.37 | 1.58 | 6.36 | 4.91 | 7.22 |
| A格 | 2.19 | 0.32 | 0.80 | 4.96 | 4.13 | 5.71 |
| BBB格 | 1.81 | 0.38 | 1.21 | 7.06 | 5.21 | 11.31 |
| BB格 | 2.48 | - | 1.77 | 9.10 | - | 9.10 |
| B格以下 | - | - | - | - | - | - |
| 格付なし | 2.17 | 0.59 | 1.04 | 5.35 | 4.89 | 5.76 |
| 円建外債 | | | | | | |
| AAA~AA格 | 0.92 | 0.69 | 1.01 | 3.26 | 3.26 | - |
| AAA~A格 | 0.83 | 0.28 | 1.07 | 3.87 | 3.53 | 4.31 |
| AAA~BBB格 | 1.31 | 0.52 | 1.17 | 6.54 | 4.79 | 8.86 |
| AAA~BB格 | 1.31 | 0.52 | 1.17 | 6.54 | 4.79 | 8.86 |
| AAA格 | - | - | - | - | - | - |
| AA格 | 0.92 | 0.69 | 1.01 | 3.26 | 3.26 | - |
| A格 | 0.82 | 0.21 | 1.08 | 3.93 | 3.58 | 4.31 |
| BBB格 | 2.42 | 1.18 | 1.38 | 9.94 | 6.38 | 14.68 |
| BB格 | - | - | - | - | - | - |
| B格以下 | - | - | - | - | - | - |
| 格付なし | 1.60 | 1.58 | 1.44 | 3.17 | 3.17 | - |

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9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 | 1,137,187 | 96.80 | 96.91 | 10.25 | 0.81 | 0.92 | 0.89 | 8.79 | 8.73 | 8.74 | 4 |
| 短期(1-3) | 230,509 | 100.01 | 100.08 | 1.99 | 0.39 | 0.39 | 0.39 | 1.98 | 1.97 | 1.98 | 6 |
| 中期(3-7) | 307,217 | 100.69 | 100.80 | 4.85 | 0.66 | 0.52 | 0.52 | 4.77 | 4.76 | 4.77 | 5 |
| 長期(7-) | 599,461 | 93.57 | 93.70 | 16.19 | 1.05 | 1.36 | 1.31 | 13.79 | 13.69 | 13.70 | 4 |
| 長期(7-11) | 206,810 | 102.16 | 102.32 | 8.75 | 1.02 | 0.77 | 0.78 | 8.37 | 8.34 | 8.37 | 3 |
| 超長期(11-) | 392,651 | 89.04 | 89.16 | 20.11 | 1.06 | 1.71 | 1.62 | 17.07 | 16.92 | 16.93 | 4 |
| (11-15) | 95,704 | 96.88 | 96.99 | 13.00 | 0.97 | 1.24 | 1.22 | 12.19 | 12.11 | 12.16 | 4 |
| (15-) | 296,947 | 86.52 | 86.64 | 22.40 | 1.09 | 1.88 | 1.77 | 18.83 | 18.66 | 18.65 | 4 |
| 国債 | 964,488 | 96.76 | 96.88 | 10.76 | 0.83 | 0.92 | 0.89 | 9.18 | 9.12 | 9.13 | 1 |
| 短期(1-3) | 189,668 | 100.10 | 100.16 | 1.98 | 0.39 | 0.34 | 0.34 | 1.97 | 1.97 | 1.97 | 1 |
| 中期(3-7) | 249,785 | 100.99 | 101.09 | 4.87 | 0.67 | 0.47 | 0.48 | 4.79 | 4.78 | 4.79 | 0 |
| 長期(7-) | 525,035 | 93.55 | 93.69 | 16.74 | 1.07 | 1.37 | 1.31 | 14.22 | 14.11 | 14.11 | 1 |
| 長期(7-11) | 179,102 | 102.54 | 102.70 | 8.77 | 1.03 | 0.74 | 0.75 | 8.39 | 8.36 | 8.39 | 0 |
| 超長期(11-) | 345,933 | 88.90 | 89.02 | 20.86 | 1.09 | 1.74 | 1.64 | 17.69 | 17.54 | 17.53 | 1 |
| (11-15) | 83,771 | 97.39 | 97.50 | 13.08 | 0.99 | 1.21 | 1.20 | 12.25 | 12.17 | 12.23 | 1 |
| (15-) | 262,162 | 86.19 | 86.31 | 23.34 | 1.12 | 1.93 | 1.79 | 19.66 | 19.48 | 19.45 | 1 |
| 地方債 | 66,950 | 97.75 | 97.85 | 7.34 | 0.61 | 0.78 | 0.80 | 6.80 | 6.76 | 6.77 | 11 |
| 短期(1-3) | 12,792 | 99.87 | 99.92 | 2.01 | 0.37 | 0.45 | 0.45 | 2.00 | 2.00 | 2.00 | 11 |
| 中期(3-7) | 24,571 | 99.48 | 99.57 | 4.93 | 0.50 | 0.58 | 0.58 | 4.86 | 4.85 | 4.86 | 11 |
| 長期(7-) | 29,587 | 95.40 | 95.52 | 11.66 | 0.81 | 1.11 | 1.14 | 10.64 | 10.57 | 10.59 | 12 |
| 政保債 | 14,221 | 96.70 | 96.89 | 9.28 | 0.73 | 0.90 | 0.86 | 8.02 | 7.97 | 7.99 | 7 |
| 短期(1-3) | 3,306 | 99.55 | 99.59 | 1.99 | 0.18 | 0.40 | 0.40 | 1.99 | 1.98 | 1.99 | 7 |
| 中期(3-7) | 4,307 | 100.67 | 100.83 | 4.45 | 0.62 | 0.52 | 0.52 | 4.39 | 4.38 | 4.39 | 6 |
| 長期(7-) | 6,608 | 92.69 | 92.97 | 16.07 | 1.07 | 1.43 | 1.36 | 13.82 | 13.72 | 13.75 | 8 |
| 金融債 | 3,441 | 98.92 | 98.98 | 3.13 | 0.30 | 0.66 | 0.66 | 3.09 | 3.08 | 3.09 | 26 |
| 短期(1-3) | 2,002 | 99.17 | 99.20 | 2.00 | 0.17 | 0.58 | 0.58 | 2.00 | 1.99 | 2.00 | 25 |
| 中期(3-7) | 1,271 | 98.76 | 98.87 | 4.24 | 0.45 | 0.73 | 0.73 | 4.19 | 4.17 | 4.19 | 28 |
| 長期(7-) | 168 | 97.11 | 97.23 | 8.27 | 0.71 | 1.12 | 1.11 | 8.02 | 7.98 | 8.02 | 41 |
| 事業債 | 70,303 | 96.44 | 96.60 | 7.44 | 0.74 | 1.07 | 1.04 | 6.38 | 6.34 | 6.35 | 39 |
| 短期(1-3) | 20,897 | 99.56 | 99.66 | 2.00 | 0.46 | 0.68 | 0.68 | 1.99 | 1.98 | 1.99 | 35 |
| 中期(3-7) | 25,824 | 99.18 | 99.33 | 4.70 | 0.69 | 0.86 | 0.85 | 4.61 | 4.59 | 4.61 | 38 |
| 長期(7-) | 23,582 | 90.67 | 90.90 | 15.27 | 1.05 | 1.70 | 1.60 | 12.77 | 12.66 | 12.68 | 43 |
| 長期(7-11) | 10,219 | 98.64 | 98.89 | 8.65 | 1.03 | 1.22 | 1.21 | 8.26 | 8.21 | 8.26 | 47 |
| 超長期(11-) | 13,363 | 84.57 | 84.80 | 20.33 | 1.07 | 2.13 | 1.96 | 16.80 | 16.63 | 16.62 | 39 |
| 円建外債 | 3,106 | 99.40 | 99.68 | 3.55 | 1.02 | 1.21 | 1.21 | 3.40 | 3.38 | 3.40 | 78 |
| 短期(1-3) | 1,660 | 99.65 | 99.90 | 2.07 | 0.92 | 1.08 | 1.08 | 2.05 | 2.04 | 2.05 | 74 |
| 中期(3-7) | 1,169 | 99.03 | 99.29 | 3.96 | 0.97 | 1.22 | 1.22 | 3.88 | 3.86 | 3.88 | 77 |
| 長期(7-) | 276 | 99.51 | 100.04 | 10.66 | 1.86 | 1.97 | 1.96 | 9.49 | 9.40 | 9.47 | 104 |
| 長期(7-11) | 160 | 98.32 | 98.60 | 8.46 | 1.42 | 1.68 | 1.67 | 7.95 | 7.88 | 7.94 | 96 |
| 超長期(11-) | 116 | 101.16 | 102.02 | 13.70 | 2.48 | 2.35 | 2.36 | 11.56 | 11.42 | 11.50 | 116 |
| MBS | 14,018 | 95.44 | 95.47 | 7.27 | 0.63 | 0.82 | 1.20 | 6.80 | 6.76 | 7.07 | 22 |
| ABS | 662 | 96.22 | 96.39 | 5.84 | 0.72 | 1.26 | 1.23 | 5.43 | 5.39 | 5.43 | 67 |
| 短期(1-3) | 186 | 99.35 | 99.52 | 2.02 | 0.65 | 0.97 | 0.96 | 2.01 | 2.00 | 2.01 | 63 |
| 中期(3-7) | 289 | 97.51 | 97.65 | 5.04 | 0.66 | 1.15 | 1.14 | 4.94 | 4.91 | 4.94 | 66 |
| 長期(7-) | 186 | 91.09 | 91.31 | 10.91 | 0.87 | 1.76 | 1.66 | 9.98 | 9.89 | 9.96 | 74 |

出所:NFRIC

「除く」銘柄 残存別・ポートフォリオ指標 (2024年9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 | 1,123,169 | 96.82 | 96.93 | 10.29 | 0.81 | 0.92 | 0.89 | 8.81 | 8.75 | 8.76 | 4 |
| 短期 (1-3) | 230,509 | 100.01 | 100.08 | 1.99 | 0.39 | 0.39 | 0.39 | 1.98 | 1.97 | 1.98 | 6 |
| 中期 (3-7) | 307,217 | 100.69 | 100.80 | 4.85 | 0.66 | 0.52 | 0.52 | 4.77 | 4.76 | 4.77 | 5 |
| 長期 (7-) | 585,443 | 93.52 | 93.66 | 16.40 | 1.06 | 1.37 | 1.31 | 13.97 | 13.86 | 13.87 | 3 |
| 長期 (7-11) | 206,628 | 102.16 | 102.33 | 8.76 | 1.02 | 0.77 | 0.78 | 8.38 | 8.35 | 8.37 | 3 |
| 超長期 (11-) | 378,815 | 88.81 | 88.93 | 20.58 | 1.08 | 1.74 | 1.64 | 17.47 | 17.32 | 17.31 | 3 |
| (11-15) | 95,704 | 96.88 | 96.99 | 13.00 | 0.97 | 1.24 | 1.22 | 12.19 | 12.11 | 12.16 | 4 |
| (15-) | 283,111 | 86.08 | 86.21 | 23.14 | 1.11 | 1.93 | 1.80 | 19.48 | 19.30 | 19.27 | 3 |
| 除く ABS | 1,136,525 | 96.80 | 96.91 | 10.25 | 0.81 | 0.92 | 0.89 | 8.79 | 8.73 | 8.74 | 4 |
| 短期 (1-3) | 230,323 | 100.02 | 100.08 | 1.99 | 0.39 | 0.39 | 0.39 | 1.98 | 1.97 | 1.98 | 5 |
| 中期 (3-7) | 306,928 | 100.69 | 100.80 | 4.85 | 0.66 | 0.52 | 0.52 | 4.77 | 4.76 | 4.77 | 5 |
| 長期 (7-) | 599,275 | 93.57 | 93.70 | 16.19 | 1.05 | 1.36 | 1.31 | 13.80 | 13.69 | 13.71 | 4 |
| 長期 (7-11) | 206,707 | 102.16 | 102.33 | 8.75 | 1.02 | 0.77 | 0.78 | 8.37 | 8.34 | 8.37 | 3 |
| 超長期 (11-) | 392,567 | 89.04 | 89.16 | 20.11 | 1.06 | 1.71 | 1.62 | 17.07 | 16.93 | 16.93 | 4 |
| (11-15) | 95,642 | 96.88 | 96.99 | 13.00 | 0.97 | 1.24 | 1.22 | 12.19 | 12.11 | 12.16 | 4 |
| (15-) | 296,925 | 86.52 | 86.64 | 22.40 | 1.09 | 1.88 | 1.77 | 18.83 | 18.66 | 18.65 | 4 |
| 除く MBS・ABS | 1,122,507 | 96.82 | 96.93 | 10.29 | 0.81 | 0.92 | 0.89 | 8.81 | 8.75 | 8.76 | 4 |
| 短期 (1-3) | 230,323 | 100.02 | 100.08 | 1.99 | 0.39 | 0.39 | 0.39 | 1.98 | 1.97 | 1.98 | 5 |
| 中期 (3-7) | 306,928 | 100.69 | 100.80 | 4.85 | 0.66 | 0.52 | 0.52 | 4.77 | 4.76 | 4.77 | 5 |
| 長期 (7-) | 585,256 | 93.52 | 93.66 | 16.41 | 1.06 | 1.37 | 1.31 | 13.97 | 13.86 | 13.87 | 3 |
| 長期 (7-11) | 206,525 | 102.16 | 102.33 | 8.76 | 1.02 | 0.77 | 0.78 | 8.38 | 8.35 | 8.37 | 3 |
| 超長期 (11-) | 378,731 | 88.81 | 88.94 | 20.58 | 1.08 | 1.74 | 1.64 | 17.47 | 17.32 | 17.31 | 3 |
| (11-15) | 95,642 | 96.88 | 96.99 | 13.00 | 0.97 | 1.24 | 1.22 | 12.19 | 12.11 | 12.16 | 4 |
| (15-) | 283,089 | 86.08 | 86.21 | 23.14 | 1.11 | 1.93 | 1.80 | 19.48 | 19.30 | 19.27 | 3 |
| 除く 国債 | 172,699 | 96.99 | 97.12 | 7.38 | 0.68 | 0.92 | 0.94 | 6.59 | 6.55 | 6.58 | 25 |
| 短期 (1-3) | 40,841 | 99.64 | 99.72 | 2.01 | 0.41 | 0.60 | 0.60 | 2.00 | 1.99 | 2.00 | 26 |
| 中期 (3-7) | 57,432 | 99.40 | 99.53 | 4.75 | 0.60 | 0.72 | 0.72 | 4.68 | 4.66 | 4.68 | 25 |
| 長期 (7-) | 74,426 | 93.67 | 93.83 | 12.35 | 0.88 | 1.27 | 1.32 | 10.83 | 10.75 | 10.82 | 24 |
| 長期 (7-11) | 27,708 | 99.70 | 99.88 | 8.59 | 0.93 | 0.99 | 0.99 | 8.25 | 8.21 | 8.24 | 25 |
| 超長期 (11-) | 46,718 | 90.10 | 90.25 | 14.58 | 0.85 | 1.45 | 1.53 | 12.52 | 12.41 | 12.51 | 23 |

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9月末、10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 | 1,145,501 | 96.83 | 96.94 | 10.27 | 0.81 | 0.92 | 0.90 | 8.81 | 8.75 | 8.76 | 4 |
| 短期 (1-3) | 230,319 | 100.02 | 100.09 | 2.01 | 0.40 | 0.39 | 0.39 | 2.00 | 2.00 | 2.00 | 6 |
| 中期 (3-7) | 311,167 | 100.67 | 100.78 | 4.86 | 0.65 | 0.52 | 0.52 | 4.79 | 4.77 | 4.79 | 5 |
| 長期 (7-) | 604,015 | 93.63 | 93.77 | 16.21 | 1.05 | 1.36 | 1.31 | 13.81 | 13.70 | 13.72 | 4 |
| 長期 (7-11) | 208,923 | 102.17 | 102.34 | 8.78 | 1.03 | 0.78 | 0.78 | 8.39 | 8.36 | 8.39 | 3 |
| 超長期 (11-) | 395,093 | 89.11 | 89.23 | 20.14 | 1.07 | 1.71 | 1.63 | 17.09 | 16.94 | 16.95 | 4 |
| (11-15) | 95,777 | 96.86 | 96.97 | 13.00 | 0.97 | 1.24 | 1.22 | 12.19 | 12.11 | 12.17 | 4 |
| (15-) | 299,316 | 86.63 | 86.76 | 22.43 | 1.10 | 1.88 | 1.77 | 18.84 | 18.67 | 18.66 | 4 |
| 国債 | 972,942 | 96.80 | 96.91 | 10.78 | 0.84 | 0.92 | 0.89 | 9.19 | 9.13 | 9.14 | 1 |
| 短期 (1-3) | 189,459 | 100.10 | 100.16 | 2.00 | 0.40 | 0.35 | 0.35 | 1.99 | 1.99 | 1.99 | 1 |
| 中期 (3-7) | 253,407 | 100.97 | 101.08 | 4.87 | 0.66 | 0.47 | 0.48 | 4.79 | 4.78 | 4.79 | 0 |
| 長期 (7-) | 530,076 | 93.62 | 93.76 | 16.74 | 1.08 | 1.37 | 1.31 | 14.22 | 14.11 | 14.11 | 1 |
| 長期 (7-11) | 181,701 | 102.53 | 102.70 | 8.79 | 1.04 | 0.74 | 0.75 | 8.40 | 8.37 | 8.40 | 0 |
| 超長期 (11-) | 348,374 | 88.97 | 89.09 | 20.89 | 1.10 | 1.74 | 1.64 | 17.71 | 17.56 | 17.55 | 1 |
| (11-15) | 83,771 | 97.39 | 97.50 | 13.08 | 0.99 | 1.21 | 1.20 | 12.25 | 12.17 | 12.23 | 1 |
| (15-) | 264,603 | 86.31 | 86.43 | 23.36 | 1.13 | 1.93 | 1.80 | 19.66 | 19.48 | 19.45 | 1 |
| 地方債 | 66,953 | 97.75 | 97.85 | 7.40 | 0.61 | 0.79 | 0.80 | 6.85 | 6.81 | 6.83 | 11 |
| 短期 (1-3) | 12,769 | 99.84 | 99.90 | 2.08 | 0.37 | 0.45 | 0.45 | 2.07 | 2.07 | 2.07 | 11 |
| 中期 (3-7) | 24,747 | 99.45 | 99.54 | 5.00 | 0.50 | 0.59 | 0.59 | 4.93 | 4.92 | 4.93 | 11 |
| 長期 (7-) | 29,437 | 95.41 | 95.53 | 11.72 | 0.82 | 1.12 | 1.15 | 10.69 | 10.63 | 10.64 | 12 |
| 政保債 | 14,198 | 96.70 | 96.89 | 9.37 | 0.74 | 0.90 | 0.87 | 8.11 | 8.06 | 8.08 | 7 |
| 短期 (1-3) | 3,371 | 99.56 | 99.60 | 2.09 | 0.20 | 0.41 | 0.41 | 2.09 | 2.08 | 2.09 | 7 |
| 中期 (3-7) | 4,172 | 100.74 | 100.91 | 4.56 | 0.64 | 0.52 | 0.53 | 4.49 | 4.48 | 4.49 | 6 |
| 長期 (7-) | 6,655 | 92.71 | 92.99 | 16.07 | 1.07 | 1.43 | 1.36 | 13.83 | 13.73 | 13.77 | 8 |
| 金融債 | 3,426 | 98.93 | 99.00 | 3.20 | 0.31 | 0.67 | 0.67 | 3.16 | 3.15 | 3.16 | 27 |
| 短期 (1-3) | 1,990 | 99.14 | 99.18 | 2.07 | 0.17 | 0.59 | 0.59 | 2.07 | 2.06 | 2.07 | 25 |
| 中期 (3-7) | 1,267 | 98.83 | 98.94 | 4.31 | 0.47 | 0.74 | 0.73 | 4.26 | 4.24 | 4.26 | 28 |
| 長期 (7-) | 168 | 97.11 | 97.23 | 8.27 | 0.71 | 1.12 | 1.11 | 8.02 | 7.98 | 8.02 | 41 |
| 事業債 | 70,172 | 96.43 | 96.60 | 7.49 | 0.75 | 1.08 | 1.04 | 6.43 | 6.39 | 6.40 | 39 |
| 短期 (1-3) | 20,867 | 99.57 | 99.67 | 2.06 | 0.47 | 0.69 | 0.69 | 2.05 | 2.04 | 2.05 | 35 |
| 中期 (3-7) | 26,117 | 99.10 | 99.25 | 4.78 | 0.69 | 0.86 | 0.86 | 4.70 | 4.68 | 4.70 | 39 |
| 長期 (7-) | 23,188 | 90.61 | 90.85 | 15.44 | 1.07 | 1.72 | 1.62 | 12.90 | 12.79 | 12.80 | 43 |
| 長期 (7-11) | 9,838 | 98.78 | 99.04 | 8.76 | 1.06 | 1.23 | 1.22 | 8.35 | 8.30 | 8.35 | 47 |
| 超長期 (11-) | 13,350 | 84.59 | 84.81 | 20.36 | 1.07 | 2.13 | 1.96 | 16.82 | 16.65 | 16.64 | 39 |
| 円建外債 | 3,125 | 99.41 | 99.68 | 3.70 | 1.07 | 1.25 | 1.25 | 3.54 | 3.51 | 3.54 | 81 |
| 短期 (1-3) | 1,689 | 99.62 | 99.87 | 2.24 | 0.96 | 1.12 | 1.12 | 2.21 | 2.20 | 2.21 | 76 |
| 中期 (3-7) | 1,159 | 99.03 | 99.28 | 4.09 | 1.01 | 1.25 | 1.25 | 4.00 | 3.98 | 4.00 | 80 |
| 長期 (7-) | 278 | 99.72 | 100.24 | 10.94 | 1.95 | 2.02 | 2.02 | 9.67 | 9.57 | 9.64 | 108 |
| 長期 (7-11) | 157 | 98.68 | 98.97 | 8.64 | 1.53 | 1.74 | 1.73 | 8.07 | 8.00 | 8.07 | 100 |
| 超長期 (11-) | 121 | 101.06 | 101.90 | 13.94 | 2.50 | 2.38 | 2.38 | 11.69 | 11.55 | 11.63 | 117 |
| MBS | 14,034 | 95.44 | 95.48 | 7.31 | 0.63 | 0.82 | 1.20 | 6.84 | 6.79 | 7.11 | 22 |
| ABS | 651 | 96.16 | 96.34 | 5.97 | 0.73 | 1.27 | 1.24 | 5.56 | 5.52 | 5.55 | 67 |
| 短期 (1-3) | 174 | 99.29 | 99.46 | 2.15 | 0.67 | 0.99 | 0.99 | 2.13 | 2.12 | 2.13 | 64 |
| 中期 (3-7) | 297 | 97.45 | 97.59 | 5.12 | 0.66 | 1.15 | 1.14 | 5.02 | 4.99 | 5.02 | 65 |
| 長期 (7-) | 180 | 91.03 | 91.25 | 11.08 | 0.90 | 1.77 | 1.68 | 10.11 | 10.02 | 10.09 | 75 |

出所:NFRIC

「除く」銘柄 残存別・ポートフォリオ指標 (2024年9月末、10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 | 1,131,466 | 96.84 | 96.96 | 10.31 | 0.82 | 0.92 | 0.89 | 8.83 | 8.78 | 8.78 | 4 |
| 短期 (1-3) | 230,319 | 100.02 | 100.09 | 2.01 | 0.40 | 0.39 | 0.39 | 2.00 | 2.00 | 2.00 | 6 |
| 中期 (3-7) | 311,167 | 100.67 | 100.78 | 4.86 | 0.65 | 0.52 | 0.52 | 4.79 | 4.77 | 4.79 | 5 |
| 長期 (7-) | 589,981 | 93.58 | 93.73 | 16.42 | 1.06 | 1.37 | 1.31 | 13.98 | 13.87 | 13.88 | 3 |
| 長期 (7-11) | 208,741 | 102.18 | 102.35 | 8.78 | 1.03 | 0.78 | 0.78 | 8.40 | 8.37 | 8.40 | 3 |
| 超長期 (11-) | 381,240 | 88.88 | 89.01 | 20.61 | 1.08 | 1.74 | 1.64 | 17.49 | 17.34 | 17.33 | 3 |
| (11-15) | 95,777 | 96.86 | 96.97 | 13.00 | 0.97 | 1.24 | 1.22 | 12.19 | 12.11 | 12.17 | 4 |
| (15-) | 285,463 | 86.20 | 86.33 | 23.16 | 1.12 | 1.93 | 1.80 | 19.49 | 19.31 | 19.28 | 3 |
| 除く ABS | 1,144,850 | 96.83 | 96.94 | 10.28 | 0.81 | 0.92 | 0.90 | 8.81 | 8.75 | 8.77 | 4 |
| 短期 (1-3) | 230,145 | 100.02 | 100.09 | 2.01 | 0.40 | 0.39 | 0.39 | 2.00 | 2.00 | 2.00 | 6 |
| 中期 (3-7) | 310,869 | 100.67 | 100.78 | 4.86 | 0.65 | 0.52 | 0.52 | 4.79 | 4.77 | 4.79 | 5 |
| 長期 (7-) | 603,835 | 93.63 | 93.77 | 16.21 | 1.05 | 1.36 | 1.31 | 13.81 | 13.71 | 13.72 | 4 |
| 長期 (7-11) | 208,821 | 102.18 | 102.35 | 8.78 | 1.03 | 0.77 | 0.78 | 8.39 | 8.36 | 8.39 | 3 |
| 超長期 (11-) | 395,014 | 89.11 | 89.23 | 20.15 | 1.07 | 1.71 | 1.63 | 17.09 | 16.95 | 16.95 | 4 |
| (11-15) | 95,719 | 96.86 | 96.98 | 13.00 | 0.97 | 1.24 | 1.22 | 12.19 | 12.11 | 12.17 | 4 |
| (15-) | 299,295 | 86.63 | 86.76 | 22.43 | 1.10 | 1.88 | 1.77 | 18.84 | 18.67 | 18.66 | 4 |
| 除く MBS・ABS | 1,130,815 | 96.84 | 96.96 | 10.31 | 0.82 | 0.92 | 0.89 | 8.84 | 8.78 | 8.79 | 4 |
| 短期 (1-3) | 230,145 | 100.02 | 100.09 | 2.01 | 0.40 | 0.39 | 0.39 | 2.00 | 2.00 | 2.00 | 6 |
| 中期 (3-7) | 310,869 | 100.67 | 100.78 | 4.86 | 0.65 | 0.52 | 0.52 | 4.79 | 4.77 | 4.79 | 5 |
| 長期 (7-) | 589,801 | 93.59 | 93.73 | 16.43 | 1.06 | 1.37 | 1.31 | 13.98 | 13.87 | 13.88 | 3 |
| 長期 (7-11) | 208,639 | 102.18 | 102.35 | 8.78 | 1.03 | 0.78 | 0.78 | 8.40 | 8.37 | 8.40 | 3 |
| 超長期 (11-) | 381,162 | 88.88 | 89.01 | 20.61 | 1.08 | 1.74 | 1.64 | 17.49 | 17.34 | 17.33 | 3 |
| (11-15) | 95,719 | 96.86 | 96.98 | 13.00 | 0.97 | 1.24 | 1.22 | 12.19 | 12.11 | 12.17 | 4 |
| (15-) | 285,442 | 86.20 | 86.33 | 23.16 | 1.12 | 1.93 | 1.80 | 19.49 | 19.31 | 19.28 | 3 |
| 除く 国債 | 172,558 | 96.99 | 97.12 | 7.44 | 0.68 | 0.92 | 0.94 | 6.64 | 6.60 | 6.64 | 25 |
| 短期 (1-3) | 40,859 | 99.63 | 99.72 | 2.08 | 0.42 | 0.61 | 0.61 | 2.07 | 2.06 | 2.07 | 26 |
| 中期 (3-7) | 57,760 | 99.35 | 99.48 | 4.84 | 0.60 | 0.73 | 0.72 | 4.76 | 4.74 | 4.76 | 25 |
| 長期 (7-) | 73,940 | 93.68 | 93.84 | 12.43 | 0.89 | 1.27 | 1.32 | 10.89 | 10.81 | 10.88 | 23 |
| 長期 (7-11) | 27,221 | 99.79 | 99.98 | 8.69 | 0.95 | 0.99 | 0.99 | 8.33 | 8.28 | 8.32 | 25 |
| 超長期 (11-) | 46,718 | 90.11 | 90.26 | 14.61 | 0.85 | 1.46 | 1.54 | 12.54 | 12.44 | 12.53 | 23 |

出所:NFRC

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

特定銘柄 残存別・ポートフォリオ指標 (2024年9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 | 183,689 | 92.84 | 93.02 | 20.66 | 1.45 | 1.70 | 1.62 | 17.20 | 17.05 | 17.05 | 2 |
| 短期 (1-3) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中期 (3-7) | 2,403 | 111.77 | 112.50 | 5.88 | 2.56 | 0.50 | 0.52 | 5.49 | 5.48 | 5.49 | 1 |
| 長期 (7-) | 181,286 | 92.59 | 92.76 | 20.86 | 1.44 | 1.72 | 1.63 | 17.39 | 17.24 | 17.24 | 2 |
| 長期 (7-11) | 14,507 | 112.25 | 112.65 | 9.39 | 2.17 | 0.78 | 0.82 | 8.57 | 8.53 | 8.56 | 2 |
| 超長期 (11-) | 166,779 | 90.88 | 91.03 | 21.86 | 1.37 | 1.82 | 1.72 | 18.34 | 18.18 | 18.17 | 2 |
| 20年国債 | 295,337 | 99.38 | 99.58 | 10.40 | 1.32 | 0.93 | 0.92 | 9.46 | 9.41 | 9.44 | 0 |
| 短期 (1-3) | 26,467 | 103.79 | 104.11 | 2.11 | 2.16 | 0.35 | 0.35 | 2.07 | 2.07 | 2.07 | 1 |
| 中期 (3-7) | 64,481 | 107.75 | 108.06 | 5.20 | 2.03 | 0.47 | 0.49 | 4.96 | 4.95 | 4.96 | 0 |
| 長期 (7-) | 204,390 | 96.17 | 96.32 | 13.12 | 0.99 | 1.18 | 1.14 | 12.08 | 12.01 | 12.06 | 0 |
| 長期 (7-11) | 72,333 | 106.15 | 106.39 | 9.08 | 1.52 | 0.76 | 0.78 | 8.50 | 8.47 | 8.50 | 1 |
| 超長期 (11-) | 132,056 | 90.70 | 90.81 | 15.33 | 0.69 | 1.44 | 1.38 | 14.38 | 14.28 | 14.34 | 0 |
| 10年国債 | 289,388 | 98.41 | 98.45 | 5.45 | 0.22 | 0.53 | 0.53 | 5.37 | 5.36 | 5.37 | 0 |
| 短期 (1-3) | 68,153 | 99.49 | 99.51 | 2.09 | 0.12 | 0.35 | 0.35 | 2.08 | 2.08 | 2.08 | 1 |
| 中期 (3-7) | 128,973 | 98.01 | 98.03 | 5.09 | 0.10 | 0.49 | 0.48 | 5.06 | 5.05 | 5.06 | 0 |
| 長期 (7-) | 92,261 | 98.18 | 98.25 | 8.44 | 0.47 | 0.72 | 0.71 | 8.27 | 8.24 | 8.27 | -1 |
| 5年国債 | 117,055 | 99.42 | 99.45 | 2.94 | 0.16 | 0.39 | 0.39 | 2.93 | 2.92 | 2.93 | 0 |
| 短期 (1-3) | 63,127 | 99.32 | 99.32 | 2.10 | 0.03 | 0.35 | 0.35 | 2.10 | 2.10 | 2.10 | 1 |
| 中期 (3-7) | 53,928 | 99.54 | 99.59 | 3.92 | 0.31 | 0.44 | 0.43 | 3.90 | 3.89 | 3.90 | -1 |
| 中期国債 | 31,921 | 99.87 | 99.92 | 1.41 | 0.20 | 0.31 | 0.31 | 1.41 | 1.41 | 1.41 | 2 |
| 短期 (1-3) | 31,921 | 99.87 | 99.92 | 1.41 | 0.20 | 0.31 | 0.31 | 1.41 | 1.41 | 1.41 | 2 |
| 中期 (3-7) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 地方公共団体 | 57,067 | 97.83 | 97.94 | 7.15 | 0.58 | 0.76 | 0.78 | 6.65 | 6.62 | 6.63 | 10 |
| 短期 (1-3) | 11,202 | 99.80 | 99.85 | 2.01 | 0.34 | 0.44 | 0.44 | 2.01 | 2.00 | 2.01 | 10 |
| 中期 (3-7) | 21,073 | 99.34 | 99.43 | 4.90 | 0.45 | 0.57 | 0.57 | 4.84 | 4.83 | 4.84 | 10 |
| 長期 (7-) | 24,791 | 95.66 | 95.80 | 11.37 | 0.79 | 1.08 | 1.12 | 10.43 | 10.37 | 10.37 | 11 |
| 東京都債 | 4,604 | 99.06 | 99.13 | 7.21 | 0.70 | 0.77 | 0.76 | 6.62 | 6.59 | 6.61 | 10 |
| 短期 (1-3) | 960 | 99.85 | 99.88 | 2.01 | 0.36 | 0.44 | 0.44 | 2.00 | 2.00 | 2.00 | 10 |
| 中期 (3-7) | 1,980 | 99.44 | 99.49 | 5.01 | 0.50 | 0.58 | 0.58 | 4.94 | 4.93 | 4.94 | 10 |
| 長期 (7-) | 1,664 | 98.17 | 98.28 | 12.83 | 1.14 | 1.19 | 1.16 | 11.36 | 11.28 | 11.31 | 11 |
| 五大都市債 | 6,193 | 98.16 | 98.33 | 8.12 | 0.83 | 0.83 | 0.86 | 7.29 | 7.25 | 7.25 | 11 |
| 短期 (1-3) | 1,182 | 100.31 | 100.41 | 2.05 | 0.57 | 0.44 | 0.44 | 2.04 | 2.03 | 2.04 | 10 |
| 中期 (3-7) | 2,094 | 101.08 | 101.28 | 4.70 | 0.80 | 0.56 | 0.56 | 4.60 | 4.59 | 4.60 | 10 |
| 長期 (7-) | 2,916 | 95.19 | 95.38 | 13.04 | 0.96 | 1.20 | 1.27 | 11.59 | 11.51 | 11.50 | 12 |
| その他地方公共団体 | 46,270 | 97.66 | 97.77 | 7.01 | 0.53 | 0.75 | 0.77 | 6.57 | 6.53 | 6.54 | 10 |
| 短期 (1-3) | 9,060 | 99.73 | 99.78 | 2.01 | 0.30 | 0.44 | 0.44 | 2.00 | 2.00 | 2.00 | 10 |
| 中期 (3-7) | 16,999 | 99.11 | 99.20 | 4.92 | 0.41 | 0.58 | 0.57 | 4.86 | 4.85 | 4.86 | 10 |
| 長期 (7-) | 20,211 | 95.52 | 95.66 | 11.01 | 0.73 | 1.05 | 1.09 | 10.19 | 10.13 | 10.13 | 11 |
| その他地方債 | 9,883 | 97.28 | 97.33 | 8.49 | 0.80 | 0.92 | 0.90 | 7.65 | 7.61 | 7.63 | 16 |
| 短期 (1-3) | 1,590 | 100.32 | 100.39 | 2.00 | 0.63 | 0.49 | 0.49 | 1.99 | 1.99 | 1.99 | 15 |
| 中期 (3-7) | 3,497 | 100.34 | 100.40 | 5.07 | 0.74 | 0.64 | 0.64 | 4.98 | 4.96 | 4.98 | 16 |
| 長期 (7-) | 4,796 | 94.05 | 94.08 | 13.12 | 0.91 | 1.30 | 1.24 | 11.74 | 11.65 | 11.69 | 16 |
| 特定金融債 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 短期 (1-3) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中期 (3-7) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 政保地方公営企業債 | 1,515 | 99.11 | 99.11 | 2.90 | 0.16 | 0.45 | 0.44 | 2.89 | 2.89 | 2.89 | 6 |
| 短期 (1-3) | 785 | 99.42 | 99.42 | 2.06 | 0.15 | 0.40 | 0.40 | 2.06 | 2.05 | 2.06 | 7 |
| 中期 (3-7) | 730 | 98.78 | 98.79 | 3.81 | 0.18 | 0.49 | 0.49 | 3.80 | 3.79 | 3.80 | 5 |
| 長期 (7-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| その他政保債 | 12,706 | 96.42 | 96.63 | 10.04 | 0.80 | 0.95 | 0.92 | 8.65 | 8.59 | 8.61 | 7 |
| 短期 (1-3) | 2,521 | 99.59 | 99.64 | 1.97 | 0.20 | 0.40 | 0.40 | 1.96 | 1.96 | 1.96 | 7 |
| 中期 (3-7) | 3,577 | 101.06 | 101.25 | 4.58 | 0.71 | 0.52 | 0.53 | 4.51 | 4.49 | 4.51 | 6 |
| 長期 (7-) | 6,608 | 92.69 | 92.97 | 16.07 | 1.07 | 1.43 | 1.36 | 13.82 | 13.72 | 13.75 | 8 |
| SDGs | 18,378 | 97.31 | 97.44 | 7.25 | 0.57 | 0.90 | 0.88 | 6.58 | 6.54 | 6.56 | 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9月末、10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 | 184,921 | 92.89 | 93.07 | 20.72 | 1.46 | 1.70 | 1.62 | 17.23 | 17.09 | 17.08 | 2 |
| 短期(1-3) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中期(3-7) | 2,421 | 111.76 | 112.48 | 5.88 | 2.56 | 0.50 | 0.52 | 5.49 | 5.47 | 5.49 | 1 |
| 長期(7-) | 182,500 | 92.64 | 92.81 | 20.91 | 1.44 | 1.72 | 1.64 | 17.42 | 17.27 | 17.27 | 2 |
| 長期(7-11) | 14,507 | 112.25 | 112.65 | 9.39 | 2.17 | 0.78 | 0.82 | 8.57 | 8.53 | 8.56 | 2 |
| 超長期(11-) | 167,992 | 90.94 | 91.10 | 21.91 | 1.38 | 1.82 | 1.72 | 18.37 | 18.21 | 18.20 | 2 |
| 20年国債 | 296,540 | 99.40 | 99.60 | 10.43 | 1.32 | 0.94 | 0.92 | 9.48 | 9.43 | 9.47 | 0 |
| 短期(1-3) | 26,467 | 103.79 | 104.11 | 2.11 | 2.16 | 0.35 | 0.35 | 2.07 | 2.07 | 2.07 | 1 |
| 中期(3-7) | 64,588 | 107.75 | 108.06 | 5.20 | 2.03 | 0.47 | 0.49 | 4.96 | 4.95 | 4.96 | 0 |
| 長期(7-) | 205,485 | 96.21 | 96.36 | 13.15 | 0.99 | 1.18 | 1.15 | 12.11 | 12.04 | 12.08 | 0 |
| 長期(7-11) | 72,333 | 106.15 | 106.39 | 9.08 | 1.52 | 0.76 | 0.78 | 8.50 | 8.47 | 8.50 | 1 |
| 超長期(11-) | 133,152 | 90.81 | 90.92 | 15.36 | 0.70 | 1.44 | 1.38 | 14.40 | 14.30 | 14.36 | 0 |
| 10年国債 | 292,957 | 98.45 | 98.48 | 5.49 | 0.23 | 0.53 | 0.53 | 5.41 | 5.39 | 5.41 | 0 |
| 短期(1-3) | 68,154 | 99.49 | 99.51 | 2.09 | 0.12 | 0.35 | 0.35 | 2.08 | 2.08 | 2.08 | 1 |
| 中期(3-7) | 129,942 | 98.01 | 98.03 | 5.09 | 0.10 | 0.49 | 0.48 | 5.06 | 5.05 | 5.06 | 0 |
| 長期(7-) | 94,861 | 98.29 | 98.37 | 8.47 | 0.49 | 0.72 | 0.72 | 8.29 | 8.26 | 8.29 | -1 |
| 5年国債 | 119,586 | 99.43 | 99.46 | 2.98 | 0.17 | 0.39 | 0.39 | 2.97 | 2.96 | 2.97 | 0 |
| 短期(1-3) | 63,130 | 99.32 | 99.32 | 2.10 | 0.03 | 0.35 | 0.35 | 2.10 | 2.10 | 2.10 | 1 |
| 中期(3-7) | 56,456 | 99.56 | 99.62 | 3.96 | 0.32 | 0.44 | 0.44 | 3.93 | 3.92 | 3.93 | 0 |
| 中期国債 | 31,708 | 99.89 | 99.95 | 1.50 | 0.23 | 0.32 | 0.32 | 1.50 | 1.49 | 1.50 | 2 |
| 短期(1-3) | 31,708 | 99.89 | 99.95 | 1.50 | 0.23 | 0.32 | 0.32 | 1.50 | 1.49 | 1.50 | 2 |
| 中期(3-7) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 地方公共団体 | 57,065 | 97.83 | 97.94 | 7.21 | 0.58 | 0.77 | 0.78 | 6.71 | 6.67 | 6.68 | 10 |
| 短期(1-3) | 11,157 | 99.77 | 99.83 | 2.09 | 0.33 | 0.44 | 0.44 | 2.08 | 2.07 | 2.08 | 10 |
| 中期(3-7) | 21,225 | 99.30 | 99.39 | 4.98 | 0.46 | 0.58 | 0.58 | 4.92 | 4.90 | 4.92 | 10 |
| 長期(7-) | 24,682 | 95.68 | 95.83 | 11.44 | 0.80 | 1.08 | 1.13 | 10.49 | 10.42 | 10.43 | 11 |
| 東京都債 | 4,624 | 99.07 | 99.14 | 7.22 | 0.70 | 0.77 | 0.76 | 6.64 | 6.60 | 6.62 | 10 |
| 短期(1-3) | 960 | 99.85 | 99.88 | 2.01 | 0.36 | 0.44 | 0.44 | 2.00 | 2.00 | 2.00 | 10 |
| 中期(3-7) | 1,980 | 99.44 | 99.49 | 5.01 | 0.50 | 0.58 | 0.58 | 4.94 | 4.93 | 4.94 | 10 |
| 長期(7-) | 1,684 | 98.18 | 98.30 | 12.80 | 1.13 | 1.18 | 1.16 | 11.33 | 11.26 | 11.29 | 11 |
| 五大都市債 | 6,163 | 98.15 | 98.32 | 8.17 | 0.84 | 0.83 | 0.87 | 7.34 | 7.30 | 7.30 | 11 |
| 短期(1-3) | 1,182 | 100.27 | 100.37 | 2.15 | 0.57 | 0.45 | 0.45 | 2.13 | 2.13 | 2.13 | 10 |
| 中期(3-7) | 2,120 | 100.99 | 101.18 | 4.81 | 0.80 | 0.56 | 0.57 | 4.71 | 4.70 | 4.71 | 10 |
| 長期(7-) | 2,861 | 95.17 | 95.36 | 13.16 | 0.98 | 1.21 | 1.28 | 11.68 | 11.60 | 11.58 | 12 |
| その他地方公共団体 | 46,278 | 97.66 | 97.76 | 7.08 | 0.53 | 0.76 | 0.77 | 6.63 | 6.60 | 6.61 | 10 |
| 短期(1-3) | 9,016 | 99.70 | 99.75 | 2.09 | 0.30 | 0.44 | 0.44 | 2.08 | 2.07 | 2.08 | 10 |
| 中期(3-7) | 17,125 | 99.07 | 99.16 | 5.00 | 0.41 | 0.58 | 0.58 | 4.94 | 4.92 | 4.94 | 10 |
| 長期(7-) | 20,137 | 95.54 | 95.69 | 11.08 | 0.75 | 1.06 | 1.10 | 10.24 | 10.18 | 10.19 | 11 |
| その他地方債 | 9,888 | 97.28 | 97.33 | 8.51 | 0.80 | 0.93 | 0.90 | 7.68 | 7.63 | 7.66 | 16 |
| 短期(1-3) | 1,612 | 100.31 | 100.38 | 2.05 | 0.62 | 0.49 | 0.49 | 2.04 | 2.04 | 2.04 | 15 |
| 中期(3-7) | 3,522 | 100.34 | 100.40 | 5.14 | 0.74 | 0.65 | 0.65 | 5.05 | 5.03 | 5.05 | 16 |
| 長期(7-) | 4,755 | 93.99 | 94.02 | 13.20 | 0.91 | 1.30 | 1.25 | 11.80 | 11.72 | 11.76 | 16 |
| 特定金融債 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 短期(1-3) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中期(3-7) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 政保地方公営企業債 | 1,475 | 99.08 | 99.09 | 2.95 | 0.16 | 0.45 | 0.45 | 2.94 | 2.94 | 2.94 | 6 |
| 短期(1-3) | 795 | 99.37 | 99.37 | 2.18 | 0.14 | 0.41 | 0.41 | 2.17 | 2.17 | 2.17 | 7 |
| 中期(3-7) | 680 | 98.76 | 98.76 | 3.87 | 0.18 | 0.49 | 0.49 | 3.85 | 3.84 | 3.85 | 5 |
| 長期(7-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| その他政保債 | 12,723 | 96.42 | 96.63 | 10.12 | 0.80 | 0.96 | 0.92 | 8.72 | 8.66 | 8.69 | 7 |
| 短期(1-3) | 2,576 | 99.62 | 99.67 | 2.07 | 0.21 | 0.41 | 0.41 | 2.06 | 2.06 | 2.06 | 7 |
| 中期(3-7) | 3,492 | 101.13 | 101.33 | 4.69 | 0.73 | 0.53 | 0.53 | 4.61 | 4.60 | 4.61 | 6 |
| 長期(7-) | 6,655 | 92.71 | 92.99 | 16.07 | 1.07 | 1.43 | 1.36 | 13.83 | 13.73 | 13.77 | 8 |
| SDGs | 18,772 | 97.37 | 97.49 | 7.30 | 0.59 | 0.91 | 0.89 | 6.63 | 6.59 | 6.61 | 23 |

出所:NFRC

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

事業債 業種別・ポートフォリオ指標 (1/4) (2024年9月末)

| | 額面 (10億円) | 時価単価 (円) | 利含単価 (円) | 残存年数 (年) | 利率 (%) | 単利 (%) | 複利 (%) | Dur (年) | M-Dur | E-Dur | Tspd (bp) |
|-----------|--------------|-------------|-------------|-------------|-----------|-----------|-----------|------------|-------|-------|--------------|
| 事業債 全体 | 70,303 | 96.44 | 96.60 | 7.44 | 0.74 | 1.07 | 1.04 | 6.38 | 6.34 | 6.35 | 39 |
| 短期 (1-3) | 20,897 | 99.56 | 99.66 | 2.00 | 0.46 | 0.68 | 0.68 | 1.99 | 1.98 | 1.99 | 35 |
| 中期 (3-7) | 25,824 | 99.18 | 99.33 | 4.70 | 0.69 | 0.86 | 0.85 | 4.61 | 4.59 | 4.61 | 38 |
| 長期 (7-) | 23,582 | 90.67 | 90.90 | 15.27 | 1.05 | 1.70 | 1.60 | 12.77 | 12.66 | 12.68 | 43 |
| 長期 (7-11) | 10,219 | 98.64 | 98.89 | 8.65 | 1.03 | 1.22 | 1.21 | 8.26 | 8.21 | 8.26 | 47 |
| 超長期 (11-) | 13,363 | 84.57 | 84.80 | 20.33 | 1.07 | 2.13 | 1.96 | 16.80 | 16.63 | 16.62 | 39 |
| 水産・農林業 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 短期 (1-3) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中期 (3-7) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 長期 (7-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 長期 (7-11) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 超長期 (11-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 鉱業 | 30 | 96.99 | 97.03 | 4.98 | 0.21 | 0.81 | 0.80 | 4.90 | 4.88 | 4.90 | 33 |
| 短期 (1-3) | 10 | 99.27 | 99.27 | 1.46 | 0.08 | 0.59 | 0.58 | 1.46 | 1.45 | 1.46 | 29 |
| 中期 (3-7) | 10 | 96.34 | 96.35 | 6.45 | 0.30 | 0.90 | 0.89 | 6.39 | 6.37 | 6.39 | 35 |
| 長期 (7-) | 10 | 95.35 | 95.46 | 7.04 | 0.25 | 0.96 | 0.93 | 6.97 | 6.94 | 6.97 | 36 |
| 長期 (7-11) | 10 | 95.35 | 95.46 | 7.04 | 0.25 | 0.96 | 0.93 | 6.97 | 6.94 | 6.97 | 36 |
| 超長期 (11-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 建設業 | 1,167 | 98.08 | 98.19 | 4.41 | 0.46 | 0.84 | 0.83 | 4.25 | 4.23 | 4.25 | 36 |
| 短期 (1-3) | 381 | 99.18 | 99.24 | 2.08 | 0.27 | 0.67 | 0.67 | 2.08 | 2.07 | 2.08 | 33 |
| 中期 (3-7) | 636 | 98.58 | 98.69 | 4.31 | 0.51 | 0.82 | 0.82 | 4.25 | 4.23 | 4.25 | 36 |
| 長期 (7-) | 150 | 93.19 | 93.40 | 10.75 | 0.75 | 1.41 | 1.35 | 10.12 | 10.05 | 10.11 | 42 |
| 長期 (7-11) | 84 | 97.30 | 97.51 | 8.28 | 0.78 | 1.15 | 1.13 | 8.01 | 7.97 | 8.01 | 43 |
| 超長期 (11-) | 66 | 87.96 | 88.17 | 13.89 | 0.71 | 1.77 | 1.66 | 13.09 | 12.98 | 13.07 | 41 |
| 食料品 | 1,408 | 98.12 | 98.24 | 4.87 | 0.47 | 0.85 | 0.84 | 4.65 | 4.62 | 4.64 | 33 |
| 短期 (1-3) | 578 | 99.26 | 99.32 | 1.99 | 0.25 | 0.62 | 0.62 | 1.99 | 1.98 | 1.99 | 28 |
| 中期 (3-7) | 510 | 98.46 | 98.57 | 4.50 | 0.46 | 0.82 | 0.81 | 4.45 | 4.43 | 4.45 | 35 |
| 長期 (7-) | 320 | 95.51 | 95.76 | 10.66 | 0.91 | 1.34 | 1.30 | 9.96 | 9.89 | 9.94 | 38 |
| 長期 (7-11) | 200 | 98.58 | 98.87 | 8.60 | 0.90 | 1.10 | 1.09 | 8.26 | 8.22 | 8.26 | 36 |
| 超長期 (11-) | 120 | 90.40 | 90.57 | 14.08 | 0.92 | 1.78 | 1.69 | 13.04 | 12.93 | 13.01 | 43 |
| 繊維製品 | 225 | 98.09 | 98.22 | 4.85 | 0.53 | 0.89 | 0.88 | 4.64 | 4.61 | 4.64 | 37 |
| 短期 (1-3) | 80 | 99.16 | 99.22 | 2.59 | 0.33 | 0.67 | 0.67 | 2.58 | 2.57 | 2.58 | 29 |
| 中期 (3-7) | 109 | 98.76 | 98.88 | 4.24 | 0.52 | 0.83 | 0.83 | 4.19 | 4.17 | 4.19 | 38 |
| 長期 (7-) | 36 | 93.68 | 93.98 | 11.73 | 1.03 | 1.59 | 1.53 | 10.90 | 10.82 | 10.89 | 50 |
| 長期 (7-11) | 16 | 100.21 | 100.67 | 9.15 | 1.29 | 1.27 | 1.27 | 8.62 | 8.57 | 8.62 | 48 |
| 超長期 (11-) | 20 | 88.45 | 88.62 | 13.79 | 0.83 | 1.89 | 1.78 | 12.98 | 12.86 | 12.95 | 52 |
| パルプ・紙 | 340 | 96.95 | 97.08 | 4.88 | 0.45 | 1.01 | 0.99 | 4.61 | 4.58 | 4.61 | 48 |
| 短期 (1-3) | 140 | 99.05 | 99.15 | 1.87 | 0.31 | 0.81 | 0.81 | 1.86 | 1.85 | 1.86 | 48 |
| 中期 (3-7) | 145 | 97.22 | 97.32 | 4.92 | 0.43 | 0.96 | 0.95 | 4.85 | 4.82 | 4.85 | 47 |
| 長期 (7-) | 55 | 90.93 | 91.16 | 12.47 | 0.86 | 1.70 | 1.62 | 11.56 | 11.47 | 11.54 | 52 |
| 長期 (7-11) | 20 | 96.89 | 97.14 | 8.21 | 0.83 | 1.29 | 1.27 | 7.91 | 7.86 | 7.91 | 58 |
| 超長期 (11-) | 35 | 87.52 | 87.74 | 14.90 | 0.88 | 1.96 | 1.83 | 13.87 | 13.75 | 13.84 | 48 |
| 化学 | 2,321 | 96.54 | 96.68 | 5.59 | 0.52 | 1.02 | 0.99 | 5.21 | 5.17 | 5.20 | 44 |
| 短期 (1-3) | 705 | 99.24 | 99.32 | 2.12 | 0.32 | 0.69 | 0.68 | 2.11 | 2.10 | 2.11 | 34 |
| 中期 (3-7) | 1,018 | 98.25 | 98.38 | 4.63 | 0.50 | 0.88 | 0.87 | 4.57 | 4.55 | 4.57 | 40 |
| 長期 (7-) | 598 | 90.43 | 90.65 | 11.29 | 0.79 | 1.71 | 1.61 | 10.38 | 10.29 | 10.36 | 65 |
| 長期 (7-11) | 325 | 96.66 | 96.85 | 8.06 | 0.76 | 1.25 | 1.23 | 7.81 | 7.76 | 7.81 | 55 |
| 超長期 (11-) | 273 | 83.02 | 83.26 | 15.14 | 0.83 | 2.34 | 2.13 | 13.93 | 13.78 | 13.89 | 78 |
| 医薬品 | 725 | 96.51 | 96.62 | 6.03 | 0.50 | 0.99 | 0.97 | 5.67 | 5.64 | 5.66 | 40 |
| 短期 (1-3) | 175 | 99.47 | 99.51 | 1.77 | 0.30 | 0.60 | 0.60 | 1.77 | 1.76 | 1.77 | 28 |
| 中期 (3-7) | 185 | 99.16 | 99.23 | 4.07 | 0.56 | 0.78 | 0.77 | 4.03 | 4.01 | 4.03 | 33 |
| 長期 (7-) | 365 | 93.75 | 93.92 | 9.07 | 0.56 | 1.31 | 1.26 | 8.53 | 8.48 | 8.52 | 51 |
| 長期 (7-11) | 265 | 95.43 | 95.61 | 7.09 | 0.43 | 1.13 | 1.10 | 6.97 | 6.93 | 6.97 | 52 |
| 超長期 (11-) | 100 | 89.29 | 89.46 | 14.32 | 0.91 | 1.82 | 1.71 | 12.96 | 12.84 | 12.91 | 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9月末、10月ポートフォリオ)

| | 額面 (10億円) | 時価単価 (円) | 利含単価 (円) | 残存年数 (年) | 利率 (%) | 単利 (%) | 複利 (%) | Dur (年) | M-Dur | E-Dur | Tspd (bp) |
|-----------|--------------|-------------|-------------|-------------|-----------|-----------|-----------|------------|-------|-------|--------------|
| 事業債 全体 | 70,172 | 96.43 | 96.60 | 7.49 | 0.75 | 1.08 | 1.04 | 6.43 | 6.39 | 6.40 | 39 |
| 短期 (1-3) | 20,867 | 99.57 | 99.67 | 2.06 | 0.47 | 0.69 | 0.69 | 2.05 | 2.04 | 2.05 | 35 |
| 中期 (3-7) | 26,117 | 99.10 | 99.25 | 4.78 | 0.69 | 0.86 | 0.86 | 4.70 | 4.68 | 4.70 | 39 |
| 長期 (7-) | 23,188 | 90.61 | 90.85 | 15.44 | 1.07 | 1.72 | 1.62 | 12.90 | 12.79 | 12.80 | 43 |
| 長期 (7-11) | 9,838 | 98.78 | 99.04 | 8.76 | 1.06 | 1.23 | 1.22 | 8.35 | 8.30 | 8.35 | 47 |
| 超長期 (11-) | 13,350 | 84.59 | 84.81 | 20.36 | 1.07 | 2.13 | 1.96 | 16.82 | 16.65 | 16.64 | 39 |
| 水産・農林業 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 短期 (1-3) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中期 (3-7) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 長期 (7-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 長期 (7-11) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 超長期 (11-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 鉱業 | 30 | 96.99 | 97.03 | 4.98 | 0.21 | 0.81 | 0.80 | 4.90 | 4.88 | 4.90 | 33 |
| 短期 (1-3) | 10 | 99.27 | 99.27 | 1.46 | 0.08 | 0.59 | 0.58 | 1.46 | 1.45 | 1.46 | 29 |
| 中期 (3-7) | 20 | 95.84 | 95.91 | 6.75 | 0.28 | 0.93 | 0.91 | 6.68 | 6.65 | 6.68 | 35 |
| 長期 (7-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 長期 (7-11) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 超長期 (11-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 建設業 | 1,137 | 98.04 | 98.15 | 4.50 | 0.47 | 0.85 | 0.84 | 4.34 | 4.31 | 4.33 | 36 |
| 短期 (1-3) | 451 | 99.22 | 99.31 | 2.37 | 0.33 | 0.68 | 0.68 | 2.36 | 2.35 | 2.36 | 32 |
| 中期 (3-7) | 536 | 98.39 | 98.51 | 4.54 | 0.50 | 0.85 | 0.84 | 4.48 | 4.46 | 4.48 | 38 |
| 長期 (7-) | 150 | 93.19 | 93.40 | 10.75 | 0.75 | 1.41 | 1.35 | 10.12 | 10.05 | 10.11 | 42 |
| 長期 (7-11) | 84 | 97.30 | 97.51 | 8.28 | 0.78 | 1.15 | 1.13 | 8.01 | 7.97 | 8.01 | 43 |
| 超長期 (11-) | 66 | 87.96 | 88.17 | 13.89 | 0.71 | 1.77 | 1.66 | 13.09 | 12.98 | 13.07 | 41 |
| 食料品 | 1,398 | 98.11 | 98.23 | 4.90 | 0.48 | 0.85 | 0.84 | 4.67 | 4.65 | 4.67 | 33 |
| 短期 (1-3) | 568 | 99.26 | 99.31 | 2.01 | 0.25 | 0.62 | 0.62 | 2.00 | 2.00 | 2.00 | 28 |
| 中期 (3-7) | 510 | 98.46 | 98.57 | 4.50 | 0.46 | 0.82 | 0.81 | 4.45 | 4.43 | 4.45 | 35 |
| 長期 (7-) | 320 | 95.51 | 95.76 | 10.66 | 0.91 | 1.34 | 1.30 | 9.96 | 9.89 | 9.94 | 38 |
| 長期 (7-11) | 200 | 98.58 | 98.87 | 8.60 | 0.90 | 1.10 | 1.09 | 8.26 | 8.22 | 8.26 | 36 |
| 超長期 (11-) | 120 | 90.40 | 90.57 | 14.08 | 0.92 | 1.78 | 1.69 | 13.04 | 12.93 | 13.01 | 43 |
| 繊維製品 | 225 | 98.09 | 98.22 | 4.85 | 0.53 | 0.89 | 0.88 | 4.64 | 4.61 | 4.64 | 37 |
| 短期 (1-3) | 80 | 99.16 | 99.22 | 2.59 | 0.33 | 0.67 | 0.67 | 2.58 | 2.57 | 2.58 | 29 |
| 中期 (3-7) | 109 | 98.76 | 98.88 | 4.24 | 0.52 | 0.83 | 0.83 | 4.19 | 4.17 | 4.19 | 38 |
| 長期 (7-) | 36 | 93.68 | 93.98 | 11.73 | 1.03 | 1.59 | 1.53 | 10.90 | 10.82 | 10.89 | 50 |
| 長期 (7-11) | 16 | 100.21 | 100.67 | 9.15 | 1.29 | 1.27 | 1.27 | 8.62 | 8.57 | 8.62 | 48 |
| 超長期 (11-) | 20 | 88.45 | 88.62 | 13.79 | 0.83 | 1.89 | 1.78 | 12.98 | 12.86 | 12.95 | 52 |
| パルプ・紙 | 325 | 96.82 | 96.94 | 5.06 | 0.44 | 1.02 | 1.00 | 4.78 | 4.75 | 4.78 | 48 |
| 短期 (1-3) | 125 | 98.96 | 99.03 | 1.96 | 0.28 | 0.82 | 0.81 | 1.96 | 1.95 | 1.96 | 48 |
| 中期 (3-7) | 145 | 97.22 | 97.32 | 4.92 | 0.43 | 0.96 | 0.95 | 4.85 | 4.82 | 4.85 | 47 |
| 長期 (7-) | 55 | 90.93 | 91.16 | 12.47 | 0.86 | 1.70 | 1.62 | 11.56 | 11.47 | 11.54 | 52 |
| 長期 (7-11) | 20 | 96.89 | 97.14 | 8.21 | 0.83 | 1.29 | 1.27 | 7.91 | 7.86 | 7.91 | 58 |
| 超長期 (11-) | 35 | 87.52 | 87.74 | 14.90 | 0.88 | 1.96 | 1.83 | 13.87 | 13.75 | 13.84 | 48 |
| 化学 | 2,401 | 96.66 | 96.80 | 5.54 | 0.53 | 1.01 | 0.98 | 5.17 | 5.13 | 5.16 | 44 |
| 短期 (1-3) | 740 | 99.28 | 99.36 | 2.16 | 0.34 | 0.69 | 0.68 | 2.15 | 2.14 | 2.15 | 34 |
| 中期 (3-7) | 1,093 | 98.23 | 98.36 | 4.72 | 0.51 | 0.88 | 0.88 | 4.65 | 4.63 | 4.65 | 41 |
| 長期 (7-) | 568 | 90.25 | 90.47 | 11.52 | 0.82 | 1.73 | 1.63 | 10.57 | 10.47 | 10.55 | 65 |
| 長期 (7-11) | 295 | 96.94 | 97.14 | 8.17 | 0.81 | 1.25 | 1.24 | 7.90 | 7.85 | 7.89 | 55 |
| 超長期 (11-) | 273 | 83.02 | 83.26 | 15.14 | 0.83 | 2.34 | 2.13 | 13.93 | 13.78 | 13.89 | 78 |
| 医薬品 | 725 | 96.51 | 96.62 | 6.03 | 0.50 | 0.99 | 0.97 | 5.67 | 5.64 | 5.66 | 40 |
| 短期 (1-3) | 175 | 99.47 | 99.51 | 1.77 | 0.30 | 0.60 | 0.60 | 1.77 | 1.76 | 1.77 | 28 |
| 中期 (3-7) | 435 | 96.94 | 97.08 | 5.78 | 0.47 | 0.97 | 0.96 | 5.67 | 5.64 | 5.67 | 43 |
| 長期 (7-) | 115 | 90.37 | 90.52 | 13.48 | 0.91 | 1.74 | 1.65 | 12.21 | 12.11 | 12.17 | 49 |
| 長期 (7-11) | 15 | 97.51 | 97.56 | 7.94 | 0.93 | 1.28 | 1.26 | 7.66 | 7.62 | 7.66 | 60 |
| 超長期 (11-) | 100 | 89.29 | 89.46 | 14.32 | 0.91 | 1.82 | 1.71 | 12.96 | 12.84 | 12.91 | 48 |

出所:NFRG

- 東証 33 業種分類を参考に NFRG で分類

事業債 業種別・ポートフォリオ指標 (2/4) (2024年9月末)

| | 額面 (10億円) | 時価単価 (円) | 利含単価 (円) | 残存年数 (年) | 利率 (%) | 単利 (%) | 複利 (%) | Dur (年) | M-Dur | E-Dur | Tspd (bp) |
|-----------|--------------|-------------|-------------|-------------|-----------|-----------|-----------|------------|-------|-------|--------------|
| 石油・石炭製品 | 265 | 96.73 | 96.87 | 6.62 | 0.60 | 1.10 | 1.08 | 6.28 | 6.24 | 6.27 | 48 |
| 短期 (1-3) | 50 | 99.12 | 99.17 | 2.24 | 0.30 | 0.72 | 0.71 | 2.23 | 2.23 | 2.23 | 36 |
| 中期 (3-7) | 95 | 96.90 | 96.97 | 5.52 | 0.39 | 0.96 | 0.94 | 5.44 | 5.42 | 5.44 | 44 |
| 長期 (7-) | 120 | 95.59 | 95.84 | 9.31 | 0.90 | 1.38 | 1.35 | 8.69 | 8.63 | 8.68 | 57 |
| 長期 (7-11) | 95 | 97.38 | 97.62 | 7.72 | 0.84 | 1.21 | 1.19 | 7.47 | 7.42 | 7.46 | 56 |
| 超長期 (11-) | 25 | 88.78 | 89.07 | 15.35 | 1.13 | 2.11 | 1.99 | 13.81 | 13.67 | 13.75 | 64 |
| ゴム製品 | 330 | 98.45 | 98.57 | 3.78 | 0.39 | 0.80 | 0.79 | 3.72 | 3.70 | 3.72 | 36 |
| 短期 (1-3) | 158 | 99.19 | 99.28 | 2.20 | 0.30 | 0.68 | 0.68 | 2.19 | 2.18 | 2.19 | 33 |
| 中期 (3-7) | 147 | 97.94 | 98.08 | 4.76 | 0.41 | 0.86 | 0.85 | 4.70 | 4.68 | 4.70 | 38 |
| 長期 (7-) | 25 | 96.85 | 96.98 | 8.00 | 0.76 | 1.20 | 1.19 | 7.75 | 7.71 | 7.75 | 52 |
| 長期 (7-11) | 25 | 96.85 | 96.98 | 8.00 | 0.76 | 1.20 | 1.19 | 7.75 | 7.71 | 7.75 | 52 |
| 超長期 (11-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| ガラス・土石製品 | 277 | 97.02 | 97.14 | 5.19 | 0.49 | 0.96 | 0.94 | 4.87 | 4.84 | 4.86 | 41 |
| 短期 (1-3) | 98 | 99.36 | 99.44 | 1.76 | 0.26 | 0.62 | 0.62 | 1.75 | 1.75 | 1.75 | 31 |
| 中期 (3-7) | 102 | 98.11 | 98.22 | 4.36 | 0.46 | 0.90 | 0.89 | 4.31 | 4.29 | 4.31 | 43 |
| 長期 (7-) | 77 | 92.63 | 92.79 | 10.61 | 0.81 | 1.50 | 1.43 | 9.87 | 9.79 | 9.86 | 53 |
| 長期 (7-11) | 52 | 97.26 | 97.45 | 8.46 | 0.82 | 1.18 | 1.17 | 8.17 | 8.13 | 8.17 | 45 |
| 超長期 (11-) | 25 | 82.94 | 83.04 | 15.09 | 0.80 | 2.29 | 2.09 | 14.04 | 13.89 | 14.00 | 73 |
| 鉄鋼 | 445 | 98.57 | 98.68 | 4.18 | 0.52 | 0.88 | 0.87 | 4.06 | 4.04 | 4.06 | 41 |
| 短期 (1-3) | 160 | 99.15 | 99.21 | 2.06 | 0.28 | 0.70 | 0.70 | 2.06 | 2.05 | 2.06 | 36 |
| 中期 (3-7) | 232 | 98.56 | 98.69 | 4.39 | 0.56 | 0.88 | 0.87 | 4.33 | 4.32 | 4.33 | 41 |
| 長期 (7-) | 53 | 96.82 | 97.06 | 9.62 | 1.09 | 1.40 | 1.38 | 9.03 | 8.97 | 9.02 | 55 |
| 長期 (7-11) | 43 | 98.97 | 99.20 | 8.67 | 1.12 | 1.26 | 1.25 | 8.26 | 8.21 | 8.26 | 51 |
| 超長期 (11-) | 10 | 87.58 | 87.86 | 13.70 | 0.95 | 2.12 | 1.99 | 12.77 | 12.64 | 12.74 | 74 |
| 非鉄金属 | 375 | 98.46 | 98.58 | 4.27 | 0.46 | 0.86 | 0.86 | 4.19 | 4.17 | 4.19 | 39 |
| 短期 (1-3) | 140 | 99.02 | 99.06 | 2.16 | 0.27 | 0.75 | 0.74 | 2.16 | 2.15 | 2.16 | 39 |
| 中期 (3-7) | 185 | 98.23 | 98.39 | 4.65 | 0.51 | 0.89 | 0.88 | 4.58 | 4.56 | 4.58 | 41 |
| 長期 (7-) | 50 | 97.79 | 97.96 | 8.78 | 0.81 | 1.09 | 1.07 | 8.48 | 8.43 | 8.48 | 32 |
| 長期 (7-11) | 50 | 97.79 | 97.96 | 8.78 | 0.81 | 1.09 | 1.07 | 8.48 | 8.43 | 8.48 | 32 |
| 超長期 (11-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 金属製品 | 186 | 98.88 | 98.99 | 3.87 | 0.54 | 0.86 | 0.85 | 3.81 | 3.80 | 3.81 | 42 |
| 短期 (1-3) | 75 | 99.07 | 99.12 | 2.39 | 0.36 | 0.77 | 0.77 | 2.38 | 2.37 | 2.38 | 41 |
| 中期 (3-7) | 102 | 98.94 | 99.11 | 4.61 | 0.66 | 0.89 | 0.89 | 4.53 | 4.51 | 4.53 | 42 |
| 長期 (7-) | 9 | 96.45 | 96.51 | 7.91 | 0.70 | 1.20 | 1.18 | 7.70 | 7.65 | 7.69 | 52 |
| 長期 (7-11) | 9 | 96.45 | 96.51 | 7.91 | 0.70 | 1.20 | 1.18 | 7.70 | 7.65 | 7.69 | 52 |
| 超長期 (11-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 機械 | 1,317 | 98.45 | 98.57 | 4.43 | 0.46 | 0.84 | 0.84 | 4.34 | 4.32 | 4.34 | 37 |
| 短期 (1-3) | 495 | 99.18 | 99.24 | 2.14 | 0.29 | 0.68 | 0.68 | 2.13 | 2.12 | 2.13 | 34 |
| 中期 (3-7) | 595 | 98.09 | 98.21 | 4.83 | 0.48 | 0.87 | 0.86 | 4.76 | 4.74 | 4.76 | 39 |
| 長期 (7-) | 227 | 97.84 | 98.04 | 8.38 | 0.82 | 1.13 | 1.12 | 8.09 | 8.04 | 8.09 | 41 |
| 長期 (7-11) | 227 | 97.84 | 98.04 | 8.38 | 0.82 | 1.13 | 1.12 | 8.09 | 8.04 | 8.09 | 41 |
| 超長期 (11-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 電気機器 | 2,065 | 98.81 | 98.90 | 4.18 | 0.52 | 0.83 | 0.83 | 4.09 | 4.07 | 4.09 | 38 |
| 短期 (1-3) | 750 | 99.34 | 99.39 | 2.02 | 0.33 | 0.66 | 0.66 | 2.01 | 2.00 | 2.01 | 33 |
| 中期 (3-7) | 1,040 | 98.48 | 98.58 | 4.55 | 0.52 | 0.86 | 0.85 | 4.49 | 4.47 | 4.49 | 39 |
| 長期 (7-) | 275 | 98.61 | 98.76 | 8.66 | 1.02 | 1.22 | 1.21 | 8.29 | 8.24 | 8.29 | 47 |
| 長期 (7-11) | 275 | 98.61 | 98.76 | 8.66 | 1.02 | 1.22 | 1.21 | 8.29 | 8.24 | 8.29 | 47 |
| 超長期 (11-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 輸送用機器 | 1,107 | 97.78 | 97.87 | 4.47 | 0.42 | 0.88 | 0.87 | 4.28 | 4.26 | 4.28 | 39 |
| 短期 (1-3) | 525 | 99.10 | 99.15 | 1.99 | 0.26 | 0.72 | 0.72 | 1.98 | 1.97 | 1.98 | 38 |
| 中期 (3-7) | 373 | 98.21 | 98.30 | 4.65 | 0.47 | 0.84 | 0.84 | 4.59 | 4.57 | 4.59 | 37 |
| 長期 (7-) | 209 | 93.70 | 93.90 | 10.36 | 0.76 | 1.39 | 1.34 | 9.81 | 9.75 | 9.81 | 44 |
| 長期 (7-11) | 119 | 97.79 | 98.05 | 8.48 | 0.82 | 1.13 | 1.12 | 8.18 | 8.13 | 8.17 | 40 |
| 超長期 (11-) | 90 | 88.28 | 88.41 | 12.85 | 0.67 | 1.78 | 1.68 | 12.22 | 12.11 | 12.20 | 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 (2/4) (2024年9月末、10月ポートフォリオ)

| | 額面 (10億円) | 時価単価 (円) | 利含単価 (円) | 残存年数 (年) | 利率 (%) | 単利 (%) | 複利 (%) | Dur (年) | M-Dur | E-Dur | Tspd (bp) |
|-----------|--------------|-------------|-------------|-------------|-----------|-----------|-----------|------------|-------|-------|--------------|
| 石油・石炭製品 | 265 | 96.73 | 96.87 | 6.62 | 0.60 | 1.10 | 1.08 | 6.28 | 6.24 | 6.27 | 48 |
| 短期 (1-3) | 50 | 99.12 | 99.17 | 2.24 | 0.30 | 0.72 | 0.71 | 2.23 | 2.23 | 2.23 | 36 |
| 中期 (3-7) | 95 | 96.90 | 96.97 | 5.52 | 0.39 | 0.96 | 0.94 | 5.44 | 5.42 | 5.44 | 44 |
| 長期 (7-) | 120 | 95.59 | 95.84 | 9.31 | 0.90 | 1.38 | 1.35 | 8.69 | 8.63 | 8.68 | 57 |
| 長期 (7-11) | 95 | 97.38 | 97.62 | 7.72 | 0.84 | 1.21 | 1.19 | 7.47 | 7.42 | 7.46 | 56 |
| 超長期 (11-) | 25 | 88.78 | 89.07 | 15.35 | 1.13 | 2.11 | 1.99 | 13.81 | 13.67 | 13.75 | 64 |
| ゴム製品 | 330 | 98.45 | 98.57 | 3.78 | 0.39 | 0.80 | 0.79 | 3.72 | 3.70 | 3.72 | 36 |
| 短期 (1-3) | 158 | 99.19 | 99.28 | 2.20 | 0.30 | 0.68 | 0.68 | 2.19 | 2.18 | 2.19 | 33 |
| 中期 (3-7) | 147 | 97.94 | 98.08 | 4.76 | 0.41 | 0.86 | 0.85 | 4.70 | 4.68 | 4.70 | 38 |
| 長期 (7-) | 25 | 96.85 | 96.98 | 8.00 | 0.76 | 1.20 | 1.19 | 7.75 | 7.71 | 7.75 | 52 |
| 長期 (7-11) | 25 | 96.85 | 96.98 | 8.00 | 0.76 | 1.20 | 1.19 | 7.75 | 7.71 | 7.75 | 52 |
| 超長期 (11-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| ガラス・土石製品 | 257 | 96.81 | 96.92 | 5.51 | 0.51 | 1.00 | 0.97 | 5.18 | 5.14 | 5.17 | 43 |
| 短期 (1-3) | 78 | 99.26 | 99.33 | 1.95 | 0.26 | 0.66 | 0.66 | 1.94 | 1.94 | 1.94 | 33 |
| 中期 (3-7) | 102 | 98.11 | 98.22 | 4.36 | 0.46 | 0.90 | 0.89 | 4.31 | 4.29 | 4.31 | 43 |
| 長期 (7-) | 77 | 92.63 | 92.79 | 10.61 | 0.81 | 1.50 | 1.43 | 9.87 | 9.79 | 9.86 | 53 |
| 長期 (7-11) | 52 | 97.26 | 97.45 | 8.46 | 0.82 | 1.18 | 1.17 | 8.17 | 8.13 | 8.17 | 45 |
| 超長期 (11-) | 25 | 82.94 | 83.04 | 15.09 | 0.80 | 2.29 | 2.09 | 14.04 | 13.89 | 14.00 | 73 |
| 鉄鋼 | 445 | 98.57 | 98.68 | 4.18 | 0.52 | 0.88 | 0.87 | 4.06 | 4.04 | 4.06 | 41 |
| 短期 (1-3) | 160 | 99.15 | 99.21 | 2.06 | 0.28 | 0.70 | 0.70 | 2.06 | 2.05 | 2.06 | 36 |
| 中期 (3-7) | 232 | 98.56 | 98.69 | 4.39 | 0.56 | 0.88 | 0.87 | 4.33 | 4.32 | 4.33 | 41 |
| 長期 (7-) | 53 | 96.82 | 97.06 | 9.62 | 1.09 | 1.40 | 1.38 | 9.03 | 8.97 | 9.02 | 55 |
| 長期 (7-11) | 43 | 98.97 | 99.20 | 8.67 | 1.12 | 1.26 | 1.25 | 8.26 | 8.21 | 8.26 | 51 |
| 超長期 (11-) | 10 | 87.58 | 87.86 | 13.70 | 0.95 | 2.12 | 1.99 | 12.77 | 12.64 | 12.74 | 74 |
| 非鉄金属 | 375 | 98.46 | 98.58 | 4.27 | 0.46 | 0.86 | 0.86 | 4.19 | 4.17 | 4.19 | 39 |
| 短期 (1-3) | 155 | 98.99 | 99.05 | 2.25 | 0.28 | 0.75 | 0.74 | 2.24 | 2.23 | 2.24 | 39 |
| 中期 (3-7) | 170 | 98.18 | 98.35 | 4.79 | 0.53 | 0.90 | 0.89 | 4.72 | 4.70 | 4.72 | 42 |
| 長期 (7-) | 50 | 97.79 | 97.96 | 8.78 | 0.81 | 1.09 | 1.07 | 8.48 | 8.43 | 8.48 | 32 |
| 長期 (7-11) | 50 | 97.79 | 97.96 | 8.78 | 0.81 | 1.09 | 1.07 | 8.48 | 8.43 | 8.48 | 32 |
| 超長期 (11-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 金属製品 | 186 | 98.88 | 98.99 | 3.87 | 0.54 | 0.86 | 0.85 | 3.81 | 3.80 | 3.81 | 42 |
| 短期 (1-3) | 75 | 99.07 | 99.12 | 2.39 | 0.36 | 0.77 | 0.77 | 2.38 | 2.37 | 2.38 | 41 |
| 中期 (3-7) | 102 | 98.94 | 99.11 | 4.61 | 0.66 | 0.89 | 0.89 | 4.53 | 4.51 | 4.53 | 42 |
| 長期 (7-) | 9 | 96.45 | 96.51 | 7.91 | 0.70 | 1.20 | 1.18 | 7.70 | 7.65 | 7.69 | 52 |
| 長期 (7-11) | 9 | 96.45 | 96.51 | 7.91 | 0.70 | 1.20 | 1.18 | 7.70 | 7.65 | 7.69 | 52 |
| 超長期 (11-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 機械 | 1,292 | 98.43 | 98.54 | 4.50 | 0.47 | 0.85 | 0.84 | 4.40 | 4.38 | 4.40 | 37 |
| 短期 (1-3) | 485 | 99.14 | 99.21 | 2.22 | 0.29 | 0.69 | 0.69 | 2.21 | 2.20 | 2.21 | 34 |
| 中期 (3-7) | 580 | 98.07 | 98.19 | 4.88 | 0.48 | 0.87 | 0.87 | 4.81 | 4.79 | 4.81 | 39 |
| 長期 (7-) | 227 | 97.84 | 98.04 | 8.38 | 0.82 | 1.13 | 1.12 | 8.09 | 8.04 | 8.09 | 41 |
| 長期 (7-11) | 227 | 97.84 | 98.04 | 8.38 | 0.82 | 1.13 | 1.12 | 8.09 | 8.04 | 8.09 | 41 |
| 超長期 (11-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 電気機器 | 2,065 | 98.81 | 98.90 | 4.18 | 0.52 | 0.83 | 0.83 | 4.09 | 4.07 | 4.09 | 38 |
| 短期 (1-3) | 750 | 99.34 | 99.39 | 2.02 | 0.33 | 0.66 | 0.66 | 2.01 | 2.00 | 2.01 | 33 |
| 中期 (3-7) | 1,040 | 98.48 | 98.58 | 4.55 | 0.52 | 0.86 | 0.85 | 4.49 | 4.47 | 4.49 | 39 |
| 長期 (7-) | 275 | 98.61 | 98.76 | 8.66 | 1.02 | 1.22 | 1.21 | 8.29 | 8.24 | 8.29 | 47 |
| 長期 (7-11) | 275 | 98.61 | 98.76 | 8.66 | 1.02 | 1.22 | 1.21 | 8.29 | 8.24 | 8.29 | 47 |
| 超長期 (11-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 輸送用機器 | 1,107 | 97.78 | 97.87 | 4.47 | 0.42 | 0.88 | 0.87 | 4.28 | 4.26 | 4.28 | 39 |
| 短期 (1-3) | 525 | 99.10 | 99.15 | 1.99 | 0.26 | 0.72 | 0.72 | 1.98 | 1.97 | 1.98 | 38 |
| 中期 (3-7) | 373 | 98.21 | 98.30 | 4.65 | 0.47 | 0.84 | 0.84 | 4.59 | 4.57 | 4.59 | 37 |
| 長期 (7-) | 209 | 93.70 | 93.90 | 10.36 | 0.76 | 1.39 | 1.34 | 9.81 | 9.75 | 9.81 | 44 |
| 長期 (7-11) | 119 | 97.79 | 98.05 | 8.48 | 0.82 | 1.13 | 1.12 | 8.18 | 8.13 | 8.17 | 40 |
| 超長期 (11-) | 90 | 88.28 | 88.41 | 12.85 | 0.67 | 1.78 | 1.68 | 12.22 | 12.11 | 12.20 | 50 |

出所:NFRG

- 東証 33 業種分類を参考に NFRG で分類

事業債 業種別・ポートフォリオ指標 (3/4) (2024年9月末)

| | 額面 (10億円) | 時価単価 (円) | 利含単価 (円) | 残存年数 (年) | 利率 (%) | 単利 (%) | 複利 (%) | Dur (年) | M-Dur | E-Dur | Tspd (bp) |
|-----------|--------------|-------------|-------------|-------------|-----------|-----------|-----------|------------|-------|-------|--------------|
| 精密機器 | 240 | 98.53 | 98.76 | 4.44 | 0.58 | 0.91 | 0.90 | 4.33 | 4.31 | 4.33 | 44 |
| 短期 (1-3) | 80 | 99.55 | 99.71 | 2.15 | 0.39 | 0.64 | 0.64 | 2.14 | 2.13 | 2.14 | 29 |
| 中期 (3-7) | 125 | 98.21 | 98.41 | 4.88 | 0.60 | 0.96 | 0.95 | 4.80 | 4.77 | 4.80 | 48 |
| 長期 (7-) | 35 | 97.39 | 97.82 | 8.13 | 0.97 | 1.34 | 1.32 | 7.79 | 7.73 | 7.78 | 64 |
| 長期 (7-11) | 35 | 97.39 | 97.82 | 8.13 | 0.97 | 1.34 | 1.32 | 7.79 | 7.73 | 7.78 | 64 |
| 超長期 (11-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| その他製品 | 180 | 95.44 | 95.54 | 7.22 | 0.52 | 1.05 | 1.02 | 6.78 | 6.74 | 6.78 | 36 |
| 短期 (1-3) | 15 | 98.67 | 98.73 | 2.35 | 0.20 | 0.79 | 0.78 | 2.35 | 2.34 | 2.35 | 42 |
| 中期 (3-7) | 120 | 98.41 | 98.52 | 5.18 | 0.52 | 0.84 | 0.83 | 5.11 | 5.09 | 5.11 | 34 |
| 長期 (7-) | 45 | 86.47 | 86.51 | 14.27 | 0.63 | 1.80 | 1.68 | 13.54 | 13.42 | 13.52 | 38 |
| 長期 (7-11) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 超長期 (11-) | 45 | 86.47 | 86.51 | 14.27 | 0.63 | 1.80 | 1.68 | 13.54 | 13.42 | 13.52 | 38 |
| 電気・ガス業 | 12,383 | 95.50 | 95.72 | 8.08 | 0.81 | 1.23 | 1.19 | 7.11 | 7.05 | 7.08 | 49 |
| 短期 (1-3) | 2,695 | 99.57 | 99.69 | 2.08 | 0.46 | 0.67 | 0.67 | 2.07 | 2.06 | 2.07 | 33 |
| 中期 (3-7) | 4,260 | 98.69 | 98.89 | 4.94 | 0.74 | 0.98 | 0.97 | 4.84 | 4.82 | 4.84 | 49 |
| 長期 (7-) | 5,429 | 90.96 | 91.27 | 13.52 | 1.04 | 1.75 | 1.66 | 11.76 | 11.66 | 11.71 | 57 |
| 長期 (7-11) | 2,571 | 97.65 | 97.99 | 8.74 | 1.04 | 1.35 | 1.34 | 8.32 | 8.27 | 8.32 | 59 |
| 超長期 (11-) | 2,858 | 84.95 | 85.23 | 17.82 | 1.03 | 2.17 | 2.00 | 15.32 | 15.17 | 15.22 | 55 |
| 陸運業 | 5,919 | 91.16 | 91.27 | 13.47 | 1.02 | 1.41 | 1.31 | 10.32 | 10.23 | 10.20 | 35 |
| 短期 (1-3) | 694 | 100.66 | 100.75 | 1.99 | 0.87 | 0.61 | 0.61 | 1.97 | 1.97 | 1.97 | 28 |
| 中期 (3-7) | 1,650 | 101.06 | 101.16 | 5.07 | 1.07 | 0.80 | 0.80 | 4.94 | 4.92 | 4.94 | 32 |
| 長期 (7-) | 3,575 | 84.75 | 84.86 | 19.58 | 1.03 | 1.94 | 1.75 | 15.21 | 15.06 | 14.99 | 38 |
| 長期 (7-11) | 1,034 | 100.37 | 100.51 | 8.92 | 1.16 | 1.12 | 1.12 | 8.47 | 8.42 | 8.47 | 36 |
| 超長期 (11-) | 2,541 | 78.39 | 78.50 | 23.91 | 0.98 | 2.36 | 2.08 | 18.72 | 18.51 | 18.39 | 39 |
| 海運業 | 163 | 99.53 | 99.75 | 5.09 | 0.92 | 0.98 | 0.98 | 4.92 | 4.90 | 4.92 | 47 |
| 短期 (1-3) | 20 | 101.20 | 101.58 | 1.78 | 1.46 | 0.74 | 0.74 | 1.75 | 1.75 | 1.75 | 41 |
| 中期 (3-7) | 113 | 99.54 | 99.69 | 4.54 | 0.76 | 0.93 | 0.93 | 4.46 | 4.44 | 4.46 | 46 |
| 長期 (7-) | 30 | 98.38 | 98.77 | 9.33 | 1.14 | 1.34 | 1.33 | 8.84 | 8.78 | 8.84 | 52 |
| 長期 (7-11) | 30 | 98.38 | 98.77 | 9.33 | 1.14 | 1.34 | 1.33 | 8.84 | 8.78 | 8.84 | 52 |
| 超長期 (11-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 空運業 | 315 | 94.77 | 95.06 | 8.05 | 0.98 | 1.59 | 1.54 | 7.28 | 7.22 | 7.27 | 79 |
| 短期 (1-3) | 90 | 99.40 | 99.52 | 1.87 | 0.65 | 0.98 | 0.98 | 1.86 | 1.85 | 1.86 | 65 |
| 中期 (3-7) | 40 | 96.36 | 96.46 | 4.60 | 0.36 | 1.18 | 1.16 | 4.56 | 4.53 | 4.56 | 69 |
| 長期 (7-) | 185 | 92.18 | 92.59 | 11.80 | 1.28 | 2.00 | 1.91 | 10.73 | 10.63 | 10.71 | 88 |
| 長期 (7-11) | 85 | 100.16 | 100.69 | 9.42 | 1.53 | 1.52 | 1.52 | 8.76 | 8.70 | 8.76 | 70 |
| 超長期 (11-) | 100 | 85.40 | 85.71 | 13.82 | 1.07 | 2.49 | 2.30 | 12.70 | 12.55 | 12.67 | 106 |
| 倉庫・運輸関連業 | 124 | 96.09 | 96.16 | 6.66 | 0.58 | 1.12 | 1.09 | 6.29 | 6.25 | 6.29 | 47 |
| 短期 (1-3) | 12 | 99.88 | 100.01 | 1.14 | 0.42 | 0.54 | 0.54 | 1.14 | 1.14 | 1.14 | 29 |
| 中期 (3-7) | 75 | 97.45 | 97.51 | 4.93 | 0.44 | 0.98 | 0.97 | 4.87 | 4.84 | 4.87 | 50 |
| 長期 (7-) | 37 | 92.04 | 92.12 | 12.04 | 0.93 | 1.63 | 1.55 | 11.23 | 11.14 | 11.22 | 49 |
| 長期 (7-11) | 17 | 99.12 | 99.17 | 9.26 | 1.18 | 1.29 | 1.28 | 8.79 | 8.74 | 8.79 | 48 |
| 超長期 (11-) | 20 | 86.20 | 86.31 | 14.33 | 0.72 | 1.95 | 1.81 | 13.54 | 13.42 | 13.52 | 51 |
| 情報・通信業 | 2,484 | 97.68 | 97.89 | 4.60 | 0.91 | 1.35 | 1.32 | 4.30 | 4.27 | 4.30 | 84 |
| 短期 (1-3) | 926 | 99.42 | 99.58 | 1.96 | 0.70 | 1.03 | 1.03 | 1.95 | 1.94 | 1.95 | 70 |
| 中期 (3-7) | 1,150 | 98.17 | 98.40 | 4.67 | 0.89 | 1.30 | 1.29 | 4.56 | 4.53 | 4.56 | 82 |
| 長期 (7-) | 408 | 92.33 | 92.63 | 10.38 | 1.40 | 2.26 | 2.15 | 9.29 | 9.19 | 9.27 | 127 |
| 長期 (7-11) | 290 | 96.21 | 96.46 | 8.74 | 1.27 | 1.81 | 1.77 | 8.26 | 8.19 | 8.26 | 102 |
| 超長期 (11-) | 118 | 82.76 | 83.17 | 14.40 | 1.73 | 3.55 | 3.24 | 12.24 | 12.04 | 12.17 | 200 |
| 卸売業 | 1,272 | 98.37 | 98.56 | 6.40 | 0.90 | 1.04 | 1.03 | 6.05 | 6.01 | 6.04 | 43 |
| 短期 (1-3) | 178 | 100.43 | 100.71 | 2.03 | 0.94 | 0.71 | 0.71 | 2.01 | 2.00 | 2.01 | 38 |
| 中期 (3-7) | 647 | 99.75 | 99.94 | 4.81 | 0.84 | 0.91 | 0.91 | 4.71 | 4.69 | 4.71 | 43 |
| 長期 (7-) | 447 | 95.53 | 95.72 | 10.44 | 0.97 | 1.38 | 1.34 | 9.76 | 9.69 | 9.75 | 44 |
| 長期 (7-11) | 302 | 99.10 | 99.32 | 8.70 | 1.05 | 1.16 | 1.15 | 8.31 | 8.27 | 8.31 | 41 |
| 超長期 (11-) | 145 | 88.11 | 88.25 | 14.06 | 0.82 | 1.89 | 1.77 | 13.15 | 13.04 | 13.12 | 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9月末、10月ポートフォリオ)

| | 額面 (10億円) | 時価単価 (円) | 利含単価 (円) | 残存年数 (年) | 利率 (%) | 単利 (%) | 複利 (%) | Dur (年) | M-Dur | E-Dur | Tspd (bp) |
|-----------|--------------|-------------|-------------|-------------|-----------|-----------|-----------|------------|-------|-------|--------------|
| 精密機器 | 240 | 98.53 | 98.76 | 4.44 | 0.58 | 0.91 | 0.90 | 4.33 | 4.31 | 4.33 | 44 |
| 短期 (1-3) | 80 | 99.55 | 99.71 | 2.15 | 0.39 | 0.64 | 0.64 | 2.14 | 2.13 | 2.14 | 29 |
| 中期 (3-7) | 125 | 98.21 | 98.41 | 4.88 | 0.60 | 0.96 | 0.95 | 4.80 | 4.77 | 4.80 | 48 |
| 長期 (7-) | 35 | 97.39 | 97.82 | 8.13 | 0.97 | 1.34 | 1.32 | 7.79 | 7.73 | 7.78 | 64 |
| 長期 (7-11) | 35 | 97.39 | 97.82 | 8.13 | 0.97 | 1.34 | 1.32 | 7.79 | 7.73 | 7.78 | 64 |
| 超長期 (11-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| その他製品 | 180 | 95.44 | 95.54 | 7.22 | 0.52 | 1.05 | 1.02 | 6.78 | 6.74 | 6.78 | 36 |
| 短期 (1-3) | 15 | 98.67 | 98.73 | 2.35 | 0.20 | 0.79 | 0.78 | 2.35 | 2.34 | 2.35 | 42 |
| 中期 (3-7) | 120 | 98.41 | 98.52 | 5.18 | 0.52 | 0.84 | 0.83 | 5.11 | 5.09 | 5.11 | 34 |
| 長期 (7-) | 45 | 86.47 | 86.51 | 14.27 | 0.63 | 1.80 | 1.68 | 13.54 | 13.42 | 13.52 | 38 |
| 長期 (7-11) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 超長期 (11-) | 45 | 86.47 | 86.51 | 14.27 | 0.63 | 1.80 | 1.68 | 13.54 | 13.42 | 13.52 | 38 |
| 電気・ガス業 | 12,262 | 95.45 | 95.68 | 8.16 | 0.81 | 1.24 | 1.20 | 7.18 | 7.13 | 7.16 | 49 |
| 短期 (1-3) | 2,679 | 99.56 | 99.69 | 2.18 | 0.47 | 0.69 | 0.68 | 2.17 | 2.16 | 2.17 | 34 |
| 中期 (3-7) | 4,221 | 98.59 | 98.78 | 5.04 | 0.73 | 0.98 | 0.98 | 4.93 | 4.91 | 4.93 | 50 |
| 長期 (7-) | 5,362 | 90.93 | 91.24 | 13.61 | 1.05 | 1.76 | 1.67 | 11.83 | 11.73 | 11.78 | 57 |
| 長期 (7-11) | 2,525 | 97.70 | 98.04 | 8.82 | 1.06 | 1.36 | 1.35 | 8.39 | 8.33 | 8.39 | 59 |
| 超長期 (11-) | 2,838 | 84.91 | 85.19 | 17.87 | 1.04 | 2.18 | 2.01 | 15.36 | 15.20 | 15.25 | 55 |
| 陸運業 | 5,914 | 91.16 | 91.26 | 13.51 | 1.03 | 1.42 | 1.32 | 10.36 | 10.27 | 10.24 | 35 |
| 短期 (1-3) | 679 | 100.65 | 100.73 | 2.04 | 0.87 | 0.62 | 0.62 | 2.02 | 2.01 | 2.02 | 28 |
| 中期 (3-7) | 1,645 | 101.07 | 101.17 | 5.08 | 1.07 | 0.80 | 0.80 | 4.95 | 4.93 | 4.95 | 32 |
| 長期 (7-) | 3,590 | 84.82 | 84.94 | 19.55 | 1.03 | 1.93 | 1.75 | 15.19 | 15.04 | 14.97 | 38 |
| 長期 (7-11) | 1,044 | 100.39 | 100.53 | 8.93 | 1.16 | 1.12 | 1.12 | 8.48 | 8.43 | 8.47 | 35 |
| 超長期 (11-) | 2,546 | 78.43 | 78.54 | 23.90 | 0.98 | 2.36 | 2.08 | 18.71 | 18.51 | 18.38 | 39 |
| 海運業 | 169 | 99.53 | 99.75 | 5.08 | 0.92 | 0.98 | 0.98 | 4.92 | 4.89 | 4.92 | 47 |
| 短期 (1-3) | 20 | 101.20 | 101.58 | 1.78 | 1.46 | 0.74 | 0.74 | 1.75 | 1.75 | 1.75 | 41 |
| 中期 (3-7) | 119 | 99.55 | 99.69 | 4.56 | 0.77 | 0.93 | 0.93 | 4.48 | 4.46 | 4.48 | 46 |
| 長期 (7-) | 30 | 98.38 | 98.77 | 9.33 | 1.14 | 1.34 | 1.33 | 8.84 | 8.78 | 8.84 | 52 |
| 長期 (7-11) | 30 | 98.38 | 98.77 | 9.33 | 1.14 | 1.34 | 1.33 | 8.84 | 8.78 | 8.84 | 52 |
| 超長期 (11-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 空運業 | 315 | 94.77 | 95.06 | 8.05 | 0.98 | 1.59 | 1.54 | 7.28 | 7.22 | 7.27 | 79 |
| 短期 (1-3) | 90 | 99.40 | 99.52 | 1.87 | 0.65 | 0.98 | 0.98 | 1.86 | 1.85 | 1.86 | 65 |
| 中期 (3-7) | 40 | 96.36 | 96.46 | 4.60 | 0.36 | 1.18 | 1.16 | 4.56 | 4.53 | 4.56 | 69 |
| 長期 (7-) | 185 | 92.18 | 92.59 | 11.80 | 1.28 | 2.00 | 1.91 | 10.73 | 10.63 | 10.71 | 88 |
| 長期 (7-11) | 85 | 100.16 | 100.69 | 9.42 | 1.53 | 1.52 | 1.52 | 8.76 | 8.70 | 8.76 | 70 |
| 超長期 (11-) | 100 | 85.40 | 85.71 | 13.82 | 1.07 | 2.49 | 2.30 | 12.70 | 12.55 | 12.67 | 106 |
| 倉庫・運輸関連業 | 129 | 96.26 | 96.33 | 6.59 | 0.63 | 1.13 | 1.10 | 6.23 | 6.19 | 6.22 | 49 |
| 短期 (1-3) | 17 | 100.05 | 100.17 | 2.21 | 0.82 | 0.79 | 0.79 | 2.19 | 2.18 | 2.19 | 44 |
| 中期 (3-7) | 75 | 97.45 | 97.51 | 4.93 | 0.44 | 0.98 | 0.97 | 4.87 | 4.84 | 4.87 | 50 |
| 長期 (7-) | 37 | 92.04 | 92.12 | 12.04 | 0.93 | 1.63 | 1.55 | 11.23 | 11.14 | 11.22 | 49 |
| 長期 (7-11) | 17 | 99.12 | 99.17 | 9.26 | 1.18 | 1.29 | 1.28 | 8.79 | 8.74 | 8.79 | 48 |
| 超長期 (11-) | 20 | 86.20 | 86.31 | 14.33 | 0.72 | 1.95 | 1.81 | 13.54 | 13.42 | 13.52 | 51 |
| 情報・通信業 | 2,434 | 97.64 | 97.85 | 4.67 | 0.92 | 1.36 | 1.34 | 4.37 | 4.33 | 4.37 | 86 |
| 短期 (1-3) | 926 | 99.39 | 99.55 | 2.07 | 0.71 | 1.05 | 1.04 | 2.05 | 2.04 | 2.05 | 70 |
| 中期 (3-7) | 1,120 | 98.05 | 98.28 | 4.78 | 0.91 | 1.33 | 1.31 | 4.66 | 4.63 | 4.66 | 84 |
| 長期 (7-) | 388 | 92.26 | 92.56 | 10.55 | 1.45 | 2.30 | 2.18 | 9.42 | 9.31 | 9.40 | 129 |
| 長期 (7-11) | 270 | 96.40 | 96.65 | 8.87 | 1.33 | 1.83 | 1.79 | 8.36 | 8.29 | 8.36 | 103 |
| 超長期 (11-) | 118 | 82.76 | 83.17 | 14.40 | 1.73 | 3.55 | 3.24 | 12.24 | 12.04 | 12.17 | 200 |
| 卸売業 | 1,272 | 98.37 | 98.56 | 6.40 | 0.90 | 1.04 | 1.03 | 6.05 | 6.01 | 6.04 | 43 |
| 短期 (1-3) | 178 | 100.43 | 100.71 | 2.03 | 0.94 | 0.71 | 0.71 | 2.01 | 2.00 | 2.01 | 38 |
| 中期 (3-7) | 647 | 99.75 | 99.94 | 4.81 | 0.84 | 0.91 | 0.91 | 4.71 | 4.69 | 4.71 | 43 |
| 長期 (7-) | 447 | 95.53 | 95.72 | 10.44 | 0.97 | 1.38 | 1.34 | 9.76 | 9.69 | 9.75 | 44 |
| 長期 (7-11) | 302 | 99.10 | 99.32 | 8.70 | 1.05 | 1.16 | 1.15 | 8.31 | 8.27 | 8.31 | 41 |
| 超長期 (11-) | 145 | 88.11 | 88.25 | 14.06 | 0.82 | 1.89 | 1.77 | 13.15 | 13.04 | 13.12 | 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9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 | 1,259 | 98.92 | 99.10 | 4.00 | 0.61 | 0.88 | 0.87 | 3.86 | 3.84 | 3.86 | 42 |
| 短期 (1-3) | 515 | 99.48 | 99.58 | 1.68 | 0.35 | 0.63 | 0.63 | 1.67 | 1.67 | 1.67 | 32 |
| 中期 (3-7) | 553 | 99.15 | 99.34 | 4.22 | 0.68 | 0.90 | 0.90 | 4.15 | 4.13 | 4.15 | 45 |
| 長期 (7-) | 191 | 96.75 | 97.11 | 9.61 | 1.10 | 1.46 | 1.44 | 9.02 | 8.96 | 9.01 | 61 |
| 長期 (7-11) | 151 | 98.55 | 98.94 | 8.53 | 1.15 | 1.38 | 1.38 | 8.10 | 8.05 | 8.10 | 65 |
| 超長期 (11-) | 40 | 89.95 | 90.20 | 13.68 | 0.88 | 1.80 | 1.71 | 12.83 | 12.72 | 12.80 | 46 |
| 銀行業 | 1,437 | 100.46 | 100.80 | 3.43 | 1.24 | 1.02 | 1.02 | 3.33 | 3.32 | 3.33 | 61 |
| 短期 (1-3) | 732 | 100.84 | 101.24 | 1.92 | 1.41 | 0.95 | 0.95 | 1.89 | 1.88 | 1.89 | 62 |
| 中期 (3-7) | 667 | 100.09 | 100.36 | 4.75 | 1.05 | 1.08 | 1.08 | 4.63 | 4.60 | 4.63 | 61 |
| 長期 (7-) | 38 | 99.69 | 99.97 | 9.15 | 1.16 | 1.22 | 1.22 | 8.67 | 8.62 | 8.67 | 43 |
| 長期 (7-11) | 38 | 99.69 | 99.97 | 9.15 | 1.16 | 1.22 | 1.22 | 8.67 | 8.62 | 8.67 | 43 |
| 超長期 (11-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 証券・商品先物取引業 | 949 | 99.36 | 99.57 | 2.36 | 0.86 | 1.11 | 1.10 | 2.33 | 2.31 | 2.33 | 75 |
| 短期 (1-3) | 735 | 99.46 | 99.66 | 1.89 | 0.84 | 1.08 | 1.08 | 1.87 | 1.86 | 1.87 | 75 |
| 中期 (3-7) | 210 | 99.13 | 99.34 | 3.88 | 0.94 | 1.17 | 1.17 | 3.81 | 3.79 | 3.81 | 73 |
| 長期 (7-) | 5 | 95.11 | 95.17 | 7.93 | 0.90 | 1.60 | 1.56 | 7.65 | 7.60 | 7.65 | 90 |
| 長期 (7-11) | 5 | 95.11 | 95.17 | 7.93 | 0.90 | 1.60 | 1.56 | 7.65 | 7.60 | 7.65 | 90 |
| 超長期 (11-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 保険業 | 330 | 98.50 | 98.67 | 3.49 | 0.38 | 0.83 | 0.83 | 3.42 | 3.40 | 3.42 | 40 |
| 短期 (1-3) | 160 | 98.89 | 98.96 | 2.16 | 0.20 | 0.73 | 0.72 | 2.16 | 2.15 | 2.16 | 37 |
| 中期 (3-7) | 120 | 98.86 | 99.06 | 3.35 | 0.46 | 0.81 | 0.80 | 3.32 | 3.31 | 3.32 | 39 |
| 長期 (7-) | 50 | 96.41 | 96.76 | 8.04 | 0.75 | 1.24 | 1.22 | 7.78 | 7.74 | 7.78 | 55 |
| 長期 (7-11) | 50 | 96.41 | 96.76 | 8.04 | 0.75 | 1.24 | 1.22 | 7.78 | 7.74 | 7.78 | 55 |
| 超長期 (11-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| その他金融業 | 6,585 | 98.73 | 98.86 | 3.86 | 0.50 | 0.84 | 0.83 | 3.76 | 3.74 | 3.76 | 40 |
| 短期 (1-3) | 2,920 | 99.31 | 99.39 | 1.88 | 0.34 | 0.72 | 0.72 | 1.88 | 1.87 | 1.88 | 39 |
| 中期 (3-7) | 3,025 | 98.62 | 98.76 | 4.62 | 0.56 | 0.85 | 0.85 | 4.55 | 4.53 | 4.55 | 38 |
| 長期 (7-) | 641 | 96.66 | 96.84 | 9.26 | 0.96 | 1.35 | 1.31 | 8.77 | 8.71 | 8.77 | 52 |
| 長期 (7-11) | 563 | 98.08 | 98.23 | 8.59 | 0.96 | 1.24 | 1.22 | 8.25 | 8.20 | 8.25 | 49 |
| 超長期 (11-) | 78 | 86.43 | 86.79 | 14.11 | 0.96 | 2.20 | 2.05 | 13.01 | 12.87 | 12.98 | 78 |
| 不動産業 | 2,622 | 95.85 | 96.02 | 7.62 | 0.74 | 1.16 | 1.12 | 6.64 | 6.59 | 6.61 | 46 |
| 短期 (1-3) | 541 | 99.42 | 99.51 | 2.25 | 0.47 | 0.75 | 0.74 | 2.24 | 2.23 | 2.24 | 39 |
| 中期 (3-7) | 1,061 | 98.49 | 98.66 | 4.74 | 0.62 | 0.92 | 0.92 | 4.66 | 4.63 | 4.66 | 45 |
| 長期 (7-) | 1,021 | 91.21 | 91.44 | 13.45 | 1.01 | 1.65 | 1.56 | 11.40 | 11.30 | 11.33 | 51 |
| 長期 (7-11) | 548 | 98.47 | 98.73 | 8.57 | 1.02 | 1.21 | 1.20 | 8.19 | 8.15 | 8.19 | 47 |
| 超長期 (11-) | 473 | 82.80 | 82.98 | 19.10 | 1.00 | 2.26 | 2.05 | 15.81 | 15.65 | 15.65 | 57 |
| サービス業 | 736 | 91.65 | 91.83 | 5.15 | 0.65 | 2.11 | 1.95 | 4.69 | 4.64 | 4.69 | 146 |
| 短期 (1-3) | 250 | 97.73 | 97.82 | 2.11 | 0.36 | 1.45 | 1.43 | 2.10 | 2.08 | 2.10 | 108 |
| 中期 (3-7) | 276 | 97.16 | 97.29 | 4.86 | 0.53 | 1.15 | 1.12 | 4.79 | 4.76 | 4.79 | 65 |
| 長期 (7-) | 210 | 77.14 | 77.50 | 9.18 | 1.14 | 4.72 | 4.13 | 8.44 | 8.27 | 8.43 | 335 |
| 長期 (7-11) | 160 | 79.77 | 80.10 | 8.06 | 1.04 | 4.43 | 3.95 | 7.62 | 7.47 | 7.62 | 327 |
| 超長期 (11-) | 50 | 68.73 | 69.18 | 12.75 | 1.45 | 5.79 | 4.80 | 11.48 | 11.22 | 11.45 | 365 |
| 財投機関債 | 20,722 | 96.32 | 96.48 | 9.38 | 0.81 | 1.00 | 0.96 | 7.80 | 7.74 | 7.74 | 19 |
| 短期 (1-3) | 5,815 | 99.78 | 99.84 | 2.00 | 0.39 | 0.51 | 0.51 | 2.00 | 1.99 | 2.00 | 17 |
| 中期 (3-7) | 6,249 | 100.35 | 100.48 | 4.63 | 0.73 | 0.64 | 0.64 | 4.55 | 4.53 | 4.55 | 18 |
| 長期 (7-) | 8,658 | 91.08 | 91.33 | 17.76 | 1.14 | 1.64 | 1.55 | 14.64 | 14.51 | 14.50 | 21 |
| 長期 (7-11) | 2,526 | 101.40 | 101.64 | 8.81 | 1.10 | 0.93 | 0.94 | 8.39 | 8.35 | 8.38 | 19 |
| 超長期 (11-) | 6,132 | 86.83 | 87.08 | 21.45 | 1.16 | 1.99 | 1.85 | 17.64 | 17.47 | 17.44 | 22 |

出所:NFRC

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

事業債 業種別・ポートフォリオ指標 (4/4) (2024年9月末、10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 | 1,274 | 98.92 | 99.10 | 3.98 | 0.61 | 0.88 | 0.87 | 3.84 | 3.82 | 3.84 | 42 |
| 短期 (1-3) | 530 | 99.46 | 99.56 | 1.71 | 0.36 | 0.65 | 0.65 | 1.70 | 1.69 | 1.70 | 34 |
| 中期 (3-7) | 583 | 98.91 | 99.09 | 4.36 | 0.66 | 0.92 | 0.92 | 4.29 | 4.27 | 4.29 | 46 |
| 長期 (7-) | 161 | 97.19 | 97.58 | 10.09 | 1.23 | 1.50 | 1.48 | 9.40 | 9.33 | 9.39 | 60 |
| 長期 (7-11) | 121 | 99.59 | 100.03 | 8.90 | 1.34 | 1.41 | 1.41 | 8.37 | 8.31 | 8.37 | 65 |
| 超長期 (11-) | 40 | 89.95 | 90.20 | 13.68 | 0.88 | 1.80 | 1.71 | 12.83 | 12.72 | 12.80 | 46 |
| 銀行業 | 1,407 | 100.46 | 100.79 | 3.48 | 1.23 | 1.02 | 1.02 | 3.38 | 3.36 | 3.38 | 61 |
| 短期 (1-3) | 702 | 100.85 | 101.24 | 1.95 | 1.41 | 0.95 | 0.95 | 1.93 | 1.92 | 1.93 | 62 |
| 中期 (3-7) | 667 | 100.09 | 100.36 | 4.75 | 1.05 | 1.08 | 1.08 | 4.63 | 4.60 | 4.63 | 61 |
| 長期 (7-) | 38 | 99.69 | 99.97 | 9.15 | 1.16 | 1.22 | 1.22 | 8.67 | 8.62 | 8.67 | 43 |
| 長期 (7-11) | 38 | 99.69 | 99.97 | 9.15 | 1.16 | 1.22 | 1.22 | 8.67 | 8.62 | 8.67 | 43 |
| 超長期 (11-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 証券、商品先物取引業 | 949 | 99.36 | 99.57 | 2.36 | 0.86 | 1.11 | 1.10 | 2.33 | 2.31 | 2.33 | 75 |
| 短期 (1-3) | 735 | 99.46 | 99.66 | 1.89 | 0.84 | 1.08 | 1.08 | 1.87 | 1.86 | 1.87 | 75 |
| 中期 (3-7) | 210 | 99.13 | 99.34 | 3.88 | 0.94 | 1.17 | 1.17 | 3.81 | 3.79 | 3.81 | 73 |
| 長期 (7-) | 5 | 95.11 | 95.17 | 7.93 | 0.90 | 1.60 | 1.56 | 7.65 | 7.60 | 7.65 | 90 |
| 長期 (7-11) | 5 | 95.11 | 95.17 | 7.93 | 0.90 | 1.60 | 1.56 | 7.65 | 7.60 | 7.65 | 90 |
| 超長期 (11-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 保険業 | 330 | 98.50 | 98.67 | 3.49 | 0.38 | 0.83 | 0.83 | 3.42 | 3.40 | 3.42 | 40 |
| 短期 (1-3) | 210 | 98.89 | 99.00 | 2.37 | 0.26 | 0.74 | 0.74 | 2.36 | 2.35 | 2.36 | 37 |
| 中期 (3-7) | 70 | 98.83 | 99.04 | 3.57 | 0.48 | 0.82 | 0.81 | 3.54 | 3.53 | 3.54 | 39 |
| 長期 (7-) | 50 | 96.41 | 96.76 | 8.04 | 0.75 | 1.24 | 1.22 | 7.78 | 7.74 | 7.78 | 55 |
| 長期 (7-11) | 50 | 96.41 | 96.76 | 8.04 | 0.75 | 1.24 | 1.22 | 7.78 | 7.74 | 7.78 | 55 |
| 超長期 (11-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| その他金融業 | 6,468 | 98.72 | 98.84 | 3.92 | 0.50 | 0.85 | 0.84 | 3.82 | 3.80 | 3.82 | 40 |
| 短期 (1-3) | 2,832 | 99.29 | 99.37 | 1.94 | 0.34 | 0.73 | 0.73 | 1.93 | 1.92 | 1.93 | 39 |
| 中期 (3-7) | 2,995 | 98.62 | 98.76 | 4.64 | 0.56 | 0.85 | 0.85 | 4.57 | 4.55 | 4.57 | 38 |
| 長期 (7-) | 641 | 96.66 | 96.84 | 9.26 | 0.96 | 1.35 | 1.31 | 8.77 | 8.71 | 8.77 | 52 |
| 長期 (7-11) | 563 | 98.08 | 98.23 | 8.59 | 0.96 | 1.24 | 1.22 | 8.25 | 8.20 | 8.25 | 49 |
| 超長期 (11-) | 78 | 86.43 | 86.79 | 14.11 | 0.96 | 2.20 | 2.05 | 13.01 | 12.87 | 12.98 | 78 |
| 不動産業 | 2,640 | 95.86 | 96.04 | 7.61 | 0.75 | 1.16 | 1.12 | 6.64 | 6.59 | 6.62 | 46 |
| 短期 (1-3) | 556 | 99.68 | 99.83 | 2.31 | 0.56 | 0.75 | 0.75 | 2.29 | 2.28 | 2.29 | 39 |
| 中期 (3-7) | 1,074 | 98.30 | 98.45 | 4.81 | 0.59 | 0.94 | 0.93 | 4.73 | 4.71 | 4.73 | 46 |
| 長期 (7-) | 1,011 | 91.18 | 91.40 | 13.51 | 1.01 | 1.66 | 1.56 | 11.44 | 11.34 | 11.37 | 51 |
| 長期 (7-11) | 538 | 98.54 | 98.80 | 8.60 | 1.03 | 1.21 | 1.20 | 8.22 | 8.17 | 8.21 | 47 |
| 超長期 (11-) | 473 | 82.80 | 82.98 | 19.10 | 1.00 | 2.26 | 2.05 | 15.81 | 15.65 | 15.65 | 57 |
| サービス業 | 836 | 92.67 | 92.84 | 5.67 | 0.71 | 1.99 | 1.85 | 5.25 | 5.20 | 5.25 | 131 |
| 短期 (1-3) | 230 | 97.56 | 97.65 | 2.20 | 0.37 | 1.53 | 1.51 | 2.19 | 2.17 | 2.19 | 116 |
| 中期 (3-7) | 336 | 97.67 | 97.80 | 5.10 | 0.59 | 1.09 | 1.07 | 5.03 | 5.00 | 5.03 | 58 |
| 長期 (7-) | 270 | 82.27 | 82.57 | 9.34 | 1.16 | 3.77 | 3.35 | 8.68 | 8.54 | 8.67 | 255 |
| 長期 (7-11) | 220 | 85.34 | 85.61 | 8.57 | 1.10 | 3.40 | 3.08 | 8.17 | 8.05 | 8.16 | 234 |
| 超長期 (11-) | 50 | 68.73 | 69.18 | 12.75 | 1.45 | 5.79 | 4.80 | 11.48 | 11.22 | 11.45 | 365 |
| 財投機関債 | 20,790 | 96.33 | 96.49 | 9.41 | 0.81 | 1.00 | 0.97 | 7.83 | 7.77 | 7.77 | 19 |
| 短期 (1-3) | 5,804 | 99.81 | 99.88 | 2.04 | 0.41 | 0.51 | 0.51 | 2.03 | 2.03 | 2.03 | 17 |
| 中期 (3-7) | 6,381 | 100.29 | 100.42 | 4.70 | 0.72 | 0.64 | 0.65 | 4.61 | 4.60 | 4.61 | 18 |
| 長期 (7-) | 8,605 | 91.04 | 91.29 | 17.88 | 1.15 | 1.65 | 1.56 | 14.73 | 14.60 | 14.59 | 21 |
| 長期 (7-11) | 2,471 | 101.40 | 101.64 | 8.90 | 1.11 | 0.94 | 0.95 | 8.47 | 8.43 | 8.46 | 19 |
| 超長期 (11-) | 6,134 | 86.87 | 87.12 | 21.49 | 1.16 | 1.99 | 1.85 | 17.67 | 17.50 | 17.47 | 22 |

出所:NFRC

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

事業債 円建外債 格付別・ポートフォリオ指標(2024年9月末)

| | 額面 (10億円) | 時価単価 (円) | 利含単価 (円) | 残存年数 (年) | 利率 (%) | 単利 (%) | 複利 (%) | Dur (年) | M-Dur | E-Dur | Tspd (bp) |
|-----------|--------------|-------------|-------------|-------------|-----------|-----------|-----------|------------|-------|-------|--------------|
| AAA~AA 格 | 52,836 | 96.28 | 96.44 | 7.97 | 0.74 | 1.02 | 0.99 | 6.70 | 6.66 | 6.66 | 31 |
| 短期(1-3) | 15,659 | 99.66 | 99.76 | 1.99 | 0.44 | 0.62 | 0.62 | 1.98 | 1.97 | 1.98 | 29 |
| 中期(3-7) | 18,702 | 99.49 | 99.63 | 4.67 | 0.68 | 0.78 | 0.78 | 4.59 | 4.57 | 4.59 | 31 |
| 長期(7-) | 18,474 | 90.17 | 90.38 | 16.39 | 1.04 | 1.66 | 1.56 | 13.49 | 13.37 | 13.37 | 32 |
| 長期(7-11) | 7,327 | 99.34 | 99.56 | 8.65 | 0.99 | 1.09 | 1.08 | 8.28 | 8.23 | 8.27 | 34 |
| 超長期(11-) | 11,147 | 84.14 | 84.35 | 21.47 | 1.07 | 2.11 | 1.93 | 17.53 | 17.35 | 17.32 | 31 |
| AAA~A 格 | 73,409 | 96.56 | 96.73 | 7.28 | 0.75 | 1.08 | 1.05 | 6.25 | 6.21 | 6.22 | 40 |
| 短期(1-3) | 22,556 | 99.57 | 99.68 | 2.00 | 0.49 | 0.71 | 0.71 | 1.99 | 1.99 | 1.99 | 38 |
| 中期(3-7) | 26,994 | 99.18 | 99.33 | 4.66 | 0.70 | 0.87 | 0.87 | 4.58 | 4.56 | 4.58 | 40 |
| 長期(7-) | 23,859 | 90.77 | 91.01 | 15.21 | 1.06 | 1.71 | 1.61 | 12.73 | 12.62 | 12.63 | 44 |
| 長期(7-11) | 10,380 | 98.63 | 98.88 | 8.64 | 1.04 | 1.23 | 1.22 | 8.25 | 8.20 | 8.25 | 48 |
| 超長期(11-) | 13,479 | 84.72 | 84.95 | 20.27 | 1.08 | 2.13 | 1.96 | 16.75 | 16.58 | 16.56 | 40 |
| AAA~BBB 格 | 73,409 | 96.56 | 96.73 | 7.28 | 0.75 | 1.08 | 1.05 | 6.25 | 6.21 | 6.22 | 40 |
| 短期(1-3) | 22,556 | 99.57 | 99.68 | 2.00 | 0.49 | 0.71 | 0.71 | 1.99 | 1.99 | 1.99 | 38 |
| 中期(3-7) | 26,994 | 99.18 | 99.33 | 4.66 | 0.70 | 0.87 | 0.87 | 4.58 | 4.56 | 4.58 | 40 |
| 長期(7-) | 23,859 | 90.77 | 91.01 | 15.21 | 1.06 | 1.71 | 1.61 | 12.73 | 12.62 | 12.63 | 44 |
| 長期(7-11) | 10,380 | 98.63 | 98.88 | 8.64 | 1.04 | 1.23 | 1.22 | 8.25 | 8.20 | 8.25 | 48 |
| 超長期(11-) | 13,479 | 84.72 | 84.95 | 20.27 | 1.08 | 2.13 | 1.96 | 16.75 | 16.58 | 16.56 | 40 |
| AAA~BB 格 | 73,409 | 96.56 | 96.73 | 7.28 | 0.75 | 1.08 | 1.05 | 6.25 | 6.21 | 6.22 | 40 |
| 短期(1-3) | 22,556 | 99.57 | 99.68 | 2.00 | 0.49 | 0.71 | 0.71 | 1.99 | 1.99 | 1.99 | 38 |
| 中期(3-7) | 26,994 | 99.18 | 99.33 | 4.66 | 0.70 | 0.87 | 0.87 | 4.58 | 4.56 | 4.58 | 40 |
| 長期(7-) | 23,859 | 90.77 | 91.01 | 15.21 | 1.06 | 1.71 | 1.61 | 12.73 | 12.62 | 12.63 | 44 |
| 長期(7-11) | 10,380 | 98.63 | 98.88 | 8.64 | 1.04 | 1.23 | 1.22 | 8.25 | 8.20 | 8.25 | 48 |
| 超長期(11-) | 13,479 | 84.72 | 84.95 | 20.27 | 1.08 | 2.13 | 1.96 | 16.75 | 16.58 | 16.56 | 40 |
| AAA 格 | 11,588 | 97.57 | 97.66 | 5.45 | 0.43 | 0.74 | 0.73 | 4.73 | 4.70 | 4.70 | 22 |
| 短期(1-3) | 4,650 | 99.37 | 99.41 | 1.95 | 0.20 | 0.53 | 0.53 | 1.94 | 1.94 | 1.94 | 20 |
| 中期(3-7) | 5,003 | 98.95 | 99.04 | 4.61 | 0.47 | 0.68 | 0.68 | 4.55 | 4.53 | 4.55 | 21 |
| 長期(7-) | 1,935 | 89.72 | 89.92 | 16.05 | 0.92 | 1.49 | 1.38 | 12.62 | 12.52 | 12.48 | 27 |
| 長期(7-11) | 1,123 | 98.77 | 98.96 | 8.55 | 0.83 | 1.00 | 1.00 | 8.25 | 8.20 | 8.24 | 27 |
| 超長期(11-) | 812 | 77.20 | 77.41 | 26.42 | 1.03 | 2.36 | 2.06 | 20.36 | 20.14 | 19.98 | 27 |
| AA 格 | 41,247 | 95.92 | 96.09 | 8.68 | 0.82 | 1.10 | 1.06 | 7.27 | 7.21 | 7.22 | 34 |
| 短期(1-3) | 11,010 | 99.79 | 99.91 | 2.00 | 0.54 | 0.66 | 0.66 | 1.99 | 1.98 | 1.99 | 32 |
| 中期(3-7) | 13,698 | 99.69 | 99.85 | 4.69 | 0.76 | 0.82 | 0.82 | 4.60 | 4.58 | 4.60 | 35 |
| 長期(7-) | 16,539 | 90.22 | 90.44 | 16.43 | 1.05 | 1.68 | 1.58 | 13.59 | 13.47 | 13.47 | 33 |
| 長期(7-11) | 6,204 | 99.45 | 99.67 | 8.66 | 1.02 | 1.10 | 1.10 | 8.28 | 8.24 | 8.28 | 36 |
| 超長期(11-) | 10,335 | 84.68 | 84.89 | 21.09 | 1.08 | 2.09 | 1.92 | 17.33 | 17.15 | 17.12 | 31 |
| A 格 | 20,573 | 97.29 | 97.50 | 5.49 | 0.80 | 1.22 | 1.20 | 5.11 | 5.08 | 5.11 | 65 |
| 短期(1-3) | 6,897 | 99.34 | 99.49 | 2.05 | 0.60 | 0.93 | 0.92 | 2.03 | 2.02 | 2.03 | 59 |
| 中期(3-7) | 8,292 | 98.47 | 98.65 | 4.66 | 0.75 | 1.08 | 1.07 | 4.57 | 4.54 | 4.57 | 60 |
| 長期(7-) | 5,384 | 92.84 | 93.17 | 11.18 | 1.14 | 1.86 | 1.78 | 10.22 | 10.13 | 10.20 | 82 |
| 長期(7-11) | 3,052 | 96.93 | 97.26 | 8.64 | 1.15 | 1.58 | 1.55 | 8.20 | 8.13 | 8.19 | 81 |
| 超長期(11-) | 2,332 | 87.49 | 87.82 | 14.51 | 1.12 | 2.26 | 2.12 | 13.15 | 13.02 | 13.11 | 83 |
| BBB 格 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 短期(1-3) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中期(3-7) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 長期(7-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 長期(7-11) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 超長期(11-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| BB 格 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 短期(1-3) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中期(3-7) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 長期(7-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 長期(7-11) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 超長期(11-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| B 格以下 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 短期(1-3) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中期(3-7) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 長期(7-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 長期(7-11) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 超長期(11-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 格付なし | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 短期(1-3) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中期(3-7) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 長期(7-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 長期(7-11) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 超長期(11-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |

出所:NFRC

- 格付は、格付会社4社の最高格付をもとに分類

事業債 円建外債 格付別・ポートフォリオ指標 (2024年9月末、10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 | 52,567 | 96.27 | 96.42 | 8.05 | 0.74 | 1.03 | 0.99 | 6.78 | 6.73 | 6.74 | 31 |
| 短期 (1-3) | 15,528 | 99.67 | 99.77 | 2.06 | 0.45 | 0.63 | 0.62 | 2.04 | 2.04 | 2.04 | 28 |
| 中期 (3-7) | 18,911 | 99.39 | 99.53 | 4.77 | 0.68 | 0.79 | 0.79 | 4.69 | 4.67 | 4.69 | 32 |
| 長期 (7-) | 18,128 | 90.09 | 90.31 | 16.60 | 1.06 | 1.67 | 1.57 | 13.65 | 13.53 | 13.53 | 32 |
| 長期 (7-11) | 6,994 | 99.55 | 99.77 | 8.79 | 1.03 | 1.09 | 1.09 | 8.40 | 8.35 | 8.39 | 34 |
| 超長期 (11-) | 11,134 | 84.15 | 84.36 | 21.51 | 1.08 | 2.11 | 1.93 | 17.56 | 17.38 | 17.34 | 31 |
| AAA~A 格 | 73,297 | 96.56 | 96.73 | 7.33 | 0.76 | 1.08 | 1.05 | 6.31 | 6.26 | 6.28 | 41 |
| 短期 (1-3) | 22,556 | 99.57 | 99.69 | 2.07 | 0.51 | 0.72 | 0.72 | 2.06 | 2.05 | 2.06 | 38 |
| 中期 (3-7) | 27,276 | 99.10 | 99.25 | 4.75 | 0.70 | 0.88 | 0.88 | 4.67 | 4.65 | 4.67 | 40 |
| 長期 (7-) | 23,465 | 90.72 | 90.96 | 15.38 | 1.08 | 1.72 | 1.62 | 12.86 | 12.75 | 12.76 | 44 |
| 長期 (7-11) | 9,995 | 98.78 | 99.03 | 8.76 | 1.07 | 1.24 | 1.23 | 8.35 | 8.29 | 8.34 | 48 |
| 超長期 (11-) | 13,471 | 84.74 | 84.97 | 20.30 | 1.09 | 2.14 | 1.96 | 16.77 | 16.60 | 16.58 | 40 |
| AAA~BBB 格 | 73,297 | 96.56 | 96.73 | 7.33 | 0.76 | 1.08 | 1.05 | 6.31 | 6.26 | 6.28 | 41 |
| 短期 (1-3) | 22,556 | 99.57 | 99.69 | 2.07 | 0.51 | 0.72 | 0.72 | 2.06 | 2.05 | 2.06 | 38 |
| 中期 (3-7) | 27,276 | 99.10 | 99.25 | 4.75 | 0.70 | 0.88 | 0.88 | 4.67 | 4.65 | 4.67 | 40 |
| 長期 (7-) | 23,465 | 90.72 | 90.96 | 15.38 | 1.08 | 1.72 | 1.62 | 12.86 | 12.75 | 12.76 | 44 |
| 長期 (7-11) | 9,995 | 98.78 | 99.03 | 8.76 | 1.07 | 1.24 | 1.23 | 8.35 | 8.29 | 8.34 | 48 |
| 超長期 (11-) | 13,471 | 84.74 | 84.97 | 20.30 | 1.09 | 2.14 | 1.96 | 16.77 | 16.60 | 16.58 | 40 |
| AAA~BB 格 | 73,297 | 96.56 | 96.73 | 7.33 | 0.76 | 1.08 | 1.05 | 6.31 | 6.26 | 6.28 | 41 |
| 短期 (1-3) | 22,556 | 99.57 | 99.69 | 2.07 | 0.51 | 0.72 | 0.72 | 2.06 | 2.05 | 2.06 | 38 |
| 中期 (3-7) | 27,276 | 99.10 | 99.25 | 4.75 | 0.70 | 0.88 | 0.88 | 4.67 | 4.65 | 4.67 | 40 |
| 長期 (7-) | 23,465 | 90.72 | 90.96 | 15.38 | 1.08 | 1.72 | 1.62 | 12.86 | 12.75 | 12.76 | 44 |
| 長期 (7-11) | 9,995 | 98.78 | 99.03 | 8.76 | 1.07 | 1.24 | 1.23 | 8.35 | 8.29 | 8.34 | 48 |
| 超長期 (11-) | 13,471 | 84.74 | 84.97 | 20.30 | 1.09 | 2.14 | 1.96 | 16.77 | 16.60 | 16.58 | 40 |
| AAA 格 | 11,570 | 97.57 | 97.66 | 5.51 | 0.44 | 0.75 | 0.73 | 4.79 | 4.76 | 4.77 | 22 |
| 短期 (1-3) | 4,560 | 99.36 | 99.40 | 2.00 | 0.20 | 0.53 | 0.53 | 2.00 | 1.99 | 2.00 | 20 |
| 中期 (3-7) | 5,112 | 98.96 | 99.05 | 4.66 | 0.47 | 0.69 | 0.68 | 4.60 | 4.59 | 4.60 | 21 |
| 長期 (7-) | 1,898 | 89.57 | 89.76 | 16.25 | 0.93 | 1.51 | 1.40 | 12.76 | 12.65 | 12.62 | 27 |
| 長期 (7-11) | 1,096 | 98.75 | 98.94 | 8.66 | 0.85 | 1.02 | 1.01 | 8.34 | 8.30 | 8.34 | 27 |
| 超長期 (11-) | 802 | 77.02 | 77.23 | 26.61 | 1.04 | 2.38 | 2.08 | 20.50 | 20.28 | 20.12 | 27 |
| AA 格 | 40,997 | 95.90 | 96.07 | 8.77 | 0.83 | 1.11 | 1.07 | 7.35 | 7.29 | 7.30 | 33 |
| 短期 (1-3) | 10,969 | 99.80 | 99.93 | 2.08 | 0.56 | 0.66 | 0.66 | 2.06 | 2.06 | 2.06 | 32 |
| 中期 (3-7) | 13,798 | 99.55 | 99.70 | 4.82 | 0.75 | 0.83 | 0.83 | 4.72 | 4.70 | 4.72 | 35 |
| 長期 (7-) | 16,230 | 90.15 | 90.37 | 16.65 | 1.07 | 1.69 | 1.59 | 13.76 | 13.63 | 13.63 | 33 |
| 長期 (7-11) | 5,898 | 99.70 | 99.92 | 8.81 | 1.06 | 1.11 | 1.10 | 8.41 | 8.36 | 8.40 | 35 |
| 超長期 (11-) | 10,332 | 84.71 | 84.92 | 21.12 | 1.08 | 2.09 | 1.92 | 17.35 | 17.17 | 17.15 | 31 |
| A 格 | 20,730 | 97.31 | 97.52 | 5.51 | 0.81 | 1.23 | 1.20 | 5.13 | 5.09 | 5.12 | 65 |
| 短期 (1-3) | 7,028 | 99.35 | 99.50 | 2.10 | 0.62 | 0.94 | 0.94 | 2.09 | 2.08 | 2.09 | 59 |
| 中期 (3-7) | 8,365 | 98.44 | 98.62 | 4.71 | 0.75 | 1.08 | 1.07 | 4.61 | 4.59 | 4.61 | 60 |
| 長期 (7-) | 5,337 | 92.84 | 93.17 | 11.23 | 1.15 | 1.87 | 1.79 | 10.26 | 10.17 | 10.24 | 82 |
| 長期 (7-11) | 3,001 | 96.99 | 97.32 | 8.67 | 1.17 | 1.59 | 1.56 | 8.22 | 8.16 | 8.22 | 82 |
| 超長期 (11-) | 2,336 | 87.51 | 87.84 | 14.53 | 1.13 | 2.26 | 2.12 | 13.16 | 13.02 | 13.12 | 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9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 | 51,383 | 96.19 | 96.34 | 8.11 | 0.73 | 1.02 | 0.99 | 6.81 | 6.76 | 6.77 | 30 |
| 短期 (1-3) | 14,891 | 99.66 | 99.76 | 1.99 | 0.43 | 0.61 | 0.61 | 1.98 | 1.97 | 1.98 | 27 |
| 中期 (3-7) | 18,089 | 99.49 | 99.63 | 4.69 | 0.68 | 0.77 | 0.77 | 4.61 | 4.59 | 4.61 | 30 |
| 長期 (7-) | 18,403 | 90.13 | 90.35 | 16.42 | 1.04 | 1.66 | 1.56 | 13.51 | 13.39 | 13.39 | 32 |
| 長期 (7-11) | 7,260 | 99.35 | 99.57 | 8.65 | 0.99 | 1.08 | 1.08 | 8.28 | 8.24 | 8.28 | 34 |
| 超長期 (11-) | 11,143 | 84.13 | 84.34 | 21.48 | 1.07 | 2.11 | 1.93 | 17.53 | 17.35 | 17.32 | 31 |
| AAA~A格 | 70,303 | 96.44 | 96.60 | 7.44 | 0.74 | 1.07 | 1.04 | 6.38 | 6.34 | 6.35 | 39 |
| 短期 (1-3) | 20,897 | 99.56 | 99.66 | 2.00 | 0.46 | 0.68 | 0.68 | 1.99 | 1.98 | 1.99 | 35 |
| 中期 (3-7) | 25,824 | 99.18 | 99.33 | 4.70 | 0.69 | 0.86 | 0.85 | 4.61 | 4.59 | 4.61 | 38 |
| 長期 (7-) | 23,582 | 90.67 | 90.90 | 15.27 | 1.05 | 1.70 | 1.60 | 12.77 | 12.66 | 12.68 | 43 |
| 長期 (7-11) | 10,219 | 98.64 | 98.89 | 8.65 | 1.03 | 1.22 | 1.21 | 8.26 | 8.21 | 8.26 | 47 |
| 超長期 (11-) | 13,363 | 84.57 | 84.80 | 20.33 | 1.07 | 2.13 | 1.96 | 16.80 | 16.63 | 16.62 | 39 |
| AAA~BBB格 | 70,303 | 96.44 | 96.60 | 7.44 | 0.74 | 1.07 | 1.04 | 6.38 | 6.34 | 6.35 | 39 |
| 短期 (1-3) | 20,897 | 99.56 | 99.66 | 2.00 | 0.46 | 0.68 | 0.68 | 1.99 | 1.98 | 1.99 | 35 |
| 中期 (3-7) | 25,824 | 99.18 | 99.33 | 4.70 | 0.69 | 0.86 | 0.85 | 4.61 | 4.59 | 4.61 | 38 |
| 長期 (7-) | 23,582 | 90.67 | 90.90 | 15.27 | 1.05 | 1.70 | 1.60 | 12.77 | 12.66 | 12.68 | 43 |
| 長期 (7-11) | 10,219 | 98.64 | 98.89 | 8.65 | 1.03 | 1.22 | 1.21 | 8.26 | 8.21 | 8.26 | 47 |
| 超長期 (11-) | 13,363 | 84.57 | 84.80 | 20.33 | 1.07 | 2.13 | 1.96 | 16.80 | 16.63 | 16.62 | 39 |
| AAA~BB格 | 70,303 | 96.44 | 96.60 | 7.44 | 0.74 | 1.07 | 1.04 | 6.38 | 6.34 | 6.35 | 39 |
| 短期 (1-3) | 20,897 | 99.56 | 99.66 | 2.00 | 0.46 | 0.68 | 0.68 | 1.99 | 1.98 | 1.99 | 35 |
| 中期 (3-7) | 25,824 | 99.18 | 99.33 | 4.70 | 0.69 | 0.86 | 0.85 | 4.61 | 4.59 | 4.61 | 38 |
| 長期 (7-) | 23,582 | 90.67 | 90.90 | 15.27 | 1.05 | 1.70 | 1.60 | 12.77 | 12.66 | 12.68 | 43 |
| 長期 (7-11) | 10,219 | 98.64 | 98.89 | 8.65 | 1.03 | 1.22 | 1.21 | 8.26 | 8.21 | 8.26 | 47 |
| 超長期 (11-) | 13,363 | 84.57 | 84.80 | 20.33 | 1.07 | 2.13 | 1.96 | 16.80 | 16.63 | 16.62 | 39 |
| AAA格 | 11,588 | 97.57 | 97.66 | 5.45 | 0.43 | 0.74 | 0.73 | 4.73 | 4.70 | 4.70 | 22 |
| 短期 (1-3) | 4,650 | 99.37 | 99.41 | 1.95 | 0.20 | 0.53 | 0.53 | 1.94 | 1.94 | 1.94 | 20 |
| 中期 (3-7) | 5,003 | 98.95 | 99.04 | 4.61 | 0.47 | 0.68 | 0.68 | 4.55 | 4.53 | 4.55 | 21 |
| 長期 (7-) | 1,935 | 89.72 | 89.92 | 16.05 | 0.92 | 1.49 | 1.38 | 12.62 | 12.52 | 12.48 | 27 |
| 長期 (7-11) | 1,123 | 98.77 | 98.96 | 8.55 | 0.83 | 1.00 | 1.00 | 8.25 | 8.20 | 8.24 | 27 |
| 超長期 (11-) | 812 | 77.20 | 77.41 | 26.42 | 1.03 | 2.36 | 2.06 | 20.36 | 20.14 | 19.98 | 27 |
| AA格 | 39,795 | 95.78 | 95.95 | 8.88 | 0.82 | 1.10 | 1.06 | 7.43 | 7.37 | 7.38 | 33 |
| 短期 (1-3) | 10,241 | 99.80 | 99.91 | 2.01 | 0.53 | 0.64 | 0.64 | 1.99 | 1.99 | 1.99 | 30 |
| 中期 (3-7) | 13,086 | 99.69 | 99.85 | 4.72 | 0.76 | 0.81 | 0.81 | 4.63 | 4.61 | 4.63 | 34 |
| 長期 (7-) | 16,468 | 90.18 | 90.40 | 16.46 | 1.05 | 1.68 | 1.58 | 13.61 | 13.49 | 13.49 | 33 |
| 長期 (7-11) | 6,137 | 99.45 | 99.68 | 8.67 | 1.01 | 1.10 | 1.09 | 8.29 | 8.24 | 8.28 | 35 |
| 超長期 (11-) | 10,331 | 84.67 | 84.89 | 21.09 | 1.08 | 2.09 | 1.92 | 17.33 | 17.16 | 17.13 | 31 |
| A格 | 18,920 | 97.12 | 97.32 | 5.63 | 0.77 | 1.20 | 1.18 | 5.24 | 5.20 | 5.24 | 62 |
| 短期 (1-3) | 6,006 | 99.30 | 99.43 | 2.03 | 0.53 | 0.88 | 0.88 | 2.02 | 2.01 | 2.02 | 54 |
| 中期 (3-7) | 7,735 | 98.47 | 98.65 | 4.71 | 0.73 | 1.05 | 1.04 | 4.62 | 4.59 | 4.62 | 57 |
| 長期 (7-) | 5,179 | 92.56 | 92.88 | 11.18 | 1.10 | 1.85 | 1.76 | 10.23 | 10.14 | 10.21 | 80 |
| 長期 (7-11) | 2,959 | 96.90 | 97.22 | 8.64 | 1.14 | 1.57 | 1.54 | 8.20 | 8.14 | 8.20 | 80 |
| 超長期 (11-) | 2,220 | 86.79 | 87.09 | 14.56 | 1.05 | 2.26 | 2.10 | 13.25 | 13.11 | 13.21 | 81 |
| BBB格 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 短期 (1-3) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中期 (3-7) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 長期 (7-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 長期 (7-11) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 超長期 (11-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| BB格 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 短期 (1-3) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中期 (3-7) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 長期 (7-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 長期 (7-11) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 超長期 (11-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| B格以下 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 短期 (1-3) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中期 (3-7) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 長期 (7-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 長期 (7-11) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 超長期 (11-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 格付なし | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 短期 (1-3) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中期 (3-7) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 長期 (7-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 長期 (7-11) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 超長期 (11-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |

出所:NFRC

- 格付は、格付会社4社の最高格付をもとに分類

事業債 最高格付別・ポートフォリオ指標 (2024年9月末、10月ポートフォリオ)

| | 額面 (10億円) | 時価単価 (円) | 利含単価 (円) | 残存年数 (年) | 利率 (%) | 単利 (%) | 複利 (%) | Dur (年) | M-Dur | E-Dur | Tspd (bp) |
|-----------|--------------|-------------|-------------|-------------|-----------|-----------|-----------|------------|-------|-------|--------------|
| AAA~AA 格 | 51,233 | 96.18 | 96.33 | 8.17 | 0.74 | 1.03 | 0.99 | 6.87 | 6.82 | 6.83 | 30 |
| 短期 (1-3) | 14,813 | 99.67 | 99.77 | 2.05 | 0.44 | 0.61 | 0.61 | 2.04 | 2.03 | 2.04 | 27 |
| 中期 (3-7) | 18,351 | 99.38 | 99.52 | 4.79 | 0.67 | 0.78 | 0.78 | 4.71 | 4.69 | 4.71 | 31 |
| 長期 (7-) | 18,069 | 90.06 | 90.27 | 16.63 | 1.06 | 1.68 | 1.57 | 13.67 | 13.55 | 13.55 | 32 |
| 長期 (7-11) | 6,939 | 99.54 | 99.77 | 8.79 | 1.02 | 1.09 | 1.09 | 8.40 | 8.35 | 8.40 | 33 |
| 超長期 (11-) | 11,130 | 84.15 | 84.36 | 21.52 | 1.08 | 2.11 | 1.93 | 17.56 | 17.38 | 17.34 | 31 |
| AAA~A 格 | 70,172 | 96.43 | 96.60 | 7.49 | 0.75 | 1.08 | 1.04 | 6.43 | 6.39 | 6.40 | 39 |
| 短期 (1-3) | 20,867 | 99.57 | 99.67 | 2.06 | 0.47 | 0.69 | 0.69 | 2.05 | 2.04 | 2.05 | 35 |
| 中期 (3-7) | 26,117 | 99.10 | 99.25 | 4.78 | 0.69 | 0.86 | 0.86 | 4.70 | 4.68 | 4.70 | 39 |
| 長期 (7-) | 23,188 | 90.61 | 90.85 | 15.44 | 1.07 | 1.72 | 1.62 | 12.90 | 12.79 | 12.80 | 43 |
| 長期 (7-11) | 9,838 | 98.78 | 99.04 | 8.76 | 1.06 | 1.23 | 1.22 | 8.35 | 8.30 | 8.35 | 47 |
| 超長期 (11-) | 13,350 | 84.59 | 84.81 | 20.36 | 1.07 | 2.13 | 1.96 | 16.82 | 16.65 | 16.64 | 39 |
| AAA~BBB 格 | 70,172 | 96.43 | 96.60 | 7.49 | 0.75 | 1.08 | 1.04 | 6.43 | 6.39 | 6.40 | 39 |
| 短期 (1-3) | 20,867 | 99.57 | 99.67 | 2.06 | 0.47 | 0.69 | 0.69 | 2.05 | 2.04 | 2.05 | 35 |
| 中期 (3-7) | 26,117 | 99.10 | 99.25 | 4.78 | 0.69 | 0.86 | 0.86 | 4.70 | 4.68 | 4.70 | 39 |
| 長期 (7-) | 23,188 | 90.61 | 90.85 | 15.44 | 1.07 | 1.72 | 1.62 | 12.90 | 12.79 | 12.80 | 43 |
| 長期 (7-11) | 9,838 | 98.78 | 99.04 | 8.76 | 1.06 | 1.23 | 1.22 | 8.35 | 8.30 | 8.35 | 47 |
| 超長期 (11-) | 13,350 | 84.59 | 84.81 | 20.36 | 1.07 | 2.13 | 1.96 | 16.82 | 16.65 | 16.64 | 39 |
| AAA~BB 格 | 70,172 | 96.43 | 96.60 | 7.49 | 0.75 | 1.08 | 1.04 | 6.43 | 6.39 | 6.40 | 39 |
| 短期 (1-3) | 20,867 | 99.57 | 99.67 | 2.06 | 0.47 | 0.69 | 0.69 | 2.05 | 2.04 | 2.05 | 35 |
| 中期 (3-7) | 26,117 | 99.10 | 99.25 | 4.78 | 0.69 | 0.86 | 0.86 | 4.70 | 4.68 | 4.70 | 39 |
| 長期 (7-) | 23,188 | 90.61 | 90.85 | 15.44 | 1.07 | 1.72 | 1.62 | 12.90 | 12.79 | 12.80 | 43 |
| 長期 (7-11) | 9,838 | 98.78 | 99.04 | 8.76 | 1.06 | 1.23 | 1.22 | 8.35 | 8.30 | 8.35 | 47 |
| 超長期 (11-) | 13,350 | 84.59 | 84.81 | 20.36 | 1.07 | 2.13 | 1.96 | 16.82 | 16.65 | 16.64 | 39 |
| AAA 格 | 11,570 | 97.57 | 97.66 | 5.51 | 0.44 | 0.75 | 0.73 | 4.79 | 4.76 | 4.77 | 22 |
| 短期 (1-3) | 4,560 | 99.36 | 99.40 | 2.00 | 0.20 | 0.53 | 0.53 | 2.00 | 1.99 | 2.00 | 20 |
| 中期 (3-7) | 5,112 | 98.96 | 99.05 | 4.66 | 0.47 | 0.69 | 0.68 | 4.60 | 4.59 | 4.60 | 21 |
| 長期 (7-) | 1,898 | 89.57 | 89.76 | 16.25 | 0.93 | 1.51 | 1.40 | 12.76 | 12.65 | 12.62 | 27 |
| 長期 (7-11) | 1,096 | 98.75 | 98.94 | 8.66 | 0.85 | 1.02 | 1.01 | 8.34 | 8.30 | 8.34 | 27 |
| 超長期 (11-) | 802 | 77.02 | 77.23 | 26.61 | 1.04 | 2.38 | 2.08 | 20.50 | 20.28 | 20.12 | 27 |
| AA 格 | 39,663 | 95.77 | 95.94 | 8.95 | 0.83 | 1.11 | 1.07 | 7.49 | 7.43 | 7.44 | 33 |
| 短期 (1-3) | 10,254 | 99.81 | 99.93 | 2.07 | 0.55 | 0.65 | 0.65 | 2.06 | 2.05 | 2.06 | 30 |
| 中期 (3-7) | 13,239 | 99.55 | 99.70 | 4.85 | 0.74 | 0.82 | 0.82 | 4.75 | 4.73 | 4.75 | 34 |
| 長期 (7-) | 16,171 | 90.12 | 90.33 | 16.67 | 1.07 | 1.69 | 1.59 | 13.78 | 13.65 | 13.65 | 32 |
| 長期 (7-11) | 5,843 | 99.69 | 99.92 | 8.82 | 1.06 | 1.10 | 1.10 | 8.41 | 8.36 | 8.41 | 35 |
| 超長期 (11-) | 10,328 | 84.70 | 84.91 | 21.12 | 1.08 | 2.09 | 1.92 | 17.35 | 17.18 | 17.15 | 31 |
| A 格 | 18,939 | 97.12 | 97.32 | 5.65 | 0.77 | 1.21 | 1.18 | 5.26 | 5.22 | 5.26 | 62 |
| 短期 (1-3) | 6,054 | 99.30 | 99.43 | 2.08 | 0.54 | 0.88 | 0.88 | 2.06 | 2.05 | 2.06 | 54 |
| 中期 (3-7) | 7,766 | 98.43 | 98.61 | 4.76 | 0.73 | 1.05 | 1.05 | 4.66 | 4.64 | 4.66 | 57 |
| 長期 (7-) | 5,119 | 92.55 | 92.86 | 11.22 | 1.11 | 1.86 | 1.77 | 10.27 | 10.18 | 10.25 | 80 |
| 長期 (7-11) | 2,899 | 96.95 | 97.29 | 8.67 | 1.16 | 1.58 | 1.54 | 8.23 | 8.17 | 8.22 | 80 |
| 超長期 (11-) | 2,220 | 86.79 | 87.09 | 14.56 | 1.05 | 2.26 | 2.10 | 13.25 | 13.11 | 13.21 | 81 |
| BBB 格 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 短期 (1-3) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中期 (3-7) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 長期 (7-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 長期 (7-11) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 超長期 (11-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| BB 格 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 短期 (1-3) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中期 (3-7) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 長期 (7-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 長期 (7-11) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 超長期 (11-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| B 格以下 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 短期 (1-3) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中期 (3-7) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 長期 (7-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 長期 (7-11) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 超長期 (11-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 格付なし | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 短期 (1-3) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中期 (3-7) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 長期 (7-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 長期 (7-11) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 超長期 (11-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |

出所:NFRC

- 格付は、格付会社4社の最高格付をもとに分類

事業債 最低格付別・ポートフォリオ指標 (2024年9月末)

| | 額面 (10億円) | 時価単価 (円) | 利含単価 (円) | 残存年数 (年) | 利率 (%) | 単利 (%) | 複利 (%) | Dur (年) | M-Dur | E-Dur | Tspd (bp) |
|----------|--------------|-------------|-------------|-------------|-----------|-----------|-----------|------------|-------|-------|--------------|
| AAA~AA格 | 11,404 | 96.08 | 96.23 | 7.02 | 0.64 | 0.98 | 0.94 | 5.81 | 5.77 | 5.77 | 34 |
| 短期(1-3) | 3,665 | 99.61 | 99.72 | 1.92 | 0.44 | 0.64 | 0.64 | 1.91 | 1.91 | 1.91 | 31 |
| 中期(3-7) | 4,666 | 99.06 | 99.21 | 4.48 | 0.61 | 0.82 | 0.82 | 4.41 | 4.39 | 4.41 | 36 |
| 長期(7-) | 3,074 | 87.35 | 87.54 | 16.95 | 0.91 | 1.71 | 1.57 | 13.50 | 13.38 | 13.35 | 36 |
| 長期(7-11) | 1,320 | 98.38 | 98.63 | 8.64 | 0.89 | 1.11 | 1.11 | 8.30 | 8.25 | 8.29 | 37 |
| 超長期(11-) | 1,753 | 79.04 | 79.19 | 23.22 | 0.93 | 2.26 | 2.01 | 18.39 | 18.19 | 18.10 | 35 |
| AAA~A格 | 68,068 | 96.43 | 96.59 | 7.46 | 0.74 | 1.07 | 1.03 | 6.39 | 6.34 | 6.36 | 38 |
| 短期(1-3) | 20,494 | 99.57 | 99.67 | 2.00 | 0.46 | 0.68 | 0.68 | 1.99 | 1.98 | 1.99 | 34 |
| 中期(3-7) | 24,657 | 99.16 | 99.31 | 4.70 | 0.68 | 0.85 | 0.84 | 4.61 | 4.59 | 4.61 | 37 |
| 長期(7-) | 22,917 | 90.67 | 90.91 | 15.31 | 1.05 | 1.70 | 1.60 | 12.80 | 12.68 | 12.69 | 43 |
| 長期(7-11) | 9,901 | 98.67 | 98.92 | 8.65 | 1.03 | 1.22 | 1.21 | 8.26 | 8.21 | 8.25 | 47 |
| 超長期(11-) | 13,016 | 84.59 | 84.81 | 20.38 | 1.07 | 2.13 | 1.95 | 16.82 | 16.65 | 16.63 | 39 |
| AAA~BBB格 | 70,063 | 96.42 | 96.59 | 7.45 | 0.74 | 1.07 | 1.03 | 6.39 | 6.34 | 6.36 | 38 |
| 短期(1-3) | 20,897 | 99.56 | 99.66 | 2.00 | 0.46 | 0.68 | 0.68 | 1.99 | 1.98 | 1.99 | 35 |
| 中期(3-7) | 25,609 | 99.16 | 99.31 | 4.70 | 0.68 | 0.85 | 0.84 | 4.62 | 4.60 | 4.61 | 38 |
| 長期(7-) | 23,557 | 90.66 | 90.90 | 15.27 | 1.05 | 1.70 | 1.60 | 12.77 | 12.66 | 12.67 | 43 |
| 長期(7-11) | 10,219 | 98.64 | 98.89 | 8.65 | 1.03 | 1.22 | 1.21 | 8.26 | 8.21 | 8.26 | 47 |
| 超長期(11-) | 13,338 | 84.55 | 84.78 | 20.34 | 1.07 | 2.13 | 1.95 | 16.81 | 16.64 | 16.62 | 39 |
| AAA~BB格 | 70,303 | 96.44 | 96.60 | 7.44 | 0.74 | 1.07 | 1.04 | 6.38 | 6.34 | 6.35 | 39 |
| 短期(1-3) | 20,897 | 99.56 | 99.66 | 2.00 | 0.46 | 0.68 | 0.68 | 1.99 | 1.98 | 1.99 | 35 |
| 中期(3-7) | 25,824 | 99.18 | 99.33 | 4.70 | 0.69 | 0.86 | 0.85 | 4.61 | 4.59 | 4.61 | 38 |
| 長期(7-) | 23,582 | 90.67 | 90.90 | 15.27 | 1.05 | 1.70 | 1.60 | 12.77 | 12.66 | 12.68 | 43 |
| 長期(7-11) | 10,219 | 98.64 | 98.89 | 8.65 | 1.03 | 1.22 | 1.21 | 8.26 | 8.21 | 8.26 | 47 |
| 超長期(11-) | 13,363 | 84.57 | 84.80 | 20.33 | 1.07 | 2.13 | 1.96 | 16.80 | 16.63 | 16.62 | 39 |
| AAA格 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 短期(1-3) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中期(3-7) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 長期(7-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 長期(7-11) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 超長期(11-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| AA格 | 11,404 | 96.08 | 96.23 | 7.02 | 0.64 | 0.98 | 0.94 | 5.81 | 5.77 | 5.77 | 34 |
| 短期(1-3) | 3,665 | 99.61 | 99.72 | 1.92 | 0.44 | 0.64 | 0.64 | 1.91 | 1.91 | 1.91 | 31 |
| 中期(3-7) | 4,666 | 99.06 | 99.21 | 4.48 | 0.61 | 0.82 | 0.82 | 4.41 | 4.39 | 4.41 | 36 |
| 長期(7-) | 3,074 | 87.35 | 87.54 | 16.95 | 0.91 | 1.71 | 1.57 | 13.50 | 13.38 | 13.35 | 36 |
| 長期(7-11) | 1,320 | 98.38 | 98.63 | 8.64 | 0.89 | 1.11 | 1.11 | 8.30 | 8.25 | 8.29 | 37 |
| 超長期(11-) | 1,753 | 79.04 | 79.19 | 23.22 | 0.93 | 2.26 | 2.01 | 18.39 | 18.19 | 18.10 | 35 |
| A格 | 56,664 | 96.50 | 96.66 | 7.54 | 0.76 | 1.08 | 1.05 | 6.51 | 6.46 | 6.48 | 39 |
| 短期(1-3) | 16,829 | 99.56 | 99.66 | 2.01 | 0.46 | 0.69 | 0.69 | 2.00 | 2.00 | 2.00 | 35 |
| 中期(3-7) | 19,992 | 99.19 | 99.34 | 4.75 | 0.69 | 0.85 | 0.85 | 4.66 | 4.64 | 4.66 | 38 |
| 長期(7-) | 19,843 | 91.19 | 91.43 | 15.05 | 1.07 | 1.70 | 1.60 | 12.69 | 12.58 | 12.60 | 44 |
| 長期(7-11) | 8,581 | 98.72 | 98.97 | 8.65 | 1.05 | 1.23 | 1.22 | 8.25 | 8.20 | 8.25 | 48 |
| 超長期(11-) | 11,262 | 85.45 | 85.68 | 19.93 | 1.09 | 2.11 | 1.94 | 16.60 | 16.43 | 16.42 | 39 |
| BBB格 | 1,995 | 96.24 | 96.43 | 7.09 | 0.73 | 1.17 | 1.13 | 6.35 | 6.30 | 6.33 | 49 |
| 短期(1-3) | 403 | 98.97 | 99.06 | 2.14 | 0.37 | 0.86 | 0.85 | 2.13 | 2.13 | 2.13 | 50 |
| 中期(3-7) | 952 | 99.01 | 99.19 | 4.72 | 0.70 | 0.93 | 0.92 | 4.63 | 4.61 | 4.63 | 45 |
| 長期(7-) | 641 | 90.40 | 90.66 | 13.72 | 1.00 | 1.77 | 1.67 | 12.04 | 11.93 | 11.98 | 55 |
| 長期(7-11) | 318 | 97.58 | 97.87 | 8.70 | 1.01 | 1.35 | 1.32 | 8.32 | 8.26 | 8.31 | 58 |
| 超長期(11-) | 323 | 83.31 | 83.55 | 18.67 | 0.99 | 2.27 | 2.07 | 16.33 | 16.16 | 16.22 | 52 |
| BB格 | 240 | 101.16 | 101.59 | 5.66 | 2.26 | 1.87 | 1.87 | 5.13 | 5.08 | 5.12 | 133 |
| 短期(1-3) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中期(3-7) | 215 | 101.98 | 102.36 | 4.50 | 2.25 | 1.76 | 1.77 | 4.29 | 4.25 | 4.28 | 131 |
| 長期(7-) | 25 | 94.15 | 94.96 | 15.66 | 2.37 | 2.91 | 2.83 | 12.97 | 12.79 | 12.89 | 147 |
| 長期(7-11) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 超長期(11-) | 25 | 94.15 | 94.96 | 15.66 | 2.37 | 2.91 | 2.83 | 12.97 | 12.79 | 12.89 | 147 |
| B格以下 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 短期(1-3) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中期(3-7) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 長期(7-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 長期(7-11) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 超長期(11-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 格付なし | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 短期(1-3) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中期(3-7) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 長期(7-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 長期(7-11) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 超長期(11-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |

出所:NFRC

- 格付は、格付会社4社の最低格付をもとに分類

事業債 最低格付別・ポートフォリオ指標 (2024年9月末、10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 | 11,636 | 96.03 | 96.18 | 7.17 | 0.65 | 0.99 | 0.96 | 5.96 | 5.92 | 5.93 | 34 |
| 短期 (1-3) | 3,731 | 99.57 | 99.68 | 2.03 | 0.44 | 0.65 | 0.65 | 2.02 | 2.02 | 2.02 | 31 |
| 中期 (3-7) | 4,636 | 99.03 | 99.18 | 4.59 | 0.61 | 0.83 | 0.83 | 4.52 | 4.50 | 4.52 | 36 |
| 長期 (7-) | 3,269 | 87.74 | 87.93 | 16.71 | 0.93 | 1.69 | 1.56 | 13.38 | 13.26 | 13.24 | 36 |
| 長期 (7-11) | 1,450 | 98.50 | 98.74 | 8.77 | 0.92 | 1.12 | 1.12 | 8.41 | 8.36 | 8.40 | 37 |
| 超長期 (11-) | 1,818 | 79.15 | 79.31 | 23.04 | 0.93 | 2.26 | 2.01 | 18.32 | 18.13 | 18.04 | 35 |
| AAA~A 格 | 67,924 | 96.42 | 96.58 | 7.51 | 0.74 | 1.07 | 1.04 | 6.44 | 6.40 | 6.41 | 38 |
| 短期 (1-3) | 20,464 | 99.58 | 99.68 | 2.06 | 0.47 | 0.69 | 0.69 | 2.04 | 2.04 | 2.04 | 35 |
| 中期 (3-7) | 24,938 | 99.08 | 99.22 | 4.79 | 0.67 | 0.85 | 0.85 | 4.70 | 4.68 | 4.70 | 38 |
| 長期 (7-) | 22,522 | 90.61 | 90.85 | 15.48 | 1.07 | 1.71 | 1.61 | 12.93 | 12.81 | 12.83 | 42 |
| 長期 (7-11) | 9,520 | 98.82 | 99.07 | 8.76 | 1.07 | 1.23 | 1.21 | 8.35 | 8.30 | 8.35 | 47 |
| 超長期 (11-) | 13,003 | 84.60 | 84.82 | 20.41 | 1.07 | 2.13 | 1.95 | 16.84 | 16.67 | 16.66 | 39 |
| AAA~BBB 格 | 69,932 | 96.42 | 96.58 | 7.50 | 0.74 | 1.07 | 1.04 | 6.44 | 6.39 | 6.41 | 38 |
| 短期 (1-3) | 20,867 | 99.57 | 99.67 | 2.06 | 0.47 | 0.69 | 0.69 | 2.05 | 2.04 | 2.05 | 35 |
| 中期 (3-7) | 25,902 | 99.08 | 99.22 | 4.79 | 0.67 | 0.86 | 0.85 | 4.70 | 4.68 | 4.70 | 38 |
| 長期 (7-) | 23,163 | 90.61 | 90.84 | 15.44 | 1.07 | 1.71 | 1.61 | 12.90 | 12.79 | 12.80 | 43 |
| 長期 (7-11) | 9,838 | 98.78 | 99.04 | 8.76 | 1.06 | 1.23 | 1.22 | 8.35 | 8.30 | 8.35 | 47 |
| 超長期 (11-) | 13,325 | 84.57 | 84.79 | 20.37 | 1.07 | 2.13 | 1.96 | 16.83 | 16.66 | 16.65 | 39 |
| AAA~BB 格 | 70,172 | 96.43 | 96.60 | 7.49 | 0.75 | 1.08 | 1.04 | 6.43 | 6.39 | 6.40 | 39 |
| 短期 (1-3) | 20,867 | 99.57 | 99.67 | 2.06 | 0.47 | 0.69 | 0.69 | 2.05 | 2.04 | 2.05 | 35 |
| 中期 (3-7) | 26,117 | 99.10 | 99.25 | 4.78 | 0.69 | 0.86 | 0.86 | 4.70 | 4.68 | 4.70 | 39 |
| 長期 (7-) | 23,188 | 90.61 | 90.85 | 15.44 | 1.07 | 1.72 | 1.62 | 12.90 | 12.79 | 12.80 | 43 |
| 長期 (7-11) | 9,838 | 98.78 | 99.04 | 8.76 | 1.06 | 1.23 | 1.22 | 8.35 | 8.30 | 8.35 | 47 |
| 超長期 (11-) | 13,350 | 84.59 | 84.81 | 20.36 | 1.07 | 2.13 | 1.96 | 16.82 | 16.65 | 16.64 | 39 |
| AAA 格 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 短期 (1-3) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中期 (3-7) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 長期 (7-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 長期 (7-11) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 超長期 (11-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| AA 格 | 11,636 | 96.03 | 96.18 | 7.17 | 0.65 | 0.99 | 0.96 | 5.96 | 5.92 | 5.93 | 34 |
| 短期 (1-3) | 3,731 | 99.57 | 99.68 | 2.03 | 0.44 | 0.65 | 0.65 | 2.02 | 2.02 | 2.02 | 31 |
| 中期 (3-7) | 4,636 | 99.03 | 99.18 | 4.59 | 0.61 | 0.83 | 0.83 | 4.52 | 4.50 | 4.52 | 36 |
| 長期 (7-) | 3,269 | 87.74 | 87.93 | 16.71 | 0.93 | 1.69 | 1.56 | 13.38 | 13.26 | 13.24 | 36 |
| 長期 (7-11) | 1,450 | 98.50 | 98.74 | 8.77 | 0.92 | 1.12 | 1.12 | 8.41 | 8.36 | 8.40 | 37 |
| 超長期 (11-) | 1,818 | 79.15 | 79.31 | 23.04 | 0.93 | 2.26 | 2.01 | 18.32 | 18.13 | 18.04 | 35 |
| A 格 | 56,289 | 96.50 | 96.67 | 7.58 | 0.76 | 1.09 | 1.05 | 6.54 | 6.49 | 6.51 | 39 |
| 短期 (1-3) | 16,733 | 99.58 | 99.68 | 2.06 | 0.48 | 0.70 | 0.70 | 2.05 | 2.04 | 2.05 | 35 |
| 中期 (3-7) | 20,302 | 99.09 | 99.23 | 4.83 | 0.68 | 0.86 | 0.85 | 4.74 | 4.72 | 4.74 | 38 |
| 長期 (7-) | 19,254 | 91.10 | 91.34 | 15.28 | 1.10 | 1.72 | 1.62 | 12.85 | 12.74 | 12.76 | 43 |
| 長期 (7-11) | 8,069 | 98.88 | 99.13 | 8.76 | 1.09 | 1.25 | 1.23 | 8.34 | 8.29 | 8.34 | 48 |
| 超長期 (11-) | 11,184 | 85.49 | 85.72 | 19.98 | 1.10 | 2.11 | 1.94 | 16.62 | 16.45 | 16.45 | 39 |
| BBB 格 | 2,007 | 96.24 | 96.43 | 7.08 | 0.73 | 1.17 | 1.13 | 6.34 | 6.30 | 6.33 | 49 |
| 短期 (1-3) | 403 | 98.97 | 99.06 | 2.14 | 0.37 | 0.86 | 0.85 | 2.13 | 2.13 | 2.13 | 50 |
| 中期 (3-7) | 964 | 98.99 | 99.17 | 4.73 | 0.70 | 0.93 | 0.92 | 4.64 | 4.62 | 4.64 | 45 |
| 長期 (7-) | 641 | 90.40 | 90.66 | 13.72 | 1.00 | 1.77 | 1.67 | 12.04 | 11.93 | 11.98 | 55 |
| 長期 (7-11) | 318 | 97.58 | 97.87 | 8.70 | 1.01 | 1.35 | 1.32 | 8.32 | 8.26 | 8.31 | 58 |
| 超長期 (11-) | 323 | 83.31 | 83.55 | 18.67 | 0.99 | 2.27 | 2.07 | 16.33 | 16.16 | 16.22 | 52 |
| BB 格 | 240 | 101.16 | 101.59 | 5.66 | 2.26 | 1.87 | 1.87 | 5.13 | 5.08 | 5.12 | 133 |
| 短期 (1-3) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中期 (3-7) | 215 | 101.98 | 102.36 | 4.50 | 2.25 | 1.76 | 1.77 | 4.29 | 4.25 | 4.28 | 131 |
| 長期 (7-) | 25 | 94.15 | 94.96 | 15.66 | 2.37 | 2.91 | 2.83 | 12.97 | 12.79 | 12.89 | 147 |
| 長期 (7-11) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 超長期 (11-) | 25 | 94.15 | 94.96 | 15.66 | 2.37 | 2.91 | 2.83 | 12.97 | 12.79 | 12.89 | 147 |
| B 格以下 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 短期 (1-3) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中期 (3-7) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 長期 (7-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 長期 (7-11) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 超長期 (11-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 格付なし | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 短期 (1-3) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中期 (3-7) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 長期 (7-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 長期 (7-11) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 超長期 (11-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |

出所:NFRC

- 格付は、格付会社 4 社の最低格付をもとに分類

事業債 R&I 格付別・ポートフォリオ指標 (2024年9月末)

| | 額面 (10億円) | 時価単価 (円) | 利含単価 (円) | 残存年数 (年) | 利率 (%) | 単利 (%) | 複利 (%) | Dur (年) | M-Dur | E-Dur | Tspd (bp) |
|-----------|--------------|-------------|-------------|-------------|-----------|-----------|-----------|------------|-------|-------|--------------|
| AAA~AA 格 | 41,052 | 96.09 | 96.24 | 8.63 | 0.77 | 1.02 | 0.98 | 7.14 | 7.09 | 7.09 | 27 |
| 短期 (1-3) | 11,668 | 99.73 | 99.82 | 2.01 | 0.43 | 0.58 | 0.58 | 2.00 | 1.99 | 2.00 | 24 |
| 中期 (3-7) | 13,897 | 99.86 | 100.00 | 4.67 | 0.72 | 0.74 | 0.74 | 4.59 | 4.57 | 4.59 | 27 |
| 長期 (7-) | 15,487 | 89.96 | 90.17 | 17.18 | 1.08 | 1.67 | 1.56 | 13.97 | 13.84 | 13.83 | 29 |
| 長期 (7-11) | 5,751 | 99.99 | 100.20 | 8.78 | 1.04 | 1.05 | 1.05 | 8.38 | 8.34 | 8.38 | 30 |
| 超長期 (11-) | 9,736 | 84.04 | 84.25 | 22.14 | 1.10 | 2.11 | 1.93 | 17.89 | 17.71 | 17.66 | 28 |
| AAA~A 格 | 64,216 | 96.37 | 96.53 | 7.67 | 0.75 | 1.06 | 1.03 | 6.54 | 6.49 | 6.50 | 36 |
| 短期 (1-3) | 18,951 | 99.59 | 99.69 | 2.01 | 0.44 | 0.66 | 0.65 | 2.00 | 1.99 | 2.00 | 32 |
| 中期 (3-7) | 23,013 | 99.31 | 99.45 | 4.71 | 0.70 | 0.84 | 0.83 | 4.62 | 4.60 | 4.62 | 36 |
| 長期 (7-) | 22,252 | 90.59 | 90.82 | 15.54 | 1.05 | 1.69 | 1.59 | 12.95 | 12.84 | 12.85 | 40 |
| 長期 (7-11) | 9,401 | 98.86 | 99.10 | 8.68 | 1.02 | 1.18 | 1.17 | 8.29 | 8.24 | 8.28 | 43 |
| 超長期 (11-) | 12,851 | 84.54 | 84.76 | 20.57 | 1.08 | 2.13 | 1.95 | 16.94 | 16.77 | 16.75 | 38 |
| AAA~BBB 格 | 64,366 | 96.37 | 96.53 | 7.66 | 0.75 | 1.06 | 1.03 | 6.53 | 6.49 | 6.50 | 37 |
| 短期 (1-3) | 19,014 | 99.58 | 99.68 | 2.01 | 0.44 | 0.66 | 0.66 | 2.00 | 1.99 | 2.00 | 32 |
| 中期 (3-7) | 23,089 | 99.30 | 99.45 | 4.70 | 0.70 | 0.84 | 0.84 | 4.62 | 4.60 | 4.62 | 37 |
| 長期 (7-) | 22,263 | 90.58 | 90.82 | 15.54 | 1.05 | 1.69 | 1.59 | 12.95 | 12.83 | 12.85 | 40 |
| 長期 (7-11) | 9,412 | 98.84 | 99.08 | 8.67 | 1.02 | 1.18 | 1.17 | 8.29 | 8.24 | 8.28 | 43 |
| 超長期 (11-) | 12,851 | 84.54 | 84.76 | 20.57 | 1.08 | 2.13 | 1.95 | 16.94 | 16.77 | 16.75 | 38 |
| AAA~BB 格 | 64,366 | 96.37 | 96.53 | 7.66 | 0.75 | 1.06 | 1.03 | 6.53 | 6.49 | 6.50 | 37 |
| 短期 (1-3) | 19,014 | 99.58 | 99.68 | 2.01 | 0.44 | 0.66 | 0.66 | 2.00 | 1.99 | 2.00 | 32 |
| 中期 (3-7) | 23,089 | 99.30 | 99.45 | 4.70 | 0.70 | 0.84 | 0.84 | 4.62 | 4.60 | 4.62 | 37 |
| 長期 (7-) | 22,263 | 90.58 | 90.82 | 15.54 | 1.05 | 1.69 | 1.59 | 12.95 | 12.83 | 12.85 | 40 |
| 長期 (7-11) | 9,412 | 98.84 | 99.08 | 8.67 | 1.02 | 1.18 | 1.17 | 8.29 | 8.24 | 8.28 | 43 |
| 超長期 (11-) | 12,851 | 84.54 | 84.76 | 20.57 | 1.08 | 2.13 | 1.95 | 16.94 | 16.77 | 16.75 | 38 |
| AAA 格 | 955 | 98.55 | 98.66 | 3.62 | 0.31 | 0.69 | 0.68 | 3.53 | 3.52 | 3.53 | 26 |
| 短期 (1-3) | 505 | 99.26 | 99.33 | 1.93 | 0.19 | 0.58 | 0.58 | 1.93 | 1.92 | 1.93 | 25 |
| 中期 (3-7) | 350 | 98.60 | 98.75 | 4.37 | 0.41 | 0.72 | 0.71 | 4.32 | 4.30 | 4.32 | 26 |
| 長期 (7-) | 100 | 94.78 | 94.97 | 9.47 | 0.57 | 1.14 | 1.11 | 9.15 | 9.10 | 9.14 | 29 |
| 長期 (7-11) | 70 | 97.11 | 97.32 | 8.38 | 0.62 | 1.00 | 0.99 | 8.16 | 8.12 | 8.16 | 28 |
| 超長期 (11-) | 30 | 89.35 | 89.50 | 12.01 | 0.45 | 1.50 | 1.42 | 11.66 | 11.58 | 11.65 | 31 |
| AA 格 | 40,097 | 96.03 | 96.18 | 8.75 | 0.79 | 1.03 | 0.99 | 7.23 | 7.17 | 7.18 | 27 |
| 短期 (1-3) | 11,163 | 99.75 | 99.84 | 2.01 | 0.44 | 0.58 | 0.58 | 2.00 | 1.99 | 2.00 | 24 |
| 中期 (3-7) | 13,547 | 99.89 | 100.03 | 4.68 | 0.73 | 0.74 | 0.74 | 4.59 | 4.58 | 4.59 | 27 |
| 長期 (7-) | 15,387 | 89.93 | 90.14 | 17.23 | 1.08 | 1.68 | 1.57 | 14.00 | 13.88 | 13.86 | 29 |
| 長期 (7-11) | 5,681 | 100.02 | 100.24 | 8.78 | 1.05 | 1.05 | 1.05 | 8.38 | 8.34 | 8.38 | 30 |
| 超長期 (11-) | 9,706 | 84.02 | 84.23 | 22.18 | 1.10 | 2.11 | 1.93 | 17.91 | 17.73 | 17.68 | 28 |
| A 格 | 23,165 | 96.87 | 97.05 | 5.95 | 0.70 | 1.12 | 1.10 | 5.49 | 5.45 | 5.48 | 53 |
| 短期 (1-3) | 7,283 | 99.37 | 99.48 | 2.02 | 0.46 | 0.78 | 0.77 | 2.01 | 2.00 | 2.01 | 44 |
| 中期 (3-7) | 9,116 | 98.46 | 98.63 | 4.76 | 0.67 | 0.98 | 0.98 | 4.68 | 4.65 | 4.68 | 51 |
| 長期 (7-) | 6,765 | 92.03 | 92.31 | 11.79 | 0.99 | 1.73 | 1.65 | 10.68 | 10.59 | 10.66 | 66 |
| 長期 (7-11) | 3,650 | 97.09 | 97.38 | 8.51 | 0.98 | 1.38 | 1.36 | 8.14 | 8.08 | 8.13 | 64 |
| 超長期 (11-) | 3,115 | 86.10 | 86.37 | 15.64 | 1.01 | 2.19 | 2.04 | 14.05 | 13.90 | 13.99 | 68 |
| BBB 格 | 150 | 96.24 | 96.52 | 3.58 | 1.02 | 2.05 | 2.00 | 3.44 | 3.40 | 3.44 | 158 |
| 短期 (1-3) | 63 | 97.61 | 97.82 | 2.13 | 0.82 | 1.98 | 1.96 | 2.11 | 2.09 | 2.11 | 161 |
| 中期 (3-7) | 76 | 97.68 | 97.99 | 4.24 | 1.17 | 1.75 | 1.73 | 4.13 | 4.10 | 4.13 | 128 |
| 長期 (7-) | 11 | 78.56 | 78.87 | 7.21 | 1.07 | 5.15 | 4.60 | 6.89 | 6.74 | 6.89 | 401 |
| 長期 (7-11) | 11 | 78.56 | 78.87 | 7.21 | 1.07 | 5.15 | 4.60 | 6.89 | 6.74 | 6.89 | 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 | 5,937 | 97.19 | 97.38 | 5.09 | 0.70 | 1.17 | 1.14 | 4.80 | 4.77 | 4.80 | 63 |
| 短期 (1-3) | 1,883 | 99.31 | 99.47 | 1.88 | 0.59 | 0.94 | 0.93 | 1.86 | 1.86 | 1.86 | 61 |
| 中期 (3-7) | 2,735 | 98.19 | 98.35 | 4.63 | 0.61 | 1.01 | 1.00 | 4.55 | 4.53 | 4.55 | 53 |
| 長期 (7-) | 1,319 | 92.08 | 92.38 | 10.64 | 1.04 | 1.90 | 1.78 | 9.87 | 9.78 | 9.85 | 86 |
| 長期 (7-11) | 807 | 96.31 | 96.65 | 8.34 | 1.16 | 1.72 | 1.64 | 7.93 | 7.87 | 7.93 | 94 |
| 超長期 (11-) | 512 | 85.43 | 85.66 | 14.28 | 0.85 | 2.21 | 2.02 | 13.31 | 13.18 | 13.28 | 73 |

出所:NFRC

- 格付は、R&I の格付をもとに NFRC で分類

事業債 R&I 格付別・ポートフォリオ指標 (2024年9月末、10月ポートフォリオ)

| | 額面 (10億円) | 時価単価 (円) | 利含単価 (円) | 残存年数 (年) | 利率 (%) | 単利 (%) | 複利 (%) | Dur (年) | M-Dur | E-Dur | Tspd (bp) |
|-----------|--------------|-------------|-------------|-------------|-----------|-----------|-----------|------------|-------|-------|--------------|
| AAA~AA 格 | 41,256 | 96.07 | 96.22 | 8.70 | 0.78 | 1.03 | 0.99 | 7.21 | 7.16 | 7.16 | 27 |
| 短期 (1-3) | 11,630 | 99.75 | 99.84 | 2.07 | 0.45 | 0.59 | 0.59 | 2.06 | 2.05 | 2.06 | 24 |
| 中期 (3-7) | 14,044 | 99.80 | 99.93 | 4.75 | 0.71 | 0.74 | 0.74 | 4.66 | 4.64 | 4.66 | 27 |
| 長期 (7-) | 15,583 | 89.97 | 90.18 | 17.22 | 1.09 | 1.68 | 1.57 | 14.01 | 13.88 | 13.87 | 29 |
| 長期 (7-11) | 5,764 | 100.03 | 100.25 | 8.86 | 1.06 | 1.06 | 1.06 | 8.45 | 8.40 | 8.45 | 30 |
| 超長期 (11-) | 9,818 | 84.06 | 84.27 | 22.12 | 1.10 | 2.11 | 1.93 | 17.89 | 17.71 | 17.65 | 28 |
| AAA~A 格 | 64,051 | 96.36 | 96.52 | 7.72 | 0.75 | 1.06 | 1.03 | 6.59 | 6.55 | 6.56 | 36 |
| 短期 (1-3) | 18,866 | 99.60 | 99.70 | 2.07 | 0.46 | 0.66 | 0.66 | 2.06 | 2.05 | 2.06 | 32 |
| 中期 (3-7) | 23,287 | 99.22 | 99.36 | 4.79 | 0.69 | 0.84 | 0.84 | 4.71 | 4.69 | 4.71 | 37 |
| 長期 (7-) | 21,898 | 90.53 | 90.77 | 15.71 | 1.07 | 1.70 | 1.60 | 13.08 | 12.97 | 12.97 | 40 |
| 長期 (7-11) | 9,060 | 99.01 | 99.25 | 8.79 | 1.05 | 1.18 | 1.18 | 8.38 | 8.33 | 8.38 | 43 |
| 超長期 (11-) | 12,838 | 84.55 | 84.78 | 20.60 | 1.08 | 2.13 | 1.95 | 16.97 | 16.79 | 16.77 | 38 |
| AAA~BBB 格 | 64,213 | 96.36 | 96.53 | 7.71 | 0.75 | 1.07 | 1.03 | 6.59 | 6.54 | 6.55 | 37 |
| 短期 (1-3) | 18,929 | 99.60 | 99.70 | 2.07 | 0.46 | 0.67 | 0.66 | 2.06 | 2.05 | 2.06 | 32 |
| 中期 (3-7) | 23,375 | 99.21 | 99.36 | 4.79 | 0.69 | 0.85 | 0.84 | 4.70 | 4.68 | 4.70 | 37 |
| 長期 (7-) | 21,909 | 90.53 | 90.76 | 15.71 | 1.07 | 1.70 | 1.60 | 13.08 | 12.96 | 12.97 | 40 |
| 長期 (7-11) | 9,071 | 98.98 | 99.23 | 8.79 | 1.05 | 1.19 | 1.18 | 8.38 | 8.33 | 8.38 | 43 |
| 超長期 (11-) | 12,838 | 84.55 | 84.78 | 20.60 | 1.08 | 2.13 | 1.95 | 16.97 | 16.79 | 16.77 | 38 |
| AAA~BB 格 | 64,213 | 96.36 | 96.53 | 7.71 | 0.75 | 1.07 | 1.03 | 6.59 | 6.54 | 6.55 | 37 |
| 短期 (1-3) | 18,929 | 99.60 | 99.70 | 2.07 | 0.46 | 0.67 | 0.66 | 2.06 | 2.05 | 2.06 | 32 |
| 中期 (3-7) | 23,375 | 99.21 | 99.36 | 4.79 | 0.69 | 0.85 | 0.84 | 4.70 | 4.68 | 4.70 | 37 |
| 長期 (7-) | 21,909 | 90.53 | 90.76 | 15.71 | 1.07 | 1.70 | 1.60 | 13.08 | 12.96 | 12.97 | 40 |
| 長期 (7-11) | 9,071 | 98.98 | 99.23 | 8.79 | 1.05 | 1.19 | 1.18 | 8.38 | 8.33 | 8.38 | 43 |
| 超長期 (11-) | 12,838 | 84.55 | 84.78 | 20.60 | 1.08 | 2.13 | 1.95 | 16.97 | 16.79 | 16.77 | 38 |
| AAA 格 | 885 | 98.46 | 98.58 | 3.82 | 0.32 | 0.71 | 0.70 | 3.73 | 3.72 | 3.73 | 26 |
| 短期 (1-3) | 465 | 99.18 | 99.26 | 2.14 | 0.20 | 0.61 | 0.60 | 2.13 | 2.13 | 2.13 | 26 |
| 中期 (3-7) | 320 | 98.55 | 98.70 | 4.49 | 0.42 | 0.72 | 0.72 | 4.44 | 4.42 | 4.44 | 26 |
| 長期 (7-) | 100 | 94.78 | 94.97 | 9.47 | 0.57 | 1.14 | 1.11 | 9.15 | 9.10 | 9.14 | 29 |
| 長期 (7-11) | 70 | 97.11 | 97.32 | 8.38 | 0.62 | 1.00 | 0.99 | 8.16 | 8.12 | 8.16 | 28 |
| 超長期 (11-) | 30 | 89.35 | 89.50 | 12.01 | 0.45 | 1.50 | 1.42 | 11.66 | 11.58 | 11.65 | 31 |
| AA 格 | 40,371 | 96.02 | 96.17 | 8.81 | 0.79 | 1.04 | 1.00 | 7.29 | 7.23 | 7.24 | 27 |
| 短期 (1-3) | 11,165 | 99.77 | 99.87 | 2.07 | 0.46 | 0.58 | 0.58 | 2.06 | 2.05 | 2.06 | 24 |
| 中期 (3-7) | 13,724 | 99.83 | 99.96 | 4.75 | 0.72 | 0.75 | 0.74 | 4.67 | 4.65 | 4.67 | 27 |
| 長期 (7-) | 15,483 | 89.94 | 90.15 | 17.27 | 1.09 | 1.68 | 1.57 | 14.04 | 13.91 | 13.90 | 29 |
| 長期 (7-11) | 5,694 | 100.07 | 100.29 | 8.87 | 1.07 | 1.06 | 1.06 | 8.45 | 8.41 | 8.45 | 30 |
| 超長期 (11-) | 9,788 | 84.05 | 84.26 | 22.16 | 1.11 | 2.11 | 1.93 | 17.91 | 17.73 | 17.67 | 28 |
| A 格 | 22,795 | 96.89 | 97.07 | 5.95 | 0.70 | 1.13 | 1.10 | 5.49 | 5.45 | 5.48 | 53 |
| 短期 (1-3) | 7,236 | 99.37 | 99.48 | 2.07 | 0.47 | 0.78 | 0.78 | 2.06 | 2.05 | 2.06 | 44 |
| 中期 (3-7) | 9,243 | 98.34 | 98.50 | 4.86 | 0.66 | 0.99 | 0.99 | 4.77 | 4.75 | 4.77 | 51 |
| 長期 (7-) | 6,315 | 91.92 | 92.21 | 12.00 | 1.03 | 1.76 | 1.68 | 10.85 | 10.75 | 10.82 | 67 |
| 長期 (7-11) | 3,295 | 97.21 | 97.51 | 8.66 | 1.03 | 1.41 | 1.39 | 8.26 | 8.20 | 8.25 | 65 |
| 超長期 (11-) | 3,020 | 86.15 | 86.43 | 15.64 | 1.02 | 2.20 | 2.05 | 14.04 | 13.90 | 13.98 | 69 |
| BBB 格 | 162 | 96.34 | 96.60 | 3.71 | 1.00 | 1.99 | 1.94 | 3.58 | 3.54 | 3.58 | 152 |
| 短期 (1-3) | 63 | 97.61 | 97.82 | 2.13 | 0.82 | 1.98 | 1.96 | 2.11 | 2.09 | 2.11 | 161 |
| 中期 (3-7) | 88 | 97.66 | 97.95 | 4.40 | 1.12 | 1.69 | 1.66 | 4.29 | 4.26 | 4.29 | 121 |
| 長期 (7-) | 11 | 78.56 | 78.87 | 7.21 | 1.07 | 5.15 | 4.60 | 6.89 | 6.74 | 6.89 | 401 |
| 長期 (7-11) | 11 | 78.56 | 78.87 | 7.21 | 1.07 | 5.15 | 4.60 | 6.89 | 6.74 | 6.89 | 401 |
| 超長期 (11-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| BB 格 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 短期 (1-3) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中期 (3-7) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 長期 (7-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 長期 (7-11) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 超長期 (11-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| B 格以下 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 短期 (1-3) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中期 (3-7) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 長期 (7-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 長期 (7-11) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 超長期 (11-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 格付なし | 5,959 | 97.19 | 97.38 | 5.11 | 0.70 | 1.17 | 1.14 | 4.82 | 4.78 | 4.81 | 63 |
| 短期 (1-3) | 1,938 | 99.27 | 99.42 | 1.94 | 0.57 | 0.94 | 0.93 | 1.93 | 1.92 | 1.93 | 60 |
| 中期 (3-7) | 2,742 | 98.14 | 98.30 | 4.71 | 0.62 | 1.02 | 1.01 | 4.63 | 4.60 | 4.63 | 54 |
| 長期 (7-) | 1,279 | 92.01 | 92.31 | 10.76 | 1.06 | 1.92 | 1.80 | 9.96 | 9.87 | 9.95 | 87 |
| 長期 (7-11) | 767 | 96.41 | 96.76 | 8.40 | 1.21 | 1.75 | 1.67 | 7.98 | 7.92 | 7.98 | 95 |
| 超長期 (11-) | 512 | 85.43 | 85.66 | 14.28 | 0.85 | 2.21 | 2.02 | 13.31 | 13.18 | 13.28 | 73 |

出所:NFRC

- 格付は、R&Iの格付をもとに NFRC で分類

事業債 JCR 格付別・ポートフォリオ指標 (2024年9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 | 30,186 | 97.10 | 97.24 | 5.94 | 0.56 | 0.92 | 0.89 | 5.31 | 5.27 | 5.29 | 34 |
| 短期 (1-3) | 10,333 | 99.47 | 99.56 | 1.96 | 0.35 | 0.62 | 0.62 | 1.95 | 1.95 | 1.95 | 29 |
| 中期 (3-7) | 12,256 | 98.74 | 98.86 | 4.65 | 0.54 | 0.80 | 0.80 | 4.58 | 4.56 | 4.58 | 33 |
| 長期 (7-) | 7,597 | 91.23 | 91.45 | 13.42 | 0.89 | 1.55 | 1.47 | 11.53 | 11.43 | 11.46 | 42 |
| 長期 (7-11) | 4,143 | 97.91 | 98.14 | 8.44 | 0.85 | 1.14 | 1.13 | 8.13 | 8.09 | 8.13 | 41 |
| 超長期 (11-) | 3,454 | 83.22 | 83.44 | 19.38 | 0.94 | 2.14 | 1.95 | 16.31 | 16.15 | 16.16 | 43 |
| AAA~A 格 | 42,084 | 97.00 | 97.16 | 5.91 | 0.64 | 1.03 | 1.00 | 5.34 | 5.30 | 5.32 | 44 |
| 短期 (1-3) | 13,819 | 99.41 | 99.51 | 1.98 | 0.40 | 0.70 | 0.70 | 1.97 | 1.96 | 1.97 | 36 |
| 中期 (3-7) | 17,096 | 98.67 | 98.82 | 4.67 | 0.62 | 0.89 | 0.89 | 4.59 | 4.57 | 4.59 | 42 |
| 長期 (7-) | 11,169 | 91.45 | 91.71 | 12.66 | 0.96 | 1.69 | 1.60 | 11.08 | 10.99 | 11.03 | 58 |
| 長期 (7-11) | 6,153 | 97.18 | 97.44 | 8.52 | 0.94 | 1.33 | 1.31 | 8.17 | 8.11 | 8.16 | 58 |
| 超長期 (11-) | 5,015 | 84.43 | 84.68 | 17.73 | 0.99 | 2.20 | 2.02 | 15.20 | 15.05 | 15.08 | 58 |
| AAA~BBB 格 | 42,084 | 97.00 | 97.16 | 5.91 | 0.64 | 1.03 | 1.00 | 5.34 | 5.30 | 5.32 | 44 |
| 短期 (1-3) | 13,819 | 99.41 | 99.51 | 1.98 | 0.40 | 0.70 | 0.70 | 1.97 | 1.96 | 1.97 | 36 |
| 中期 (3-7) | 17,096 | 98.67 | 98.82 | 4.67 | 0.62 | 0.89 | 0.89 | 4.59 | 4.57 | 4.59 | 42 |
| 長期 (7-) | 11,169 | 91.45 | 91.71 | 12.66 | 0.96 | 1.69 | 1.60 | 11.08 | 10.99 | 11.03 | 58 |
| 長期 (7-11) | 6,153 | 97.18 | 97.44 | 8.52 | 0.94 | 1.33 | 1.31 | 8.17 | 8.11 | 8.16 | 58 |
| 超長期 (11-) | 5,015 | 84.43 | 84.68 | 17.73 | 0.99 | 2.20 | 2.02 | 15.20 | 15.05 | 15.08 | 58 |
| AAA~BB 格 | 42,084 | 97.00 | 97.16 | 5.91 | 0.64 | 1.03 | 1.00 | 5.34 | 5.30 | 5.32 | 44 |
| 短期 (1-3) | 13,819 | 99.41 | 99.51 | 1.98 | 0.40 | 0.70 | 0.70 | 1.97 | 1.96 | 1.97 | 36 |
| 中期 (3-7) | 17,096 | 98.67 | 98.82 | 4.67 | 0.62 | 0.89 | 0.89 | 4.59 | 4.57 | 4.59 | 42 |
| 長期 (7-) | 11,169 | 91.45 | 91.71 | 12.66 | 0.96 | 1.69 | 1.60 | 11.08 | 10.99 | 11.03 | 58 |
| 長期 (7-11) | 6,153 | 97.18 | 97.44 | 8.52 | 0.94 | 1.33 | 1.31 | 8.17 | 8.11 | 8.16 | 58 |
| 超長期 (11-) | 5,015 | 84.43 | 84.68 | 17.73 | 0.99 | 2.20 | 2.02 | 15.20 | 15.05 | 15.08 | 58 |
| AAA 格 | 11,043 | 97.49 | 97.57 | 5.59 | 0.44 | 0.75 | 0.73 | 4.83 | 4.80 | 4.81 | 21 |
| 短期 (1-3) | 4,325 | 99.37 | 99.41 | 1.95 | 0.19 | 0.53 | 0.52 | 1.95 | 1.94 | 1.95 | 19 |
| 中期 (3-7) | 4,783 | 98.93 | 99.01 | 4.64 | 0.46 | 0.68 | 0.68 | 4.58 | 4.56 | 4.58 | 21 |
| 長期 (7-) | 1,935 | 89.72 | 89.92 | 16.05 | 0.92 | 1.49 | 1.38 | 12.62 | 12.52 | 12.48 | 27 |
| 長期 (7-11) | 1,123 | 98.77 | 98.96 | 8.55 | 0.83 | 1.00 | 1.00 | 8.25 | 8.20 | 8.24 | 27 |
| 超長期 (11-) | 812 | 77.20 | 77.41 | 26.42 | 1.03 | 2.36 | 2.06 | 20.36 | 20.14 | 19.98 | 27 |
| AA 格 | 19,142 | 96.88 | 97.04 | 6.14 | 0.64 | 1.01 | 0.99 | 5.58 | 5.55 | 5.57 | 41 |
| 短期 (1-3) | 6,009 | 99.55 | 99.67 | 1.97 | 0.47 | 0.69 | 0.69 | 1.96 | 1.95 | 1.96 | 36 |
| 中期 (3-7) | 7,473 | 98.61 | 98.77 | 4.66 | 0.59 | 0.88 | 0.88 | 4.59 | 4.57 | 4.59 | 41 |
| 長期 (7-) | 5,661 | 91.75 | 91.98 | 12.52 | 0.88 | 1.57 | 1.50 | 11.16 | 11.07 | 11.12 | 47 |
| 長期 (7-11) | 3,020 | 97.59 | 97.83 | 8.40 | 0.85 | 1.19 | 1.18 | 8.09 | 8.04 | 8.09 | 46 |
| 超長期 (11-) | 2,642 | 85.07 | 85.29 | 17.22 | 0.91 | 2.07 | 1.91 | 15.19 | 15.04 | 15.09 | 47 |
| A 格 | 11,898 | 96.75 | 96.97 | 5.83 | 0.83 | 1.31 | 1.27 | 5.42 | 5.38 | 5.41 | 70 |
| 短期 (1-3) | 3,486 | 99.24 | 99.37 | 2.02 | 0.54 | 0.92 | 0.92 | 2.01 | 2.00 | 2.01 | 58 |
| 中期 (3-7) | 4,840 | 98.50 | 98.71 | 4.73 | 0.81 | 1.12 | 1.11 | 4.62 | 4.60 | 4.62 | 64 |
| 長期 (7-) | 3,572 | 91.93 | 92.26 | 11.05 | 1.13 | 1.98 | 1.88 | 10.15 | 10.06 | 10.14 | 93 |
| 長期 (7-11) | 2,011 | 95.67 | 96.01 | 8.69 | 1.14 | 1.74 | 1.68 | 8.24 | 8.17 | 8.24 | 94 |
| 超長期 (11-) | 1,562 | 87.12 | 87.44 | 14.08 | 1.11 | 2.33 | 2.17 | 12.85 | 12.72 | 12.82 | 91 |
| BBB 格 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 短期 (1-3) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中期 (3-7) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 長期 (7-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 長期 (7-11) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 超長期 (11-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| BB 格 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 短期 (1-3) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中期 (3-7) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 長期 (7-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 長期 (7-11) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 超長期 (11-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| B 格以下 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 短期 (1-3) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中期 (3-7) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 長期 (7-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 長期 (7-11) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 超長期 (11-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 格付なし | 28,220 | 95.60 | 95.77 | 9.73 | 0.90 | 1.14 | 1.09 | 7.97 | 7.91 | 7.91 | 31 |
| 短期 (1-3) | 7,077 | 99.84 | 99.95 | 2.04 | 0.56 | 0.66 | 0.66 | 2.03 | 2.02 | 2.03 | 32 |
| 中期 (3-7) | 8,729 | 100.18 | 100.34 | 4.74 | 0.83 | 0.79 | 0.79 | 4.65 | 4.63 | 4.65 | 32 |
| 長期 (7-) | 12,414 | 89.96 | 90.18 | 17.61 | 1.13 | 1.71 | 1.61 | 14.32 | 14.19 | 14.18 | 29 |
| 長期 (7-11) | 4,066 | 100.85 | 101.08 | 8.84 | 1.16 | 1.06 | 1.07 | 8.39 | 8.35 | 8.39 | 31 |
| 超長期 (11-) | 8,348 | 84.66 | 84.87 | 21.89 | 1.12 | 2.09 | 1.92 | 17.76 | 17.58 | 17.53 | 28 |

出所:NFRC

- 格付は、JCR の格付をもとに NFRC で分類

事業債 JCR 格付別・ポートフォリオ指標 (2024年9月末、10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 | 30,167 | 97.10 | 97.24 | 6.00 | 0.57 | 0.92 | 0.90 | 5.36 | 5.33 | 5.35 | 34 |
| 短期 (1-3) | 10,304 | 99.47 | 99.56 | 2.02 | 0.36 | 0.63 | 0.63 | 2.01 | 2.00 | 2.01 | 29 |
| 中期 (3-7) | 12,590 | 98.62 | 98.75 | 4.78 | 0.54 | 0.81 | 0.81 | 4.70 | 4.68 | 4.70 | 34 |
| 長期 (7-) | 7,273 | 91.10 | 91.32 | 13.74 | 0.92 | 1.58 | 1.49 | 11.77 | 11.67 | 11.70 | 41 |
| 長期 (7-11) | 3,864 | 98.14 | 98.37 | 8.66 | 0.90 | 1.15 | 1.14 | 8.31 | 8.27 | 8.31 | 40 |
| 超長期 (11-) | 3,409 | 83.12 | 83.33 | 19.49 | 0.94 | 2.15 | 1.95 | 16.40 | 16.23 | 16.24 | 43 |
| AAA~A 格 | 42,089 | 97.00 | 97.16 | 5.95 | 0.64 | 1.03 | 1.01 | 5.38 | 5.35 | 5.37 | 44 |
| 短期 (1-3) | 13,854 | 99.41 | 99.51 | 2.03 | 0.41 | 0.70 | 0.70 | 2.02 | 2.02 | 2.02 | 36 |
| 中期 (3-7) | 17,450 | 98.57 | 98.72 | 4.78 | 0.61 | 0.90 | 0.89 | 4.70 | 4.68 | 4.70 | 42 |
| 長期 (7-) | 10,785 | 91.36 | 91.62 | 12.88 | 0.99 | 1.71 | 1.62 | 11.26 | 11.16 | 11.21 | 58 |
| 長期 (7-11) | 5,815 | 97.33 | 97.60 | 8.68 | 0.99 | 1.35 | 1.32 | 8.30 | 8.25 | 8.30 | 58 |
| 超長期 (11-) | 4,970 | 84.37 | 84.62 | 17.79 | 1.00 | 2.21 | 2.02 | 15.25 | 15.09 | 15.13 | 58 |
| AAA~BBB 格 | 42,089 | 97.00 | 97.16 | 5.95 | 0.64 | 1.03 | 1.01 | 5.38 | 5.35 | 5.37 | 44 |
| 短期 (1-3) | 13,854 | 99.41 | 99.51 | 2.03 | 0.41 | 0.70 | 0.70 | 2.02 | 2.02 | 2.02 | 36 |
| 中期 (3-7) | 17,450 | 98.57 | 98.72 | 4.78 | 0.61 | 0.90 | 0.89 | 4.70 | 4.68 | 4.70 | 42 |
| 長期 (7-) | 10,785 | 91.36 | 91.62 | 12.88 | 0.99 | 1.71 | 1.62 | 11.26 | 11.16 | 11.21 | 58 |
| 長期 (7-11) | 5,815 | 97.33 | 97.60 | 8.68 | 0.99 | 1.35 | 1.32 | 8.30 | 8.25 | 8.30 | 58 |
| 超長期 (11-) | 4,970 | 84.37 | 84.62 | 17.79 | 1.00 | 2.21 | 2.02 | 15.25 | 15.09 | 15.13 | 58 |
| AAA~BB 格 | 42,089 | 97.00 | 97.16 | 5.95 | 0.64 | 1.03 | 1.01 | 5.38 | 5.35 | 5.37 | 44 |
| 短期 (1-3) | 13,854 | 99.41 | 99.51 | 2.03 | 0.41 | 0.70 | 0.70 | 2.02 | 2.02 | 2.02 | 36 |
| 中期 (3-7) | 17,450 | 98.57 | 98.72 | 4.78 | 0.61 | 0.90 | 0.89 | 4.70 | 4.68 | 4.70 | 42 |
| 長期 (7-) | 10,785 | 91.36 | 91.62 | 12.88 | 0.99 | 1.71 | 1.62 | 11.26 | 11.16 | 11.21 | 58 |
| 長期 (7-11) | 5,815 | 97.33 | 97.60 | 8.68 | 0.99 | 1.35 | 1.32 | 8.30 | 8.25 | 8.30 | 58 |
| 超長期 (11-) | 4,970 | 84.37 | 84.62 | 17.79 | 1.00 | 2.21 | 2.02 | 15.25 | 15.09 | 15.13 | 58 |
| AAA 格 | 11,095 | 97.50 | 97.59 | 5.62 | 0.44 | 0.75 | 0.73 | 4.87 | 4.84 | 4.85 | 21 |
| 短期 (1-3) | 4,275 | 99.36 | 99.40 | 1.99 | 0.20 | 0.53 | 0.53 | 1.98 | 1.98 | 1.98 | 19 |
| 中期 (3-7) | 4,922 | 98.94 | 99.03 | 4.68 | 0.47 | 0.68 | 0.68 | 4.63 | 4.61 | 4.63 | 21 |
| 長期 (7-) | 1,898 | 89.57 | 89.76 | 16.25 | 0.93 | 1.51 | 1.40 | 12.76 | 12.65 | 12.62 | 27 |
| 長期 (7-11) | 1,096 | 98.75 | 98.94 | 8.66 | 0.85 | 1.02 | 1.01 | 8.34 | 8.30 | 8.34 | 27 |
| 超長期 (11-) | 802 | 77.02 | 77.23 | 26.61 | 1.04 | 2.38 | 2.08 | 20.50 | 20.28 | 20.12 | 27 |
| AA 格 | 19,072 | 96.87 | 97.03 | 6.21 | 0.64 | 1.02 | 1.00 | 5.65 | 5.61 | 5.64 | 41 |
| 短期 (1-3) | 6,030 | 99.55 | 99.68 | 2.04 | 0.48 | 0.70 | 0.70 | 2.03 | 2.02 | 2.03 | 36 |
| 中期 (3-7) | 7,667 | 98.42 | 98.57 | 4.84 | 0.58 | 0.90 | 0.89 | 4.75 | 4.73 | 4.75 | 42 |
| 長期 (7-) | 5,375 | 91.64 | 91.87 | 12.85 | 0.92 | 1.60 | 1.52 | 11.43 | 11.33 | 11.38 | 46 |
| 長期 (7-11) | 2,768 | 97.90 | 98.15 | 8.65 | 0.92 | 1.20 | 1.19 | 8.30 | 8.25 | 8.30 | 45 |
| 超長期 (11-) | 2,607 | 85.00 | 85.21 | 17.30 | 0.91 | 2.08 | 1.92 | 15.25 | 15.10 | 15.16 | 47 |
| A 格 | 11,922 | 96.75 | 96.97 | 5.85 | 0.83 | 1.31 | 1.28 | 5.43 | 5.39 | 5.43 | 71 |
| 短期 (1-3) | 3,549 | 99.24 | 99.38 | 2.07 | 0.55 | 0.93 | 0.92 | 2.06 | 2.05 | 2.06 | 58 |
| 中期 (3-7) | 4,861 | 98.44 | 98.64 | 4.79 | 0.81 | 1.13 | 1.12 | 4.69 | 4.66 | 4.69 | 65 |
| 長期 (7-) | 3,512 | 91.89 | 92.23 | 11.11 | 1.14 | 2.00 | 1.90 | 10.21 | 10.11 | 10.19 | 93 |
| 長期 (7-11) | 1,951 | 95.71 | 96.07 | 8.74 | 1.16 | 1.75 | 1.70 | 8.28 | 8.21 | 8.28 | 95 |
| 超長期 (11-) | 1,562 | 87.12 | 87.44 | 14.08 | 1.11 | 2.33 | 2.17 | 12.85 | 12.72 | 12.82 | 91 |
| BBB 格 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 短期 (1-3) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中期 (3-7) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 長期 (7-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 長期 (7-11) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 超長期 (11-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| BB 格 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 短期 (1-3) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中期 (3-7) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 長期 (7-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 長期 (7-11) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 超長期 (11-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| B 格以下 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 短期 (1-3) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中期 (3-7) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 長期 (7-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 長期 (7-11) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 超長期 (11-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 格付なし | 28,083 | 95.58 | 95.75 | 9.80 | 0.90 | 1.14 | 1.10 | 8.03 | 7.97 | 7.97 | 31 |
| 短期 (1-3) | 7,013 | 99.87 | 99.98 | 2.10 | 0.58 | 0.66 | 0.66 | 2.09 | 2.08 | 2.09 | 32 |
| 中期 (3-7) | 8,667 | 100.16 | 100.32 | 4.79 | 0.83 | 0.79 | 0.79 | 4.69 | 4.67 | 4.69 | 32 |
| 長期 (7-) | 12,403 | 89.96 | 90.18 | 17.66 | 1.14 | 1.72 | 1.61 | 14.36 | 14.23 | 14.21 | 29 |
| 長期 (7-11) | 4,023 | 100.88 | 101.11 | 8.86 | 1.17 | 1.07 | 1.07 | 8.42 | 8.37 | 8.41 | 31 |
| 超長期 (11-) | 8,380 | 84.71 | 84.93 | 21.88 | 1.12 | 2.09 | 1.92 | 17.76 | 17.58 | 17.53 | 28 |

出所:NFRC

- 格付は、JCR の格付をもとに NFRC で分類

事業債 Moody's 格付別・ポートフォリオ指標 (2024年9月末)

| | 額面 (10 億円) | 時価単価 (円) | 利含単価 (円) | 残存年数 (年) | 利率 (%) | 単利 (%) | 複利 (%) | Dur (年) | M-Dur | E-Dur | Tspd (bp) |
|-----------|---------------|-------------|-------------|-------------|-----------|-----------|-----------|------------|-------|-------|--------------|
| AAA~AA 格 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 短期 (1-3) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中期 (3-7) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 長期 (7-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 長期 (7-11) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 超長期 (11-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| AAA~A 格 | 24,274 | 96.65 | 96.82 | 8.61 | 0.80 | 1.02 | 0.98 | 7.27 | 7.22 | 7.23 | 25 |
| 短期 (1-3) | 6,946 | 99.69 | 99.78 | 2.02 | 0.41 | 0.57 | 0.57 | 2.01 | 2.00 | 2.01 | 23 |
| 中期 (3-7) | 7,757 | 99.92 | 100.05 | 4.66 | 0.71 | 0.70 | 0.70 | 4.58 | 4.56 | 4.58 | 23 |
| 長期 (7-) | 9,572 | 91.80 | 92.06 | 16.61 | 1.15 | 1.65 | 1.56 | 13.79 | 13.67 | 13.67 | 29 |
| 長期 (7-11) | 3,463 | 100.47 | 100.72 | 8.82 | 1.09 | 1.05 | 1.05 | 8.40 | 8.35 | 8.39 | 30 |
| 超長期 (11-) | 6,109 | 86.88 | 87.15 | 21.02 | 1.19 | 2.04 | 1.89 | 17.32 | 17.15 | 17.13 | 29 |
| AAA~BBB 格 | 26,360 | 96.66 | 96.84 | 8.50 | 0.81 | 1.03 | 1.00 | 7.21 | 7.15 | 7.16 | 27 |
| 短期 (1-3) | 7,286 | 99.67 | 99.76 | 2.03 | 0.40 | 0.57 | 0.57 | 2.02 | 2.01 | 2.02 | 23 |
| 中期 (3-7) | 8,848 | 99.89 | 100.03 | 4.67 | 0.74 | 0.74 | 0.74 | 4.58 | 4.56 | 4.58 | 27 |
| 長期 (7-) | 10,226 | 91.73 | 91.99 | 16.43 | 1.15 | 1.66 | 1.57 | 13.69 | 13.57 | 13.57 | 31 |
| 長期 (7-11) | 3,770 | 100.29 | 100.55 | 8.81 | 1.08 | 1.07 | 1.07 | 8.39 | 8.35 | 8.39 | 31 |
| 超長期 (11-) | 6,457 | 86.73 | 87.00 | 20.88 | 1.18 | 2.05 | 1.91 | 17.26 | 17.08 | 17.07 | 30 |
| AAA~BB 格 | 26,360 | 96.66 | 96.84 | 8.50 | 0.81 | 1.03 | 1.00 | 7.21 | 7.15 | 7.16 | 27 |
| 短期 (1-3) | 7,286 | 99.67 | 99.76 | 2.03 | 0.40 | 0.57 | 0.57 | 2.02 | 2.01 | 2.02 | 23 |
| 中期 (3-7) | 8,848 | 99.89 | 100.03 | 4.67 | 0.74 | 0.74 | 0.74 | 4.58 | 4.56 | 4.58 | 27 |
| 長期 (7-) | 10,226 | 91.73 | 91.99 | 16.43 | 1.15 | 1.66 | 1.57 | 13.69 | 13.57 | 13.57 | 31 |
| 長期 (7-11) | 3,770 | 100.29 | 100.55 | 8.81 | 1.08 | 1.07 | 1.07 | 8.39 | 8.35 | 8.39 | 31 |
| 超長期 (11-) | 6,457 | 86.73 | 87.00 | 20.88 | 1.18 | 2.05 | 1.91 | 17.26 | 17.08 | 17.07 | 30 |
| AAA 格 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 短期 (1-3) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中期 (3-7) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 長期 (7-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 長期 (7-11) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 超長期 (11-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| AA 格 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 短期 (1-3) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中期 (3-7) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 長期 (7-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 長期 (7-11) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 超長期 (11-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| A 格 | 24,274 | 96.65 | 96.82 | 8.61 | 0.80 | 1.02 | 0.98 | 7.27 | 7.22 | 7.23 | 25 |
| 短期 (1-3) | 6,946 | 99.69 | 99.78 | 2.02 | 0.41 | 0.57 | 0.57 | 2.01 | 2.00 | 2.01 | 23 |
| 中期 (3-7) | 7,757 | 99.92 | 100.05 | 4.66 | 0.71 | 0.70 | 0.70 | 4.58 | 4.56 | 4.58 | 23 |
| 長期 (7-) | 9,572 | 91.80 | 92.06 | 16.61 | 1.15 | 1.65 | 1.56 | 13.79 | 13.67 | 13.67 | 29 |
| 長期 (7-11) | 3,463 | 100.47 | 100.72 | 8.82 | 1.09 | 1.05 | 1.05 | 8.40 | 8.35 | 8.39 | 30 |
| 超長期 (11-) | 6,109 | 86.88 | 87.15 | 21.02 | 1.19 | 2.04 | 1.89 | 17.32 | 17.15 | 17.13 | 29 |
| BBB 格 | 2,086 | 96.80 | 97.01 | 7.18 | 0.88 | 1.19 | 1.16 | 6.41 | 6.36 | 6.39 | 52 |
| 短期 (1-3) | 340 | 99.23 | 99.28 | 2.15 | 0.29 | 0.65 | 0.65 | 2.14 | 2.13 | 2.14 | 30 |
| 中期 (3-7) | 1,091 | 99.69 | 99.90 | 4.71 | 0.97 | 1.04 | 1.04 | 4.60 | 4.57 | 4.60 | 57 |
| 長期 (7-) | 655 | 90.74 | 91.02 | 13.90 | 1.05 | 1.77 | 1.67 | 12.15 | 12.04 | 12.09 | 54 |
| 長期 (7-11) | 307 | 98.27 | 98.55 | 8.75 | 1.01 | 1.24 | 1.23 | 8.36 | 8.31 | 8.36 | 48 |
| 超長期 (11-) | 348 | 84.09 | 84.37 | 18.46 | 1.09 | 2.32 | 2.13 | 16.06 | 15.89 | 15.95 | 60 |
| BB 格 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 短期 (1-3) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中期 (3-7) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 長期 (7-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 長期 (7-11) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 超長期 (11-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| B 格以下 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 短期 (1-3) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中期 (3-7) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 長期 (7-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 長期 (7-11) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 超長期 (11-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 格付なし | 43,944 | 96.30 | 96.46 | 6.80 | 0.71 | 1.10 | 1.06 | 5.89 | 5.85 | 5.86 | 46 |
| 短期 (1-3) | 13,611 | 99.50 | 99.61 | 1.99 | 0.49 | 0.75 | 0.74 | 1.97 | 1.97 | 1.97 | 41 |
| 中期 (3-7) | 16,977 | 98.81 | 98.97 | 4.71 | 0.66 | 0.92 | 0.91 | 4.63 | 4.61 | 4.63 | 44 |
| 長期 (7-) | 13,356 | 89.85 | 90.07 | 14.37 | 0.98 | 1.74 | 1.63 | 12.06 | 11.95 | 11.97 | 53 |
| 長期 (7-11) | 6,450 | 97.67 | 97.92 | 8.55 | 1.00 | 1.32 | 1.29 | 8.18 | 8.13 | 8.18 | 57 |
| 超長期 (11-) | 6,906 | 82.55 | 82.74 | 19.81 | 0.97 | 2.21 | 2.00 | 16.35 | 16.19 | 16.17 | 48 |

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9月末、10月ポートフォリオ)

| | 額面 (10億円) | 時価単価 (円) | 利含単価 (円) | 残存年数 (年) | 利率 (%) | 単利 (%) | 複利 (%) | Dur (年) | M-Dur | E-Dur | Tspd (bp) |
|-----------|--------------|-------------|-------------|-------------|-----------|-----------|-----------|------------|-------|-------|--------------|
| AAA~AA 格 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 短期 (1-3) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中期 (3-7) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 長期 (7-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 長期 (7-11) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 超長期 (11-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| AAA~A 格 | 24,217 | 96.65 | 96.82 | 8.68 | 0.81 | 1.02 | 0.99 | 7.34 | 7.29 | 7.29 | 25 |
| 短期 (1-3) | 6,862 | 99.74 | 99.83 | 2.08 | 0.44 | 0.57 | 0.57 | 2.07 | 2.06 | 2.07 | 23 |
| 中期 (3-7) | 7,860 | 99.83 | 99.95 | 4.74 | 0.70 | 0.71 | 0.71 | 4.65 | 4.64 | 4.65 | 24 |
| 長期 (7-) | 9,495 | 91.78 | 92.04 | 16.73 | 1.16 | 1.66 | 1.57 | 13.88 | 13.76 | 13.77 | 29 |
| 長期 (7-11) | 3,379 | 100.57 | 100.83 | 8.90 | 1.11 | 1.06 | 1.06 | 8.47 | 8.42 | 8.46 | 30 |
| 超長期 (11-) | 6,116 | 86.92 | 87.19 | 21.05 | 1.19 | 2.04 | 1.90 | 17.34 | 17.17 | 17.15 | 29 |
| AAA~BBB 格 | 26,302 | 96.66 | 96.83 | 8.56 | 0.81 | 1.03 | 1.00 | 7.26 | 7.21 | 7.22 | 27 |
| 短期 (1-3) | 7,202 | 99.71 | 99.81 | 2.08 | 0.43 | 0.58 | 0.58 | 2.07 | 2.07 | 2.07 | 23 |
| 中期 (3-7) | 8,951 | 99.81 | 99.94 | 4.73 | 0.73 | 0.75 | 0.75 | 4.65 | 4.63 | 4.65 | 28 |
| 長期 (7-) | 10,150 | 91.71 | 91.98 | 16.54 | 1.16 | 1.66 | 1.58 | 13.77 | 13.65 | 13.66 | 31 |
| 長期 (7-11) | 3,686 | 100.38 | 100.64 | 8.89 | 1.10 | 1.07 | 1.07 | 8.46 | 8.41 | 8.45 | 31 |
| 超長期 (11-) | 6,464 | 86.77 | 87.04 | 20.91 | 1.19 | 2.05 | 1.91 | 17.28 | 17.10 | 17.09 | 30 |
| AAA~BB 格 | 26,302 | 96.66 | 96.83 | 8.56 | 0.81 | 1.03 | 1.00 | 7.26 | 7.21 | 7.22 | 27 |
| 短期 (1-3) | 7,202 | 99.71 | 99.81 | 2.08 | 0.43 | 0.58 | 0.58 | 2.07 | 2.07 | 2.07 | 23 |
| 中期 (3-7) | 8,951 | 99.81 | 99.94 | 4.73 | 0.73 | 0.75 | 0.75 | 4.65 | 4.63 | 4.65 | 28 |
| 長期 (7-) | 10,150 | 91.71 | 91.98 | 16.54 | 1.16 | 1.66 | 1.58 | 13.77 | 13.65 | 13.66 | 31 |
| 長期 (7-11) | 3,686 | 100.38 | 100.64 | 8.89 | 1.10 | 1.07 | 1.07 | 8.46 | 8.41 | 8.45 | 31 |
| 超長期 (11-) | 6,464 | 86.77 | 87.04 | 20.91 | 1.19 | 2.05 | 1.91 | 17.28 | 17.10 | 17.09 | 30 |
| AAA 格 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 短期 (1-3) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中期 (3-7) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 長期 (7-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 長期 (7-11) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 超長期 (11-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| AA 格 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 短期 (1-3) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中期 (3-7) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 長期 (7-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 長期 (7-11) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 超長期 (11-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| A 格 | 24,217 | 96.65 | 96.82 | 8.68 | 0.81 | 1.02 | 0.99 | 7.34 | 7.29 | 7.29 | 25 |
| 短期 (1-3) | 6,862 | 99.74 | 99.83 | 2.08 | 0.44 | 0.57 | 0.57 | 2.07 | 2.06 | 2.07 | 23 |
| 中期 (3-7) | 7,860 | 99.83 | 99.95 | 4.74 | 0.70 | 0.71 | 0.71 | 4.65 | 4.64 | 4.65 | 24 |
| 長期 (7-) | 9,495 | 91.78 | 92.04 | 16.73 | 1.16 | 1.66 | 1.57 | 13.88 | 13.76 | 13.77 | 29 |
| 長期 (7-11) | 3,379 | 100.57 | 100.83 | 8.90 | 1.11 | 1.06 | 1.06 | 8.47 | 8.42 | 8.46 | 30 |
| 超長期 (11-) | 6,116 | 86.92 | 87.19 | 21.05 | 1.19 | 2.04 | 1.90 | 17.34 | 17.17 | 17.15 | 29 |
| BBB 格 | 2,086 | 96.80 | 97.01 | 7.18 | 0.88 | 1.19 | 1.16 | 6.41 | 6.36 | 6.39 | 52 |
| 短期 (1-3) | 340 | 99.23 | 99.28 | 2.15 | 0.29 | 0.65 | 0.65 | 2.14 | 2.13 | 2.14 | 30 |
| 中期 (3-7) | 1,091 | 99.69 | 99.90 | 4.71 | 0.97 | 1.04 | 1.04 | 4.60 | 4.57 | 4.60 | 57 |
| 長期 (7-) | 655 | 90.74 | 91.02 | 13.90 | 1.05 | 1.77 | 1.67 | 12.15 | 12.04 | 12.09 | 54 |
| 長期 (7-11) | 307 | 98.27 | 98.55 | 8.75 | 1.01 | 1.24 | 1.23 | 8.36 | 8.31 | 8.36 | 48 |
| 超長期 (11-) | 348 | 84.09 | 84.37 | 18.46 | 1.09 | 2.32 | 2.13 | 16.06 | 15.89 | 15.95 | 60 |
| BB 格 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 短期 (1-3) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中期 (3-7) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 長期 (7-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 長期 (7-11) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 超長期 (11-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| B 格以下 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 短期 (1-3) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中期 (3-7) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 長期 (7-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 長期 (7-11) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 超長期 (11-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 格付なし | 43,870 | 96.30 | 96.46 | 6.85 | 0.71 | 1.10 | 1.07 | 5.93 | 5.89 | 5.91 | 46 |
| 短期 (1-3) | 13,665 | 99.49 | 99.60 | 2.04 | 0.49 | 0.75 | 0.75 | 2.03 | 2.02 | 2.03 | 41 |
| 中期 (3-7) | 17,167 | 98.73 | 98.89 | 4.81 | 0.66 | 0.92 | 0.92 | 4.72 | 4.70 | 4.72 | 45 |
| 長期 (7-) | 13,038 | 89.75 | 89.97 | 14.57 | 1.00 | 1.76 | 1.65 | 12.21 | 12.10 | 12.12 | 53 |
| 長期 (7-11) | 6,152 | 97.82 | 98.07 | 8.68 | 1.04 | 1.33 | 1.31 | 8.28 | 8.23 | 8.28 | 57 |
| 超長期 (11-) | 6,886 | 82.54 | 82.73 | 19.84 | 0.97 | 2.21 | 2.01 | 16.38 | 16.21 | 16.19 | 48 |

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9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 | 86.05 | 86.28 | 17.62 | 0.98 | 1.70 | 1.53 | 13.61 | 13.48 | 13.46 | 31 |
| 短期 (1-3) | 40 | 102.78 | 103.28 | 2.23 | 1.75 | 0.59 | 0.60 | 2.19 | 2.18 | 2.19 | 24 |
| 中期 (3-7) | 115 | 96.90 | 96.96 | 5.49 | 0.22 | 0.79 | 0.78 | 5.45 | 5.43 | 5.45 | 28 |
| 長期 (7-) | 696 | 83.30 | 83.54 | 20.51 | 1.06 | 1.95 | 1.74 | 15.99 | 15.82 | 15.80 | 32 |
| 長期 (7-11) | 212 | 101.69 | 101.99 | 8.70 | 1.25 | 1.03 | 1.04 | 8.24 | 8.20 | 8.24 | 30 |
| 超長期 (11-) | 484 | 75.24 | 75.46 | 25.69 | 0.98 | 2.49 | 2.15 | 20.57 | 20.34 | 20.28 | 34 |
| AAA~A 格 | 16,407 | 95.27 | 95.41 | 8.98 | 0.75 | 1.04 | 0.99 | 7.40 | 7.34 | 7.35 | 27 |
| 短期 (1-3) | 4,027 | 99.88 | 99.97 | 1.99 | 0.46 | 0.57 | 0.57 | 1.98 | 1.97 | 1.98 | 23 |
| 中期 (3-7) | 5,599 | 99.59 | 99.72 | 4.90 | 0.67 | 0.75 | 0.74 | 4.81 | 4.79 | 4.81 | 27 |
| 長期 (7-) | 6,781 | 88.97 | 89.14 | 16.51 | 0.98 | 1.63 | 1.50 | 13.39 | 13.28 | 13.26 | 29 |
| 長期 (7-11) | 2,806 | 100.20 | 100.40 | 8.63 | 1.06 | 1.03 | 1.03 | 8.24 | 8.20 | 8.24 | 29 |
| 超長期 (11-) | 3,976 | 81.05 | 81.19 | 22.07 | 0.93 | 2.15 | 1.92 | 17.89 | 17.70 | 17.65 | 29 |
| AAA~BBB 格 | 16,622 | 95.31 | 95.45 | 8.93 | 0.75 | 1.04 | 0.99 | 7.36 | 7.30 | 7.31 | 27 |
| 短期 (1-3) | 4,077 | 99.87 | 99.97 | 1.99 | 0.46 | 0.57 | 0.57 | 1.98 | 1.97 | 1.98 | 24 |
| 中期 (3-7) | 5,734 | 99.57 | 99.70 | 4.88 | 0.67 | 0.75 | 0.75 | 4.80 | 4.78 | 4.80 | 27 |
| 長期 (7-) | 6,811 | 89.00 | 89.17 | 16.48 | 0.98 | 1.62 | 1.50 | 13.37 | 13.26 | 13.25 | 29 |
| 長期 (7-11) | 2,826 | 100.20 | 100.39 | 8.63 | 1.06 | 1.03 | 1.03 | 8.24 | 8.20 | 8.24 | 29 |
| 超長期 (11-) | 3,986 | 81.07 | 81.21 | 22.05 | 0.93 | 2.15 | 1.92 | 17.87 | 17.69 | 17.64 | 29 |
| AAA~BB 格 | 16,862 | 95.40 | 95.54 | 8.88 | 0.77 | 1.05 | 1.00 | 7.32 | 7.27 | 7.27 | 29 |
| 短期 (1-3) | 4,077 | 99.87 | 99.97 | 1.99 | 0.46 | 0.57 | 0.57 | 1.98 | 1.97 | 1.98 | 24 |
| 中期 (3-7) | 5,949 | 99.65 | 99.80 | 4.87 | 0.73 | 0.79 | 0.79 | 4.78 | 4.76 | 4.78 | 31 |
| 長期 (7-) | 6,836 | 89.02 | 89.19 | 16.48 | 0.99 | 1.63 | 1.51 | 13.37 | 13.26 | 13.25 | 30 |
| 長期 (7-11) | 2,826 | 100.20 | 100.39 | 8.63 | 1.06 | 1.03 | 1.03 | 8.24 | 8.20 | 8.24 | 29 |
| 超長期 (11-) | 4,011 | 81.15 | 81.29 | 22.01 | 0.94 | 2.15 | 1.93 | 17.84 | 17.65 | 17.60 | 30 |
| AAA 格 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 短期 (1-3) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中期 (3-7) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 長期 (7-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 長期 (7-11) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 超長期 (11-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| AA 格 | 851 | 86.05 | 86.28 | 17.62 | 0.98 | 1.70 | 1.53 | 13.61 | 13.48 | 13.46 | 31 |
| 短期 (1-3) | 40 | 102.78 | 103.28 | 2.23 | 1.75 | 0.59 | 0.60 | 2.19 | 2.18 | 2.19 | 24 |
| 中期 (3-7) | 115 | 96.90 | 96.96 | 5.49 | 0.22 | 0.79 | 0.78 | 5.45 | 5.43 | 5.45 | 28 |
| 長期 (7-) | 696 | 83.30 | 83.54 | 20.51 | 1.06 | 1.95 | 1.74 | 15.99 | 15.82 | 15.80 | 32 |
| 長期 (7-11) | 212 | 101.69 | 101.99 | 8.70 | 1.25 | 1.03 | 1.04 | 8.24 | 8.20 | 8.24 | 30 |
| 超長期 (11-) | 484 | 75.24 | 75.46 | 25.69 | 0.98 | 2.49 | 2.15 | 20.57 | 20.34 | 20.28 | 34 |
| A 格 | 15,556 | 95.78 | 95.91 | 8.51 | 0.74 | 1.01 | 0.97 | 7.09 | 7.04 | 7.05 | 27 |
| 短期 (1-3) | 3,987 | 99.85 | 99.94 | 1.98 | 0.45 | 0.57 | 0.57 | 1.97 | 1.97 | 1.97 | 23 |
| 中期 (3-7) | 5,484 | 99.64 | 99.78 | 4.89 | 0.68 | 0.75 | 0.74 | 4.80 | 4.78 | 4.80 | 27 |
| 長期 (7-) | 6,085 | 89.62 | 89.78 | 16.05 | 0.98 | 1.59 | 1.48 | 13.12 | 13.00 | 12.99 | 29 |
| 長期 (7-11) | 2,594 | 100.08 | 100.27 | 8.62 | 1.04 | 1.02 | 1.02 | 8.24 | 8.20 | 8.24 | 29 |
| 超長期 (11-) | 3,492 | 81.86 | 81.98 | 21.57 | 0.93 | 2.11 | 1.89 | 17.54 | 17.37 | 17.31 | 29 |
| BBB 格 | 215 | 98.44 | 98.55 | 4.51 | 0.58 | 0.90 | 0.89 | 4.35 | 4.33 | 4.35 | 41 |
| 短期 (1-3) | 50 | 99.24 | 99.31 | 1.95 | 0.28 | 0.68 | 0.67 | 1.95 | 1.94 | 1.95 | 34 |
| 中期 (3-7) | 135 | 98.75 | 98.87 | 4.19 | 0.59 | 0.87 | 0.86 | 4.13 | 4.11 | 4.13 | 41 |
| 長期 (7-) | 30 | 95.70 | 95.82 | 10.21 | 1.08 | 1.47 | 1.43 | 9.52 | 9.45 | 9.51 | 55 |
| 長期 (7-11) | 20 | 99.77 | 99.80 | 8.46 | 1.15 | 1.18 | 1.18 | 8.09 | 8.04 | 8.08 | 47 |
| 超長期 (11-) | 10 | 87.58 | 87.86 | 13.70 | 0.95 | 2.12 | 1.99 | 12.77 | 12.64 | 12.74 | 74 |
| BB 格 | 240 | 101.16 | 101.59 | 5.66 | 2.26 | 1.87 | 1.87 | 5.13 | 5.08 | 5.12 | 133 |
| 短期 (1-3) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中期 (3-7) | 215 | 101.98 | 102.36 | 4.50 | 2.25 | 1.76 | 1.77 | 4.29 | 4.25 | 4.28 | 131 |
| 長期 (7-) | 25 | 94.15 | 94.96 | 15.66 | 2.37 | 2.91 | 2.83 | 12.97 | 12.79 | 12.89 | 147 |
| 長期 (7-11) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 超長期 (11-) | 25 | 94.15 | 94.96 | 15.66 | 2.37 | 2.91 | 2.83 | 12.97 | 12.79 | 12.89 | 147 |
| B 格以下 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 短期 (1-3) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中期 (3-7) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 長期 (7-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 長期 (7-11) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 超長期 (11-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 格付なし | 53,441 | 96.77 | 96.94 | 6.99 | 0.73 | 1.08 | 1.05 | 6.09 | 6.05 | 6.07 | 42 |
| 短期 (1-3) | 16,820 | 99.48 | 99.59 | 2.00 | 0.46 | 0.71 | 0.71 | 1.99 | 1.99 | 1.99 | 38 |
| 中期 (3-7) | 19,875 | 99.04 | 99.19 | 4.64 | 0.68 | 0.88 | 0.87 | 4.56 | 4.54 | 4.56 | 41 |
| 長期 (7-) | 16,746 | 91.34 | 91.60 | 14.77 | 1.08 | 1.73 | 1.64 | 12.54 | 12.42 | 12.45 | 48 |
| 長期 (7-11) | 7,394 | 98.04 | 98.31 | 8.65 | 1.02 | 1.30 | 1.28 | 8.27 | 8.21 | 8.26 | 54 |
| 超長期 (11-) | 9,352 | 86.04 | 86.30 | 19.61 | 1.13 | 2.12 | 1.97 | 16.38 | 16.22 | 16.22 | 43 |

出所:NFRC

- 格付は、S&P の格付をもとに NFRC で分類

事業債 S&P 格付別・ポートフォリオ指標 (2024年9月末、10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 | 86.05 | 86.28 | 17.62 | 0.98 | 1.70 | 1.53 | 13.61 | 13.48 | 13.46 | 31 |
| 短期 (1-3) | 40 | 102.78 | 103.28 | 2.23 | 1.75 | 0.59 | 0.60 | 2.19 | 2.18 | 2.19 | 24 |
| 中期 (3-7) | 115 | 96.90 | 96.96 | 5.49 | 0.22 | 0.79 | 0.78 | 5.45 | 5.43 | 5.45 | 28 |
| 長期 (7-) | 696 | 83.30 | 83.54 | 20.51 | 1.06 | 1.95 | 1.74 | 15.99 | 15.82 | 15.80 | 32 |
| 長期 (7-11) | 212 | 101.69 | 101.99 | 8.70 | 1.25 | 1.03 | 1.04 | 8.24 | 8.20 | 8.24 | 30 |
| 超長期 (11-) | 484 | 75.24 | 75.46 | 25.69 | 0.98 | 2.49 | 2.15 | 20.57 | 20.34 | 20.28 | 34 |
| AAA~A 格 | 16,321 | 95.25 | 95.38 | 9.03 | 0.75 | 1.04 | 1.00 | 7.44 | 7.38 | 7.39 | 27 |
| 短期 (1-3) | 4,033 | 99.90 | 100.00 | 2.04 | 0.48 | 0.57 | 0.57 | 2.03 | 2.02 | 2.03 | 23 |
| 中期 (3-7) | 5,592 | 99.53 | 99.66 | 4.97 | 0.66 | 0.75 | 0.75 | 4.88 | 4.86 | 4.88 | 27 |
| 長期 (7-) | 6,696 | 88.87 | 89.04 | 16.63 | 0.99 | 1.64 | 1.51 | 13.49 | 13.37 | 13.36 | 29 |
| 長期 (7-11) | 2,730 | 100.27 | 100.47 | 8.70 | 1.08 | 1.03 | 1.03 | 8.30 | 8.25 | 8.29 | 29 |
| 超長期 (11-) | 3,966 | 81.02 | 81.16 | 22.10 | 0.93 | 2.15 | 1.92 | 17.91 | 17.72 | 17.67 | 29 |
| AAA~BBB 格 | 16,536 | 95.29 | 95.43 | 8.97 | 0.75 | 1.04 | 0.99 | 7.40 | 7.34 | 7.35 | 27 |
| 短期 (1-3) | 4,083 | 99.90 | 99.99 | 2.04 | 0.48 | 0.57 | 0.57 | 2.03 | 2.02 | 2.03 | 24 |
| 中期 (3-7) | 5,727 | 99.51 | 99.64 | 4.95 | 0.66 | 0.75 | 0.75 | 4.87 | 4.85 | 4.87 | 27 |
| 長期 (7-) | 6,726 | 88.90 | 89.07 | 16.60 | 0.99 | 1.64 | 1.51 | 13.47 | 13.35 | 13.34 | 29 |
| 長期 (7-11) | 2,750 | 100.27 | 100.47 | 8.69 | 1.08 | 1.03 | 1.04 | 8.30 | 8.25 | 8.29 | 29 |
| 超長期 (11-) | 3,976 | 81.04 | 81.18 | 22.08 | 0.93 | 2.15 | 1.92 | 17.89 | 17.71 | 17.66 | 29 |
| AAA~BB 格 | 16,776 | 95.37 | 95.51 | 8.93 | 0.77 | 1.05 | 1.01 | 7.36 | 7.31 | 7.31 | 29 |
| 短期 (1-3) | 4,083 | 99.90 | 99.99 | 2.04 | 0.48 | 0.57 | 0.57 | 2.03 | 2.02 | 2.03 | 24 |
| 中期 (3-7) | 5,942 | 99.60 | 99.74 | 4.94 | 0.72 | 0.79 | 0.79 | 4.84 | 4.82 | 4.84 | 31 |
| 長期 (7-) | 6,751 | 88.92 | 89.09 | 16.60 | 1.00 | 1.64 | 1.52 | 13.46 | 13.35 | 13.34 | 30 |
| 長期 (7-11) | 2,750 | 100.27 | 100.47 | 8.69 | 1.08 | 1.03 | 1.04 | 8.30 | 8.25 | 8.29 | 29 |
| 超長期 (11-) | 4,001 | 81.12 | 81.27 | 22.04 | 0.94 | 2.16 | 1.93 | 17.86 | 17.67 | 17.62 | 30 |
| AAA 格 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 短期 (1-3) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中期 (3-7) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 長期 (7-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 長期 (7-11) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 超長期 (11-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| AA 格 | 851 | 86.05 | 86.28 | 17.62 | 0.98 | 1.70 | 1.53 | 13.61 | 13.48 | 13.46 | 31 |
| 短期 (1-3) | 40 | 102.78 | 103.28 | 2.23 | 1.75 | 0.59 | 0.60 | 2.19 | 2.18 | 2.19 | 24 |
| 中期 (3-7) | 115 | 96.90 | 96.96 | 5.49 | 0.22 | 0.79 | 0.78 | 5.45 | 5.43 | 5.45 | 28 |
| 長期 (7-) | 696 | 83.30 | 83.54 | 20.51 | 1.06 | 1.95 | 1.74 | 15.99 | 15.82 | 15.80 | 32 |
| 長期 (7-11) | 212 | 101.69 | 101.99 | 8.70 | 1.25 | 1.03 | 1.04 | 8.24 | 8.20 | 8.24 | 30 |
| 超長期 (11-) | 484 | 75.24 | 75.46 | 25.69 | 0.98 | 2.49 | 2.15 | 20.57 | 20.34 | 20.28 | 34 |
| A 格 | 15,470 | 95.76 | 95.89 | 8.56 | 0.74 | 1.01 | 0.97 | 7.13 | 7.08 | 7.09 | 27 |
| 短期 (1-3) | 3,993 | 99.87 | 99.97 | 2.04 | 0.47 | 0.57 | 0.57 | 2.03 | 2.02 | 2.03 | 23 |
| 中期 (3-7) | 5,477 | 99.58 | 99.71 | 4.96 | 0.67 | 0.75 | 0.75 | 4.87 | 4.85 | 4.87 | 27 |
| 長期 (7-) | 6,000 | 89.52 | 89.67 | 16.18 | 0.98 | 1.60 | 1.49 | 13.22 | 13.10 | 13.09 | 29 |
| 長期 (7-11) | 2,518 | 100.15 | 100.34 | 8.70 | 1.06 | 1.03 | 1.03 | 8.30 | 8.26 | 8.30 | 29 |
| 超長期 (11-) | 3,482 | 81.83 | 81.95 | 21.60 | 0.93 | 2.11 | 1.90 | 17.57 | 17.39 | 17.33 | 29 |
| BBB 格 | 215 | 98.44 | 98.55 | 4.51 | 0.58 | 0.90 | 0.89 | 4.35 | 4.33 | 4.35 | 41 |
| 短期 (1-3) | 50 | 99.24 | 99.31 | 1.95 | 0.28 | 0.68 | 0.67 | 1.95 | 1.94 | 1.95 | 34 |
| 中期 (3-7) | 135 | 98.75 | 98.87 | 4.19 | 0.59 | 0.87 | 0.86 | 4.13 | 4.11 | 4.13 | 41 |
| 長期 (7-) | 30 | 95.70 | 95.82 | 10.21 | 1.08 | 1.47 | 1.43 | 9.52 | 9.45 | 9.51 | 55 |
| 長期 (7-11) | 20 | 99.77 | 99.80 | 8.46 | 1.15 | 1.18 | 1.18 | 8.09 | 8.04 | 8.08 | 47 |
| 超長期 (11-) | 10 | 87.58 | 87.86 | 13.70 | 0.95 | 2.12 | 1.99 | 12.77 | 12.64 | 12.74 | 74 |
| BB 格 | 240 | 101.16 | 101.59 | 5.66 | 2.26 | 1.87 | 1.87 | 5.13 | 5.08 | 5.12 | 133 |
| 短期 (1-3) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中期 (3-7) | 215 | 101.98 | 102.36 | 4.50 | 2.25 | 1.76 | 1.77 | 4.29 | 4.25 | 4.28 | 131 |
| 長期 (7-) | 25 | 94.15 | 94.96 | 15.66 | 2.37 | 2.91 | 2.83 | 12.97 | 12.79 | 12.89 | 147 |
| 長期 (7-11) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 超長期 (11-) | 25 | 94.15 | 94.96 | 15.66 | 2.37 | 2.91 | 2.83 | 12.97 | 12.79 | 12.89 | 147 |
| B 格以下 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 短期 (1-3) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中期 (3-7) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 長期 (7-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 長期 (7-11) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 超長期 (11-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 格付なし | 53,396 | 96.77 | 96.94 | 7.04 | 0.74 | 1.08 | 1.05 | 6.15 | 6.10 | 6.12 | 42 |
| 短期 (1-3) | 16,784 | 99.49 | 99.59 | 2.06 | 0.47 | 0.72 | 0.72 | 2.05 | 2.04 | 2.05 | 38 |
| 中期 (3-7) | 20,175 | 98.95 | 99.10 | 4.74 | 0.68 | 0.89 | 0.88 | 4.65 | 4.63 | 4.65 | 41 |
| 長期 (7-) | 16,437 | 91.30 | 91.57 | 14.96 | 1.10 | 1.75 | 1.65 | 12.68 | 12.57 | 12.59 | 48 |
| 長期 (7-11) | 7,087 | 98.20 | 98.48 | 8.78 | 1.06 | 1.31 | 1.29 | 8.37 | 8.32 | 8.37 | 54 |
| 超長期 (11-) | 9,349 | 86.07 | 86.33 | 19.64 | 1.13 | 2.12 | 1.97 | 16.41 | 16.24 | 16.24 | 43 |

出所:NFRC

- 格付は、S&P の格付をもとに NFRC で分類

円建外債 最高格付別・ポートフォリオ指標 (2024年9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 | 1,452 | 99.59 | 99.82 | 3.12 | 0.83 | 0.98 | 0.98 | 3.05 | 3.04 | 3.05 | 58 |
| 短期(1-3) | 769 | 99.70 | 99.90 | 1.95 | 0.72 | 0.89 | 0.89 | 1.93 | 1.92 | 1.93 | 56 |
| 中期(3-7) | 613 | 99.56 | 99.81 | 3.95 | 0.93 | 1.04 | 1.04 | 3.88 | 3.86 | 3.88 | 60 |
| 長期(7-) | 71 | 98.77 | 99.05 | 8.59 | 1.21 | 1.40 | 1.40 | 8.11 | 8.06 | 8.11 | 67 |
| 長期(7-11) | 67 | 98.85 | 99.12 | 8.25 | 1.16 | 1.35 | 1.35 | 7.87 | 7.82 | 7.86 | 65 |
| 超長期(11-) | 4 | 97.48 | 97.89 | 14.00 | 1.99 | 2.22 | 2.19 | 12.07 | 11.94 | 12.01 | 97 |
| AAA~A格 | 3,106 | 99.40 | 99.68 | 3.55 | 1.02 | 1.21 | 1.21 | 3.40 | 3.38 | 3.40 | 78 |
| 短期(1-3) | 1,660 | 99.65 | 99.90 | 2.07 | 0.92 | 1.08 | 1.08 | 2.05 | 2.04 | 2.05 | 74 |
| 中期(3-7) | 1,169 | 99.03 | 99.29 | 3.96 | 0.97 | 1.22 | 1.22 | 3.88 | 3.86 | 3.88 | 77 |
| 長期(7-) | 276 | 99.51 | 100.04 | 10.66 | 1.86 | 1.97 | 1.96 | 9.49 | 9.40 | 9.47 | 104 |
| 長期(7-11) | 160 | 98.32 | 98.60 | 8.46 | 1.42 | 1.68 | 1.67 | 7.95 | 7.88 | 7.94 | 96 |
| 超長期(11-) | 116 | 101.16 | 102.02 | 13.70 | 2.48 | 2.35 | 2.36 | 11.56 | 11.42 | 11.50 | 116 |
| AAA~BBB格 | 3,106 | 99.40 | 99.68 | 3.55 | 1.02 | 1.21 | 1.21 | 3.40 | 3.38 | 3.40 | 78 |
| 短期(1-3) | 1,660 | 99.65 | 99.90 | 2.07 | 0.92 | 1.08 | 1.08 | 2.05 | 2.04 | 2.05 | 74 |
| 中期(3-7) | 1,169 | 99.03 | 99.29 | 3.96 | 0.97 | 1.22 | 1.22 | 3.88 | 3.86 | 3.88 | 77 |
| 長期(7-) | 276 | 99.51 | 100.04 | 10.66 | 1.86 | 1.97 | 1.96 | 9.49 | 9.40 | 9.47 | 104 |
| 長期(7-11) | 160 | 98.32 | 98.60 | 8.46 | 1.42 | 1.68 | 1.67 | 7.95 | 7.88 | 7.94 | 96 |
| 超長期(11-) | 116 | 101.16 | 102.02 | 13.70 | 2.48 | 2.35 | 2.36 | 11.56 | 11.42 | 11.50 | 116 |
| AAA~BB格 | 3,106 | 99.40 | 99.68 | 3.55 | 1.02 | 1.21 | 1.21 | 3.40 | 3.38 | 3.40 | 78 |
| 短期(1-3) | 1,660 | 99.65 | 99.90 | 2.07 | 0.92 | 1.08 | 1.08 | 2.05 | 2.04 | 2.05 | 74 |
| 中期(3-7) | 1,169 | 99.03 | 99.29 | 3.96 | 0.97 | 1.22 | 1.22 | 3.88 | 3.86 | 3.88 | 77 |
| 長期(7-) | 276 | 99.51 | 100.04 | 10.66 | 1.86 | 1.97 | 1.96 | 9.49 | 9.40 | 9.47 | 104 |
| 長期(7-11) | 160 | 98.32 | 98.60 | 8.46 | 1.42 | 1.68 | 1.67 | 7.95 | 7.88 | 7.94 | 96 |
| 超長期(11-) | 116 | 101.16 | 102.02 | 13.70 | 2.48 | 2.35 | 2.36 | 11.56 | 11.42 | 11.50 | 116 |
| AAA格 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 短期(1-3) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中期(3-7) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 長期(7-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 長期(7-11) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 超長期(11-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| AA格 | 1,452 | 99.59 | 99.82 | 3.12 | 0.83 | 0.98 | 0.98 | 3.05 | 3.04 | 3.05 | 58 |
| 短期(1-3) | 769 | 99.70 | 99.90 | 1.95 | 0.72 | 0.89 | 0.89 | 1.93 | 1.92 | 1.93 | 56 |
| 中期(3-7) | 613 | 99.56 | 99.81 | 3.95 | 0.93 | 1.04 | 1.04 | 3.88 | 3.86 | 3.88 | 60 |
| 長期(7-) | 71 | 98.77 | 99.05 | 8.59 | 1.21 | 1.40 | 1.40 | 8.11 | 8.06 | 8.11 | 67 |
| 長期(7-11) | 67 | 98.85 | 99.12 | 8.25 | 1.16 | 1.35 | 1.35 | 7.87 | 7.82 | 7.86 | 65 |
| 超長期(11-) | 4 | 97.48 | 97.89 | 14.00 | 1.99 | 2.22 | 2.19 | 12.07 | 11.94 | 12.01 | 97 |
| A格 | 1,653 | 99.24 | 99.57 | 3.92 | 1.19 | 1.42 | 1.42 | 3.71 | 3.68 | 3.70 | 96 |
| 短期(1-3) | 891 | 99.60 | 99.90 | 2.18 | 1.09 | 1.25 | 1.25 | 2.15 | 2.14 | 2.15 | 90 |
| 中期(3-7) | 557 | 98.45 | 98.73 | 3.96 | 1.02 | 1.42 | 1.41 | 3.88 | 3.85 | 3.88 | 97 |
| 長期(7-) | 205 | 99.77 | 100.38 | 11.37 | 2.09 | 2.16 | 2.16 | 9.96 | 9.86 | 9.93 | 117 |
| 長期(7-11) | 94 | 97.94 | 98.23 | 8.60 | 1.60 | 1.92 | 1.91 | 8.01 | 7.93 | 8.00 | 118 |
| 超長期(11-) | 112 | 101.30 | 102.17 | 13.69 | 2.50 | 2.36 | 2.36 | 11.54 | 11.40 | 11.48 | 117 |
| 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9月末、10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 | 1,334 | 99.58 | 99.80 | 3.30 | 0.85 | 0.99 | 0.99 | 3.23 | 3.21 | 3.23 | 58 |
| 短期 (1-3) | 715 | 99.60 | 99.81 | 2.19 | 0.73 | 0.92 | 0.91 | 2.17 | 2.16 | 2.17 | 56 |
| 中期 (3-7) | 560 | 99.54 | 99.78 | 4.12 | 0.95 | 1.05 | 1.04 | 4.04 | 4.02 | 4.04 | 60 |
| 長期 (7-) | 60 | 99.61 | 99.91 | 8.89 | 1.36 | 1.42 | 1.42 | 8.33 | 8.27 | 8.32 | 66 |
| 長期 (7-11) | 55 | 99.77 | 100.06 | 8.50 | 1.31 | 1.36 | 1.36 | 8.05 | 8.00 | 8.05 | 64 |
| 超長期 (11-) | 4 | 97.48 | 97.89 | 14.00 | 1.99 | 2.22 | 2.19 | 12.07 | 11.94 | 12.01 | 97 |
| AAA~A 格 | 3,125 | 99.41 | 99.68 | 3.70 | 1.07 | 1.25 | 1.25 | 3.54 | 3.51 | 3.54 | 81 |
| 短期 (1-3) | 1,689 | 99.62 | 99.87 | 2.24 | 0.96 | 1.12 | 1.12 | 2.21 | 2.20 | 2.21 | 76 |
| 中期 (3-7) | 1,159 | 99.03 | 99.28 | 4.09 | 1.01 | 1.25 | 1.25 | 4.00 | 3.98 | 4.00 | 80 |
| 長期 (7-) | 278 | 99.72 | 100.24 | 10.94 | 1.95 | 2.02 | 2.02 | 9.67 | 9.57 | 9.64 | 108 |
| 長期 (7-11) | 157 | 98.68 | 98.97 | 8.64 | 1.53 | 1.74 | 1.73 | 8.07 | 8.00 | 8.07 | 100 |
| 超長期 (11-) | 121 | 101.06 | 101.90 | 13.94 | 2.50 | 2.38 | 2.38 | 11.69 | 11.55 | 11.63 | 117 |
| AAA~BBB 格 | 3,125 | 99.41 | 99.68 | 3.70 | 1.07 | 1.25 | 1.25 | 3.54 | 3.51 | 3.54 | 81 |
| 短期 (1-3) | 1,689 | 99.62 | 99.87 | 2.24 | 0.96 | 1.12 | 1.12 | 2.21 | 2.20 | 2.21 | 76 |
| 中期 (3-7) | 1,159 | 99.03 | 99.28 | 4.09 | 1.01 | 1.25 | 1.25 | 4.00 | 3.98 | 4.00 | 80 |
| 長期 (7-) | 278 | 99.72 | 100.24 | 10.94 | 1.95 | 2.02 | 2.02 | 9.67 | 9.57 | 9.64 | 108 |
| 長期 (7-11) | 157 | 98.68 | 98.97 | 8.64 | 1.53 | 1.74 | 1.73 | 8.07 | 8.00 | 8.07 | 100 |
| 超長期 (11-) | 121 | 101.06 | 101.90 | 13.94 | 2.50 | 2.38 | 2.38 | 11.69 | 11.55 | 11.63 | 117 |
| AAA~BB 格 | 3,125 | 99.41 | 99.68 | 3.70 | 1.07 | 1.25 | 1.25 | 3.54 | 3.51 | 3.54 | 81 |
| 短期 (1-3) | 1,689 | 99.62 | 99.87 | 2.24 | 0.96 | 1.12 | 1.12 | 2.21 | 2.20 | 2.21 | 76 |
| 中期 (3-7) | 1,159 | 99.03 | 99.28 | 4.09 | 1.01 | 1.25 | 1.25 | 4.00 | 3.98 | 4.00 | 80 |
| 長期 (7-) | 278 | 99.72 | 100.24 | 10.94 | 1.95 | 2.02 | 2.02 | 9.67 | 9.57 | 9.64 | 108 |
| 長期 (7-11) | 157 | 98.68 | 98.97 | 8.64 | 1.53 | 1.74 | 1.73 | 8.07 | 8.00 | 8.07 | 100 |
| 超長期 (11-) | 121 | 101.06 | 101.90 | 13.94 | 2.50 | 2.38 | 2.38 | 11.69 | 11.55 | 11.63 | 117 |
| AAA 格 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 短期 (1-3) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中期 (3-7) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 長期 (7-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 長期 (7-11) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 超長期 (11-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| AA 格 | 1,334 | 99.58 | 99.80 | 3.30 | 0.85 | 0.99 | 0.99 | 3.23 | 3.21 | 3.23 | 58 |
| 短期 (1-3) | 715 | 99.60 | 99.81 | 2.19 | 0.73 | 0.92 | 0.91 | 2.17 | 2.16 | 2.17 | 56 |
| 中期 (3-7) | 560 | 99.54 | 99.78 | 4.12 | 0.95 | 1.05 | 1.04 | 4.04 | 4.02 | 4.04 | 60 |
| 長期 (7-) | 60 | 99.61 | 99.91 | 8.89 | 1.36 | 1.42 | 1.42 | 8.33 | 8.27 | 8.32 | 66 |
| 長期 (7-11) | 55 | 99.77 | 100.06 | 8.50 | 1.31 | 1.36 | 1.36 | 8.05 | 8.00 | 8.05 | 64 |
| 超長期 (11-) | 4 | 97.48 | 97.89 | 14.00 | 1.99 | 2.22 | 2.19 | 12.07 | 11.94 | 12.01 | 97 |
| A 格 | 1,791 | 99.28 | 99.60 | 3.99 | 1.23 | 1.44 | 1.44 | 3.77 | 3.74 | 3.77 | 97 |
| 短期 (1-3) | 974 | 99.63 | 99.91 | 2.27 | 1.13 | 1.27 | 1.27 | 2.24 | 2.22 | 2.24 | 91 |
| 中期 (3-7) | 599 | 98.55 | 98.82 | 4.06 | 1.07 | 1.45 | 1.44 | 3.97 | 3.94 | 3.97 | 99 |
| 長期 (7-) | 218 | 99.75 | 100.33 | 11.49 | 2.11 | 2.19 | 2.18 | 10.03 | 9.92 | 9.99 | 119 |
| 長期 (7-11) | 102 | 98.09 | 98.37 | 8.71 | 1.66 | 1.95 | 1.94 | 8.08 | 8.01 | 8.08 | 120 |
| 超長期 (11-) | 116 | 101.19 | 102.04 | 13.94 | 2.52 | 2.38 | 2.39 | 11.68 | 11.54 | 11.61 | 118 |
| BBB 格 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 短期 (1-3) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中期 (3-7) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 長期 (7-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 長期 (7-11) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 超長期 (11-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| BB 格 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 短期 (1-3) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中期 (3-7) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 長期 (7-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 長期 (7-11) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 超長期 (11-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| B 格以下 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 短期 (1-3) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中期 (3-7) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 長期 (7-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 長期 (7-11) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 超長期 (11-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 格付なし | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 短期 (1-3) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中期 (3-7) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 長期 (7-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 長期 (7-11) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 超長期 (11-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |

出所:NFRC

- 格付は、格付会社 4 社の最高格付をもとに分類

円建外債 最低格付別・ポートフォリオ指標 (2024年9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 | 331 | 99.46 | 99.63 | 2.96 | 0.77 | 0.95 | 0.95 | 2.91 | 2.89 | 2.91 | 56 |
| 短期(1-3) | 213 | 99.70 | 99.88 | 2.07 | 0.75 | 0.91 | 0.91 | 2.05 | 2.04 | 2.05 | 57 |
| 中期(3-7) | 104 | 99.12 | 99.28 | 4.09 | 0.78 | 1.02 | 1.01 | 4.03 | 4.01 | 4.03 | 57 |
| 長期(7-) | 14 | 98.45 | 98.53 | 8.12 | 0.94 | 1.20 | 1.18 | 7.83 | 7.79 | 7.83 | 50 |
| 長期(7-11) | 14 | 98.45 | 98.53 | 8.12 | 0.94 | 1.20 | 1.18 | 7.83 | 7.79 | 7.83 | 50 |
| 超長期(11-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| AAA~A格 | 2,128 | 99.81 | 100.09 | 3.32 | 0.96 | 1.06 | 1.06 | 3.21 | 3.19 | 3.21 | 65 |
| 短期(1-3) | 1,213 | 99.78 | 100.03 | 2.01 | 0.87 | 0.98 | 0.98 | 1.99 | 1.98 | 1.99 | 64 |
| 中期(3-7) | 762 | 99.51 | 99.77 | 3.95 | 0.95 | 1.07 | 1.07 | 3.88 | 3.86 | 3.88 | 63 |
| 長期(7-) | 152 | 101.51 | 102.09 | 10.56 | 1.76 | 1.69 | 1.71 | 9.47 | 9.38 | 9.44 | 79 |
| 長期(7-11) | 91 | 98.24 | 98.53 | 8.30 | 1.09 | 1.37 | 1.36 | 7.92 | 7.87 | 7.92 | 66 |
| 超長期(11-) | 62 | 106.30 | 107.32 | 13.88 | 2.73 | 2.12 | 2.18 | 11.55 | 11.43 | 11.49 | 97 |
| AAA~BBB格 | 3,106 | 99.40 | 99.68 | 3.55 | 1.02 | 1.21 | 1.21 | 3.40 | 3.38 | 3.40 | 78 |
| 短期(1-3) | 1,660 | 99.65 | 99.90 | 2.07 | 0.92 | 1.08 | 1.08 | 2.05 | 2.04 | 2.05 | 74 |
| 中期(3-7) | 1,169 | 99.03 | 99.29 | 3.96 | 0.97 | 1.22 | 1.22 | 3.88 | 3.86 | 3.88 | 77 |
| 長期(7-) | 276 | 99.51 | 100.04 | 10.66 | 1.86 | 1.97 | 1.96 | 9.49 | 9.40 | 9.47 | 104 |
| 長期(7-11) | 160 | 98.32 | 98.60 | 8.46 | 1.42 | 1.68 | 1.67 | 7.95 | 7.88 | 7.94 | 96 |
| 超長期(11-) | 116 | 101.16 | 102.02 | 13.70 | 2.48 | 2.35 | 2.36 | 11.56 | 11.42 | 11.50 | 116 |
| AAA~BB格 | 3,106 | 99.40 | 99.68 | 3.55 | 1.02 | 1.21 | 1.21 | 3.40 | 3.38 | 3.40 | 78 |
| 短期(1-3) | 1,660 | 99.65 | 99.90 | 2.07 | 0.92 | 1.08 | 1.08 | 2.05 | 2.04 | 2.05 | 74 |
| 中期(3-7) | 1,169 | 99.03 | 99.29 | 3.96 | 0.97 | 1.22 | 1.22 | 3.88 | 3.86 | 3.88 | 77 |
| 長期(7-) | 276 | 99.51 | 100.04 | 10.66 | 1.86 | 1.97 | 1.96 | 9.49 | 9.40 | 9.47 | 104 |
| 長期(7-11) | 160 | 98.32 | 98.60 | 8.46 | 1.42 | 1.68 | 1.67 | 7.95 | 7.88 | 7.94 | 96 |
| 超長期(11-) | 116 | 101.16 | 102.02 | 13.70 | 2.48 | 2.35 | 2.36 | 11.56 | 11.42 | 11.50 | 116 |
| AAA格 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 短期(1-3) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中期(3-7) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 長期(7-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 長期(7-11) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 超長期(11-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| AA格 | 331 | 99.46 | 99.63 | 2.96 | 0.77 | 0.95 | 0.95 | 2.91 | 2.89 | 2.91 | 56 |
| 短期(1-3) | 213 | 99.70 | 99.88 | 2.07 | 0.75 | 0.91 | 0.91 | 2.05 | 2.04 | 2.05 | 57 |
| 中期(3-7) | 104 | 99.12 | 99.28 | 4.09 | 0.78 | 1.02 | 1.01 | 4.03 | 4.01 | 4.03 | 57 |
| 長期(7-) | 14 | 98.45 | 98.53 | 8.12 | 0.94 | 1.20 | 1.18 | 7.83 | 7.79 | 7.83 | 50 |
| 長期(7-11) | 14 | 98.45 | 98.53 | 8.12 | 0.94 | 1.20 | 1.18 | 7.83 | 7.79 | 7.83 | 50 |
| 超長期(11-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| A格 | 1,796 | 99.87 | 100.17 | 3.39 | 0.99 | 1.08 | 1.08 | 3.27 | 3.25 | 3.26 | 66 |
| 短期(1-3) | 1,000 | 99.80 | 100.07 | 2.00 | 0.89 | 1.00 | 1.00 | 1.98 | 1.97 | 1.98 | 66 |
| 中期(3-7) | 658 | 99.57 | 99.85 | 3.93 | 0.97 | 1.08 | 1.08 | 3.85 | 3.83 | 3.85 | 64 |
| 長期(7-) | 139 | 101.81 | 102.45 | 10.80 | 1.84 | 1.73 | 1.76 | 9.62 | 9.54 | 9.59 | 82 |
| 長期(7-11) | 77 | 98.21 | 98.53 | 8.33 | 1.12 | 1.40 | 1.39 | 7.94 | 7.88 | 7.93 | 69 |
| 超長期(11-) | 62 | 106.30 | 107.32 | 13.88 | 2.73 | 2.12 | 2.18 | 11.55 | 11.43 | 11.49 | 97 |
| BBB格 | 978 | 98.53 | 98.81 | 4.04 | 1.16 | 1.55 | 1.53 | 3.82 | 3.79 | 3.82 | 107 |
| 短期(1-3) | 447 | 99.29 | 99.54 | 2.24 | 1.07 | 1.37 | 1.36 | 2.21 | 2.19 | 2.21 | 101 |
| 中期(3-7) | 407 | 98.14 | 98.40 | 3.97 | 1.01 | 1.51 | 1.50 | 3.88 | 3.86 | 3.88 | 106 |
| 長期(7-) | 124 | 97.06 | 97.51 | 10.78 | 1.99 | 2.33 | 2.30 | 9.53 | 9.42 | 9.50 | 137 |
| 長期(7-11) | 70 | 98.42 | 98.70 | 8.66 | 1.84 | 2.09 | 2.08 | 7.99 | 7.90 | 7.98 | 134 |
| 超長期(11-) | 54 | 95.33 | 95.99 | 13.50 | 2.19 | 2.64 | 2.59 | 11.56 | 11.41 | 11.51 | 140 |
| 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9月末、10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 | 310 | 99.44 | 99.60 | 3.09 | 0.76 | 0.95 | 0.94 | 3.04 | 3.02 | 3.04 | 55 |
| 短期 (1-3) | 199 | 99.67 | 99.84 | 2.21 | 0.76 | 0.91 | 0.91 | 2.19 | 2.18 | 2.19 | 56 |
| 中期 (3-7) | 98 | 99.12 | 99.24 | 4.16 | 0.74 | 0.98 | 0.98 | 4.10 | 4.08 | 4.10 | 53 |
| 長期 (7-) | 14 | 98.45 | 98.53 | 8.12 | 0.94 | 1.20 | 1.18 | 7.83 | 7.79 | 7.83 | 50 |
| 長期 (7-11) | 14 | 98.45 | 98.53 | 8.12 | 0.94 | 1.20 | 1.18 | 7.83 | 7.79 | 7.83 | 50 |
| 超長期 (11-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| AAA~A 格 | 2,009 | 99.81 | 100.09 | 3.45 | 0.98 | 1.08 | 1.08 | 3.34 | 3.32 | 3.34 | 65 |
| 短期 (1-3) | 1,160 | 99.72 | 99.98 | 2.17 | 0.88 | 1.00 | 1.00 | 2.14 | 2.13 | 2.14 | 65 |
| 中期 (3-7) | 709 | 99.49 | 99.74 | 4.09 | 0.97 | 1.08 | 1.07 | 4.00 | 3.98 | 4.00 | 63 |
| 長期 (7-) | 141 | 102.09 | 102.70 | 10.84 | 1.87 | 1.72 | 1.74 | 9.66 | 9.57 | 9.63 | 80 |
| 長期 (7-11) | 79 | 98.80 | 99.10 | 8.48 | 1.19 | 1.38 | 1.37 | 8.06 | 8.00 | 8.05 | 65 |
| 超長期 (11-) | 62 | 106.30 | 107.32 | 13.88 | 2.73 | 2.12 | 2.18 | 11.55 | 11.43 | 11.49 | 97 |
| AAA~BBB 格 | 3,125 | 99.41 | 99.68 | 3.70 | 1.07 | 1.25 | 1.25 | 3.54 | 3.51 | 3.54 | 81 |
| 短期 (1-3) | 1,689 | 99.62 | 99.87 | 2.24 | 0.96 | 1.12 | 1.12 | 2.21 | 2.20 | 2.21 | 76 |
| 中期 (3-7) | 1,159 | 99.03 | 99.28 | 4.09 | 1.01 | 1.25 | 1.25 | 4.00 | 3.98 | 4.00 | 80 |
| 長期 (7-) | 278 | 99.72 | 100.24 | 10.94 | 1.95 | 2.02 | 2.02 | 9.67 | 9.57 | 9.64 | 108 |
| 長期 (7-11) | 157 | 98.68 | 98.97 | 8.64 | 1.53 | 1.74 | 1.73 | 8.07 | 8.00 | 8.07 | 100 |
| 超長期 (11-) | 121 | 101.06 | 101.90 | 13.94 | 2.50 | 2.38 | 2.38 | 11.69 | 11.55 | 11.63 | 117 |
| AAA~BB 格 | 3,125 | 99.41 | 99.68 | 3.70 | 1.07 | 1.25 | 1.25 | 3.54 | 3.51 | 3.54 | 81 |
| 短期 (1-3) | 1,689 | 99.62 | 99.87 | 2.24 | 0.96 | 1.12 | 1.12 | 2.21 | 2.20 | 2.21 | 76 |
| 中期 (3-7) | 1,159 | 99.03 | 99.28 | 4.09 | 1.01 | 1.25 | 1.25 | 4.00 | 3.98 | 4.00 | 80 |
| 長期 (7-) | 278 | 99.72 | 100.24 | 10.94 | 1.95 | 2.02 | 2.02 | 9.67 | 9.57 | 9.64 | 108 |
| 長期 (7-11) | 157 | 98.68 | 98.97 | 8.64 | 1.53 | 1.74 | 1.73 | 8.07 | 8.00 | 8.07 | 100 |
| 超長期 (11-) | 121 | 101.06 | 101.90 | 13.94 | 2.50 | 2.38 | 2.38 | 11.69 | 11.55 | 11.63 | 117 |
| AAA 格 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 短期 (1-3) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中期 (3-7) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 長期 (7-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 長期 (7-11) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 超長期 (11-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| AA 格 | 310 | 99.44 | 99.60 | 3.09 | 0.76 | 0.95 | 0.94 | 3.04 | 3.02 | 3.04 | 55 |
| 短期 (1-3) | 199 | 99.67 | 99.84 | 2.21 | 0.76 | 0.91 | 0.91 | 2.19 | 2.18 | 2.19 | 56 |
| 中期 (3-7) | 98 | 99.12 | 99.24 | 4.16 | 0.74 | 0.98 | 0.98 | 4.10 | 4.08 | 4.10 | 53 |
| 長期 (7-) | 14 | 98.45 | 98.53 | 8.12 | 0.94 | 1.20 | 1.18 | 7.83 | 7.79 | 7.83 | 50 |
| 長期 (7-11) | 14 | 98.45 | 98.53 | 8.12 | 0.94 | 1.20 | 1.18 | 7.83 | 7.79 | 7.83 | 50 |
| 超長期 (11-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| A 格 | 1,700 | 99.87 | 100.18 | 3.52 | 1.02 | 1.10 | 1.10 | 3.39 | 3.37 | 3.39 | 67 |
| 短期 (1-3) | 961 | 99.74 | 100.01 | 2.16 | 0.90 | 1.02 | 1.02 | 2.14 | 2.12 | 2.14 | 67 |
| 中期 (3-7) | 611 | 99.55 | 99.82 | 4.07 | 1.00 | 1.09 | 1.09 | 3.99 | 3.96 | 3.99 | 64 |
| 長期 (7-) | 127 | 102.48 | 103.15 | 11.14 | 1.97 | 1.77 | 1.80 | 9.85 | 9.75 | 9.81 | 83 |
| 長期 (7-11) | 65 | 98.88 | 99.22 | 8.55 | 1.24 | 1.42 | 1.41 | 8.10 | 8.05 | 8.10 | 68 |
| 超長期 (11-) | 62 | 106.30 | 107.32 | 13.88 | 2.73 | 2.12 | 2.18 | 11.55 | 11.43 | 11.49 | 97 |
| BBB 格 | 1,116 | 98.69 | 98.95 | 4.14 | 1.23 | 1.56 | 1.55 | 3.91 | 3.87 | 3.90 | 109 |
| 短期 (1-3) | 529 | 99.39 | 99.62 | 2.39 | 1.14 | 1.38 | 1.38 | 2.36 | 2.34 | 2.36 | 102 |
| 中期 (3-7) | 450 | 98.30 | 98.55 | 4.10 | 1.08 | 1.54 | 1.53 | 4.00 | 3.97 | 4.00 | 108 |
| 長期 (7-) | 137 | 97.28 | 97.71 | 11.03 | 2.04 | 2.35 | 2.32 | 9.68 | 9.56 | 9.65 | 138 |
| 長期 (7-11) | 78 | 98.56 | 98.83 | 8.80 | 1.88 | 2.11 | 2.10 | 8.09 | 8.00 | 8.08 | 136 |
| 超長期 (11-) | 59 | 95.59 | 96.22 | 14.00 | 2.25 | 2.68 | 2.62 | 11.85 | 11.69 | 11.78 | 140 |
| 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9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 | 100.28 | 100.59 | 1.76 | 1.37 | 1.22 | 1.22 | 1.74 | 1.73 | 1.74 | 90 |
| 短期 (1-3) | 30 | 100.28 | 100.59 | 1.76 | 1.37 | 1.22 | 1.22 | 1.74 | 1.73 | 1.74 | 90 |
| 中期 (3-7) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 長期 (7-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 長期 (7-11) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 超長期 (11-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| AAA~A 格 | 754 | 99.12 | 99.39 | 3.05 | 0.98 | 1.24 | 1.24 | 2.98 | 2.96 | 2.98 | 84 |
| 短期 (1-3) | 408 | 99.53 | 99.80 | 2.03 | 0.95 | 1.16 | 1.15 | 2.01 | 2.00 | 2.01 | 82 |
| 中期 (3-7) | 317 | 98.86 | 99.14 | 3.90 | 1.02 | 1.33 | 1.32 | 3.82 | 3.80 | 3.82 | 89 |
| 長期 (7-) | 29 | 96.22 | 96.47 | 8.10 | 0.96 | 1.50 | 1.48 | 7.78 | 7.72 | 7.77 | 80 |
| 長期 (7-11) | 29 | 96.22 | 96.47 | 8.10 | 0.96 | 1.50 | 1.48 | 7.78 | 7.72 | 7.77 | 80 |
| 超長期 (11-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| AAA~BBB 格 | 754 | 99.12 | 99.39 | 3.05 | 0.98 | 1.24 | 1.24 | 2.98 | 2.96 | 2.98 | 84 |
| 短期 (1-3) | 408 | 99.53 | 99.80 | 2.03 | 0.95 | 1.16 | 1.15 | 2.01 | 2.00 | 2.01 | 82 |
| 中期 (3-7) | 317 | 98.86 | 99.14 | 3.90 | 1.02 | 1.33 | 1.32 | 3.82 | 3.80 | 3.82 | 89 |
| 長期 (7-) | 29 | 96.22 | 96.47 | 8.10 | 0.96 | 1.50 | 1.48 | 7.78 | 7.72 | 7.77 | 80 |
| 長期 (7-11) | 29 | 96.22 | 96.47 | 8.10 | 0.96 | 1.50 | 1.48 | 7.78 | 7.72 | 7.77 | 80 |
| 超長期 (11-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| AAA~BB 格 | 754 | 99.12 | 99.39 | 3.05 | 0.98 | 1.24 | 1.24 | 2.98 | 2.96 | 2.98 | 84 |
| 短期 (1-3) | 408 | 99.53 | 99.80 | 2.03 | 0.95 | 1.16 | 1.15 | 2.01 | 2.00 | 2.01 | 82 |
| 中期 (3-7) | 317 | 98.86 | 99.14 | 3.90 | 1.02 | 1.33 | 1.32 | 3.82 | 3.80 | 3.82 | 89 |
| 長期 (7-) | 29 | 96.22 | 96.47 | 8.10 | 0.96 | 1.50 | 1.48 | 7.78 | 7.72 | 7.77 | 80 |
| 長期 (7-11) | 29 | 96.22 | 96.47 | 8.10 | 0.96 | 1.50 | 1.48 | 7.78 | 7.72 | 7.77 | 80 |
| 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 | 100.28 | 100.59 | 1.76 | 1.37 | 1.22 | 1.22 | 1.74 | 1.73 | 1.74 | 90 |
| 短期 (1-3) | 30 | 100.28 | 100.59 | 1.76 | 1.37 | 1.22 | 1.22 | 1.74 | 1.73 | 1.74 | 90 |
| 中期 (3-7) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 長期 (7-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 長期 (7-11) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 超長期 (11-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| A 格 | 724 | 99.07 | 99.34 | 3.10 | 0.97 | 1.24 | 1.24 | 3.03 | 3.02 | 3.03 | 84 |
| 短期 (1-3) | 378 | 99.47 | 99.74 | 2.05 | 0.92 | 1.15 | 1.15 | 2.03 | 2.02 | 2.03 | 81 |
| 中期 (3-7) | 317 | 98.86 | 99.14 | 3.90 | 1.02 | 1.33 | 1.32 | 3.82 | 3.80 | 3.82 | 89 |
| 長期 (7-) | 29 | 96.22 | 96.47 | 8.10 | 0.96 | 1.50 | 1.48 | 7.78 | 7.72 | 7.77 | 80 |
| 長期 (7-11) | 29 | 96.22 | 96.47 | 8.10 | 0.96 | 1.50 | 1.48 | 7.78 | 7.72 | 7.77 | 80 |
| 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 | 2,351 | 99.50 | 99.78 | 3.71 | 1.04 | 1.21 | 1.20 | 3.53 | 3.51 | 3.53 | 76 |
| 短期 (1-3) | 1,251 | 99.69 | 99.93 | 2.09 | 0.91 | 1.06 | 1.06 | 2.06 | 2.05 | 2.06 | 72 |
| 中期 (3-7) | 853 | 99.10 | 99.35 | 3.98 | 0.95 | 1.18 | 1.17 | 3.90 | 3.88 | 3.90 | 73 |
| 長期 (7-) | 247 | 99.90 | 100.46 | 10.96 | 1.97 | 2.02 | 2.02 | 9.69 | 9.59 | 9.66 | 107 |
| 長期 (7-11) | 131 | 98.78 | 99.08 | 8.54 | 1.52 | 1.72 | 1.71 | 7.99 | 7.92 | 7.98 | 99 |
| 超長期 (11-) | 116 | 101.16 | 102.02 | 13.70 | 2.48 | 2.35 | 2.36 | 11.56 | 11.42 | 11.50 | 116 |

出所:NFRC

- 格付は、R&Iの格付をもとにNFRCで分類

円建外債 R&I 格付別・ポートフォリオ指標 (2024年9月末、10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 | 100.28 | 100.59 | 1.76 | 1.37 | 1.22 | 1.22 | 1.74 | 1.73 | 1.74 | 90 |
| 短期 (1-3) | 30 | 100.28 | 100.59 | 1.76 | 1.37 | 1.22 | 1.22 | 1.74 | 1.73 | 1.74 | 90 |
| 中期 (3-7) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 長期 (7-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 長期 (7-11) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 超長期 (11-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| AAA~A 格 | 740 | 99.11 | 99.38 | 3.09 | 0.98 | 1.24 | 1.23 | 3.02 | 3.00 | 3.02 | 84 |
| 短期 (1-3) | 394 | 99.53 | 99.79 | 2.07 | 0.95 | 1.15 | 1.14 | 2.04 | 2.03 | 2.04 | 80 |
| 中期 (3-7) | 317 | 98.86 | 99.14 | 3.90 | 1.02 | 1.33 | 1.32 | 3.82 | 3.80 | 3.82 | 89 |
| 長期 (7-) | 29 | 96.22 | 96.47 | 8.10 | 0.96 | 1.50 | 1.48 | 7.78 | 7.72 | 7.77 | 80 |
| 長期 (7-11) | 29 | 96.22 | 96.47 | 8.10 | 0.96 | 1.50 | 1.48 | 7.78 | 7.72 | 7.77 | 80 |
| 超長期 (11-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| AAA~BBB 格 | 740 | 99.11 | 99.38 | 3.09 | 0.98 | 1.24 | 1.23 | 3.02 | 3.00 | 3.02 | 84 |
| 短期 (1-3) | 394 | 99.53 | 99.79 | 2.07 | 0.95 | 1.15 | 1.14 | 2.04 | 2.03 | 2.04 | 80 |
| 中期 (3-7) | 317 | 98.86 | 99.14 | 3.90 | 1.02 | 1.33 | 1.32 | 3.82 | 3.80 | 3.82 | 89 |
| 長期 (7-) | 29 | 96.22 | 96.47 | 8.10 | 0.96 | 1.50 | 1.48 | 7.78 | 7.72 | 7.77 | 80 |
| 長期 (7-11) | 29 | 96.22 | 96.47 | 8.10 | 0.96 | 1.50 | 1.48 | 7.78 | 7.72 | 7.77 | 80 |
| 超長期 (11-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| AAA~BB 格 | 740 | 99.11 | 99.38 | 3.09 | 0.98 | 1.24 | 1.23 | 3.02 | 3.00 | 3.02 | 84 |
| 短期 (1-3) | 394 | 99.53 | 99.79 | 2.07 | 0.95 | 1.15 | 1.14 | 2.04 | 2.03 | 2.04 | 80 |
| 中期 (3-7) | 317 | 98.86 | 99.14 | 3.90 | 1.02 | 1.33 | 1.32 | 3.82 | 3.80 | 3.82 | 89 |
| 長期 (7-) | 29 | 96.22 | 96.47 | 8.10 | 0.96 | 1.50 | 1.48 | 7.78 | 7.72 | 7.77 | 80 |
| 長期 (7-11) | 29 | 96.22 | 96.47 | 8.10 | 0.96 | 1.50 | 1.48 | 7.78 | 7.72 | 7.77 | 80 |
| 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 | 100.28 | 100.59 | 1.76 | 1.37 | 1.22 | 1.22 | 1.74 | 1.73 | 1.74 | 90 |
| 短期 (1-3) | 30 | 100.28 | 100.59 | 1.76 | 1.37 | 1.22 | 1.22 | 1.74 | 1.73 | 1.74 | 90 |
| 中期 (3-7) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 長期 (7-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 長期 (7-11) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 超長期 (11-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| A 格 | 710 | 99.06 | 99.33 | 3.14 | 0.97 | 1.24 | 1.23 | 3.08 | 3.06 | 3.08 | 84 |
| 短期 (1-3) | 364 | 99.47 | 99.73 | 2.09 | 0.92 | 1.14 | 1.14 | 2.07 | 2.06 | 2.07 | 80 |
| 中期 (3-7) | 317 | 98.86 | 99.14 | 3.90 | 1.02 | 1.33 | 1.32 | 3.82 | 3.80 | 3.82 | 89 |
| 長期 (7-) | 29 | 96.22 | 96.47 | 8.10 | 0.96 | 1.50 | 1.48 | 7.78 | 7.72 | 7.77 | 80 |
| 長期 (7-11) | 29 | 96.22 | 96.47 | 8.10 | 0.96 | 1.50 | 1.48 | 7.78 | 7.72 | 7.77 | 80 |
| 超長期 (11-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| BBB 格 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 短期 (1-3) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中期 (3-7) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 長期 (7-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 長期 (7-11) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 超長期 (11-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| BB 格 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 短期 (1-3) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中期 (3-7) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 長期 (7-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 長期 (7-11) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 超長期 (11-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| B 格以下 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 短期 (1-3) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中期 (3-7) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 長期 (7-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 長期 (7-11) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 超長期 (11-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 格付なし | 2,385 | 99.50 | 99.77 | 3.89 | 1.09 | 1.25 | 1.25 | 3.70 | 3.67 | 3.70 | 80 |
| 短期 (1-3) | 1,295 | 99.65 | 99.89 | 2.29 | 0.96 | 1.11 | 1.11 | 2.26 | 2.25 | 2.26 | 75 |
| 中期 (3-7) | 842 | 99.09 | 99.33 | 4.16 | 1.01 | 1.22 | 1.22 | 4.07 | 4.05 | 4.07 | 77 |
| 長期 (7-) | 249 | 100.12 | 100.68 | 11.27 | 2.07 | 2.08 | 2.08 | 9.88 | 9.78 | 9.85 | 111 |
| 長期 (7-11) | 128 | 99.24 | 99.53 | 8.76 | 1.67 | 1.80 | 1.79 | 8.14 | 8.06 | 8.13 | 105 |
| 超長期 (11-) | 121 | 101.06 | 101.90 | 13.94 | 2.50 | 2.38 | 2.38 | 11.69 | 11.55 | 11.63 | 117 |

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9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 | 99.52 | 99.75 | 3.23 | 1.04 | 1.17 | 1.17 | 3.12 | 3.10 | 3.12 | 77 |
| 短期 (1-3) | 160 | 99.85 | 100.05 | 2.09 | 0.96 | 1.06 | 1.06 | 2.07 | 2.06 | 2.07 | 71 |
| 中期 (3-7) | 73 | 99.45 | 99.74 | 4.00 | 1.12 | 1.27 | 1.26 | 3.91 | 3.88 | 3.91 | 82 |
| 長期 (7-) | 22 | 97.39 | 97.66 | 8.88 | 1.36 | 1.72 | 1.70 | 8.23 | 8.16 | 8.22 | 96 |
| 長期 (7-11) | 18 | 97.37 | 97.61 | 7.69 | 1.21 | 1.61 | 1.59 | 7.33 | 7.27 | 7.33 | 95 |
| 超長期 (11-) | 4 | 97.48 | 97.89 | 14.00 | 1.99 | 2.22 | 2.19 | 12.07 | 11.94 | 12.01 | 97 |
| AAA~A 格 | 944 | 99.45 | 99.83 | 4.54 | 1.35 | 1.51 | 1.51 | 4.21 | 4.17 | 4.20 | 100 |
| 短期 (1-3) | 511 | 99.80 | 100.13 | 2.19 | 1.19 | 1.27 | 1.27 | 2.16 | 2.15 | 2.16 | 92 |
| 中期 (3-7) | 248 | 98.40 | 98.69 | 4.08 | 1.09 | 1.49 | 1.48 | 3.98 | 3.95 | 3.98 | 103 |
| 長期 (7-) | 186 | 99.90 | 100.55 | 11.61 | 2.14 | 2.19 | 2.19 | 10.12 | 10.00 | 10.08 | 119 |
| 長期 (7-11) | 73 | 98.01 | 98.33 | 8.25 | 1.62 | 1.93 | 1.91 | 7.71 | 7.64 | 7.71 | 122 |
| 超長期 (11-) | 113 | 101.11 | 101.97 | 13.77 | 2.48 | 2.36 | 2.36 | 11.61 | 11.47 | 11.55 | 116 |
| AAA~BBB 格 | 944 | 99.45 | 99.83 | 4.54 | 1.35 | 1.51 | 1.51 | 4.21 | 4.17 | 4.20 | 100 |
| 短期 (1-3) | 511 | 99.80 | 100.13 | 2.19 | 1.19 | 1.27 | 1.27 | 2.16 | 2.15 | 2.16 | 92 |
| 中期 (3-7) | 248 | 98.40 | 98.69 | 4.08 | 1.09 | 1.49 | 1.48 | 3.98 | 3.95 | 3.98 | 103 |
| 長期 (7-) | 186 | 99.90 | 100.55 | 11.61 | 2.14 | 2.19 | 2.19 | 10.12 | 10.00 | 10.08 | 119 |
| 長期 (7-11) | 73 | 98.01 | 98.33 | 8.25 | 1.62 | 1.93 | 1.91 | 7.71 | 7.64 | 7.71 | 122 |
| 超長期 (11-) | 113 | 101.11 | 101.97 | 13.77 | 2.48 | 2.36 | 2.36 | 11.61 | 11.47 | 11.55 | 116 |
| AAA~BB 格 | 944 | 99.45 | 99.83 | 4.54 | 1.35 | 1.51 | 1.51 | 4.21 | 4.17 | 4.20 | 100 |
| 短期 (1-3) | 511 | 99.80 | 100.13 | 2.19 | 1.19 | 1.27 | 1.27 | 2.16 | 2.15 | 2.16 | 92 |
| 中期 (3-7) | 248 | 98.40 | 98.69 | 4.08 | 1.09 | 1.49 | 1.48 | 3.98 | 3.95 | 3.98 | 103 |
| 長期 (7-) | 186 | 99.90 | 100.55 | 11.61 | 2.14 | 2.19 | 2.19 | 10.12 | 10.00 | 10.08 | 119 |
| 長期 (7-11) | 73 | 98.01 | 98.33 | 8.25 | 1.62 | 1.93 | 1.91 | 7.71 | 7.64 | 7.71 | 122 |
| 超長期 (11-) | 113 | 101.11 | 101.97 | 13.77 | 2.48 | 2.36 | 2.36 | 11.61 | 11.47 | 11.55 | 116 |
| AAA 格 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 短期 (1-3) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中期 (3-7) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 長期 (7-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 長期 (7-11) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 超長期 (11-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| AA 格 | 255 | 99.52 | 99.75 | 3.23 | 1.04 | 1.17 | 1.17 | 3.12 | 3.10 | 3.12 | 77 |
| 短期 (1-3) | 160 | 99.85 | 100.05 | 2.09 | 0.96 | 1.06 | 1.06 | 2.07 | 2.06 | 2.07 | 71 |
| 中期 (3-7) | 73 | 99.45 | 99.74 | 4.00 | 1.12 | 1.27 | 1.26 | 3.91 | 3.88 | 3.91 | 82 |
| 長期 (7-) | 22 | 97.39 | 97.66 | 8.88 | 1.36 | 1.72 | 1.70 | 8.23 | 8.16 | 8.22 | 96 |
| 長期 (7-11) | 18 | 97.37 | 97.61 | 7.69 | 1.21 | 1.61 | 1.59 | 7.33 | 7.27 | 7.33 | 95 |
| 超長期 (11-) | 4 | 97.48 | 97.89 | 14.00 | 1.99 | 2.22 | 2.19 | 12.07 | 11.94 | 12.01 | 97 |
| A 格 | 690 | 99.43 | 99.86 | 5.02 | 1.47 | 1.64 | 1.63 | 4.61 | 4.57 | 4.60 | 109 |
| 短期 (1-3) | 351 | 99.78 | 100.17 | 2.24 | 1.30 | 1.37 | 1.37 | 2.20 | 2.19 | 2.20 | 101 |
| 中期 (3-7) | 176 | 97.96 | 98.26 | 4.11 | 1.08 | 1.58 | 1.57 | 4.01 | 3.98 | 4.01 | 112 |
| 長期 (7-) | 163 | 100.24 | 100.94 | 11.98 | 2.25 | 2.26 | 2.26 | 10.37 | 10.25 | 10.32 | 122 |
| 長期 (7-11) | 55 | 98.23 | 98.57 | 8.44 | 1.75 | 2.03 | 2.02 | 7.83 | 7.76 | 7.83 | 131 |
| 超長期 (11-) | 109 | 101.25 | 102.13 | 13.76 | 2.50 | 2.36 | 2.37 | 11.59 | 11.45 | 11.53 | 117 |
| 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 | 2,161 | 99.38 | 99.62 | 3.11 | 0.88 | 1.08 | 1.08 | 3.05 | 3.03 | 3.05 | 68 |
| 短期 (1-3) | 1,149 | 99.58 | 99.80 | 2.02 | 0.80 | 1.00 | 1.00 | 2.00 | 1.99 | 2.00 | 66 |
| 中期 (3-7) | 921 | 99.21 | 99.46 | 3.93 | 0.94 | 1.15 | 1.15 | 3.85 | 3.83 | 3.85 | 71 |
| 長期 (7-) | 91 | 98.71 | 98.99 | 8.71 | 1.29 | 1.50 | 1.50 | 8.20 | 8.14 | 8.20 | 75 |
| 長期 (7-11) | 88 | 98.57 | 98.83 | 8.62 | 1.25 | 1.48 | 1.47 | 8.15 | 8.09 | 8.14 | 74 |
| 超長期 (11-) | 3 | 102.90 | 103.91 | 11.09 | 2.41 | 2.09 | 2.12 | 9.72 | 9.62 | 9.70 | 114 |

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9月末、10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 | 243 | 99.51 | 99.73 | 3.33 | 1.04 | 1.17 | 1.17 | 3.22 | 3.20 | 3.22 | 76 |
| 短期 (1-3) | 155 | 99.83 | 100.02 | 2.21 | 0.97 | 1.07 | 1.07 | 2.18 | 2.17 | 2.18 | 72 |
| 中期 (3-7) | 66 | 99.47 | 99.74 | 4.09 | 1.09 | 1.23 | 1.23 | 4.00 | 3.98 | 4.00 | 78 |
| 長期 (7-) | 22 | 97.39 | 97.66 | 8.88 | 1.36 | 1.72 | 1.70 | 8.23 | 8.16 | 8.22 | 96 |
| 長期 (7-11) | 18 | 97.37 | 97.61 | 7.69 | 1.21 | 1.61 | 1.59 | 7.33 | 7.27 | 7.33 | 95 |
| 超長期 (11-) | 4 | 97.48 | 97.89 | 14.00 | 1.99 | 2.22 | 2.19 | 12.07 | 11.94 | 12.01 | 97 |
| AAA~A 格 | 1,085 | 99.50 | 99.85 | 4.57 | 1.39 | 1.53 | 1.53 | 4.24 | 4.20 | 4.23 | 103 |
| 短期 (1-3) | 603 | 99.81 | 100.10 | 2.34 | 1.23 | 1.31 | 1.31 | 2.30 | 2.29 | 2.30 | 95 |
| 中期 (3-7) | 284 | 98.59 | 98.86 | 4.30 | 1.19 | 1.53 | 1.52 | 4.18 | 4.15 | 4.18 | 107 |
| 長期 (7-) | 198 | 99.87 | 100.48 | 11.73 | 2.17 | 2.22 | 2.21 | 10.18 | 10.07 | 10.14 | 120 |
| 長期 (7-11) | 81 | 98.19 | 98.50 | 8.42 | 1.68 | 1.97 | 1.95 | 7.84 | 7.76 | 7.83 | 124 |
| 超長期 (11-) | 118 | 101.02 | 101.85 | 14.01 | 2.50 | 2.38 | 2.39 | 11.74 | 11.60 | 11.68 | 117 |
| AAA~BBB 格 | 1,085 | 99.50 | 99.85 | 4.57 | 1.39 | 1.53 | 1.53 | 4.24 | 4.20 | 4.23 | 103 |
| 短期 (1-3) | 603 | 99.81 | 100.10 | 2.34 | 1.23 | 1.31 | 1.31 | 2.30 | 2.29 | 2.30 | 95 |
| 中期 (3-7) | 284 | 98.59 | 98.86 | 4.30 | 1.19 | 1.53 | 1.52 | 4.18 | 4.15 | 4.18 | 107 |
| 長期 (7-) | 198 | 99.87 | 100.48 | 11.73 | 2.17 | 2.22 | 2.21 | 10.18 | 10.07 | 10.14 | 120 |
| 長期 (7-11) | 81 | 98.19 | 98.50 | 8.42 | 1.68 | 1.97 | 1.95 | 7.84 | 7.76 | 7.83 | 124 |
| 超長期 (11-) | 118 | 101.02 | 101.85 | 14.01 | 2.50 | 2.38 | 2.39 | 11.74 | 11.60 | 11.68 | 117 |
| AAA~BB 格 | 1,085 | 99.50 | 99.85 | 4.57 | 1.39 | 1.53 | 1.53 | 4.24 | 4.20 | 4.23 | 103 |
| 短期 (1-3) | 603 | 99.81 | 100.10 | 2.34 | 1.23 | 1.31 | 1.31 | 2.30 | 2.29 | 2.30 | 95 |
| 中期 (3-7) | 284 | 98.59 | 98.86 | 4.30 | 1.19 | 1.53 | 1.52 | 4.18 | 4.15 | 4.18 | 107 |
| 長期 (7-) | 198 | 99.87 | 100.48 | 11.73 | 2.17 | 2.22 | 2.21 | 10.18 | 10.07 | 10.14 | 120 |
| 長期 (7-11) | 81 | 98.19 | 98.50 | 8.42 | 1.68 | 1.97 | 1.95 | 7.84 | 7.76 | 7.83 | 124 |
| 超長期 (11-) | 118 | 101.02 | 101.85 | 14.01 | 2.50 | 2.38 | 2.39 | 11.74 | 11.60 | 11.68 | 117 |
| AAA 格 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 短期 (1-3) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中期 (3-7) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 長期 (7-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 長期 (7-11) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 超長期 (11-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| AA 格 | 243 | 99.51 | 99.73 | 3.33 | 1.04 | 1.17 | 1.17 | 3.22 | 3.20 | 3.22 | 76 |
| 短期 (1-3) | 155 | 99.83 | 100.02 | 2.21 | 0.97 | 1.07 | 1.07 | 2.18 | 2.17 | 2.18 | 72 |
| 中期 (3-7) | 66 | 99.47 | 99.74 | 4.09 | 1.09 | 1.23 | 1.23 | 4.00 | 3.98 | 4.00 | 78 |
| 長期 (7-) | 22 | 97.39 | 97.66 | 8.88 | 1.36 | 1.72 | 1.70 | 8.23 | 8.16 | 8.22 | 96 |
| 長期 (7-11) | 18 | 97.37 | 97.61 | 7.69 | 1.21 | 1.61 | 1.59 | 7.33 | 7.27 | 7.33 | 95 |
| 超長期 (11-) | 4 | 97.48 | 97.89 | 14.00 | 1.99 | 2.22 | 2.19 | 12.07 | 11.94 | 12.01 | 97 |
| A 格 | 842 | 99.50 | 99.88 | 4.93 | 1.49 | 1.64 | 1.63 | 4.53 | 4.49 | 4.52 | 110 |
| 短期 (1-3) | 448 | 99.80 | 100.13 | 2.38 | 1.32 | 1.39 | 1.39 | 2.35 | 2.33 | 2.35 | 103 |
| 中期 (3-7) | 218 | 98.32 | 98.59 | 4.36 | 1.21 | 1.62 | 1.61 | 4.24 | 4.20 | 4.24 | 116 |
| 長期 (7-) | 176 | 100.18 | 100.84 | 12.09 | 2.27 | 2.28 | 2.28 | 10.42 | 10.30 | 10.38 | 123 |
| 長期 (7-11) | 63 | 98.43 | 98.75 | 8.63 | 1.82 | 2.07 | 2.06 | 7.98 | 7.90 | 7.97 | 133 |
| 超長期 (11-) | 113 | 101.15 | 102.00 | 14.01 | 2.52 | 2.39 | 2.40 | 11.73 | 11.59 | 11.66 | 118 |
| BBB 格 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 短期 (1-3) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中期 (3-7) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 長期 (7-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 長期 (7-11) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 超長期 (11-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| BB 格 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 短期 (1-3) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中期 (3-7) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 長期 (7-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 長期 (7-11) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 超長期 (11-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| B 格以下 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 短期 (1-3) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中期 (3-7) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 長期 (7-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 長期 (7-11) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 超長期 (11-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 格付なし | 2,040 | 99.36 | 99.59 | 3.24 | 0.89 | 1.10 | 1.09 | 3.17 | 3.15 | 3.17 | 69 |
| 短期 (1-3) | 1,086 | 99.52 | 99.73 | 2.18 | 0.81 | 1.01 | 1.01 | 2.16 | 2.15 | 2.16 | 66 |
| 中期 (3-7) | 875 | 99.17 | 99.42 | 4.03 | 0.95 | 1.16 | 1.16 | 3.95 | 3.92 | 3.95 | 71 |
| 長期 (7-) | 79 | 99.34 | 99.63 | 8.95 | 1.41 | 1.53 | 1.53 | 8.38 | 8.31 | 8.37 | 76 |
| 長期 (7-11) | 76 | 99.20 | 99.46 | 8.86 | 1.37 | 1.51 | 1.50 | 8.32 | 8.26 | 8.31 | 75 |
| 超長期 (11-) | 3 | 102.90 | 103.91 | 11.09 | 2.41 | 2.09 | 2.12 | 9.72 | 9.62 | 9.70 | 114 |

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9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 | 1,282 | 99.57 | 99.80 | 3.07 | 0.79 | 0.95 | 0.95 | 3.02 | 3.00 | 3.02 | 55 |
| 短期 (1-3) | 661 | 99.65 | 99.85 | 1.88 | 0.66 | 0.86 | 0.86 | 1.87 | 1.86 | 1.87 | 53 |
| 中期 (3-7) | 566 | 99.57 | 99.81 | 3.94 | 0.91 | 1.02 | 1.02 | 3.87 | 3.85 | 3.87 | 58 |
| 長期 (7-) | 56 | 98.80 | 99.06 | 8.32 | 1.07 | 1.28 | 1.27 | 7.96 | 7.91 | 7.95 | 56 |
| 長期 (7-11) | 56 | 98.80 | 99.06 | 8.32 | 1.07 | 1.28 | 1.27 | 7.96 | 7.91 | 7.95 | 56 |
| 超長期 (11-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| AAA~A 格 | 2,183 | 99.78 | 100.06 | 3.38 | 0.95 | 1.06 | 1.06 | 3.26 | 3.24 | 3.26 | 64 |
| 短期 (1-3) | 1,214 | 99.78 | 100.03 | 2.02 | 0.84 | 0.95 | 0.95 | 2.00 | 1.99 | 2.00 | 62 |
| 中期 (3-7) | 801 | 99.44 | 99.71 | 3.93 | 0.95 | 1.09 | 1.09 | 3.86 | 3.84 | 3.86 | 65 |
| 長期 (7-) | 168 | 101.34 | 101.89 | 10.52 | 1.79 | 1.73 | 1.75 | 9.43 | 9.35 | 9.41 | 84 |
| 長期 (7-11) | 106 | 98.46 | 98.74 | 8.57 | 1.25 | 1.49 | 1.48 | 8.10 | 8.04 | 8.09 | 75 |
| 超長期 (11-) | 62 | 106.30 | 107.32 | 13.88 | 2.73 | 2.12 | 2.18 | 11.55 | 11.43 | 11.49 | 97 |
| AAA~BBB 格 | 2,881 | 99.48 | 99.76 | 3.61 | 1.00 | 1.17 | 1.17 | 3.46 | 3.44 | 3.46 | 73 |
| 短期 (1-3) | 1,482 | 99.74 | 99.98 | 2.07 | 0.87 | 1.00 | 1.00 | 2.05 | 2.04 | 2.05 | 66 |
| 中期 (3-7) | 1,130 | 99.11 | 99.36 | 3.95 | 0.97 | 1.20 | 1.19 | 3.87 | 3.85 | 3.87 | 75 |
| 長期 (7-) | 269 | 99.67 | 100.21 | 10.75 | 1.88 | 1.96 | 1.96 | 9.56 | 9.46 | 9.53 | 103 |
| 長期 (7-11) | 153 | 98.54 | 98.84 | 8.51 | 1.43 | 1.66 | 1.65 | 7.99 | 7.93 | 7.99 | 93 |
| 超長期 (11-) | 116 | 101.16 | 102.02 | 13.70 | 2.48 | 2.35 | 2.36 | 11.56 | 11.42 | 11.50 | 116 |
| AAA~BB 格 | 2,881 | 99.48 | 99.76 | 3.61 | 1.00 | 1.17 | 1.17 | 3.46 | 3.44 | 3.46 | 73 |
| 短期 (1-3) | 1,482 | 99.74 | 99.98 | 2.07 | 0.87 | 1.00 | 1.00 | 2.05 | 2.04 | 2.05 | 66 |
| 中期 (3-7) | 1,130 | 99.11 | 99.36 | 3.95 | 0.97 | 1.20 | 1.19 | 3.87 | 3.85 | 3.87 | 75 |
| 長期 (7-) | 269 | 99.67 | 100.21 | 10.75 | 1.88 | 1.96 | 1.96 | 9.56 | 9.46 | 9.53 | 103 |
| 長期 (7-11) | 153 | 98.54 | 98.84 | 8.51 | 1.43 | 1.66 | 1.65 | 7.99 | 7.93 | 7.99 | 93 |
| 超長期 (11-) | 116 | 101.16 | 102.02 | 13.70 | 2.48 | 2.35 | 2.36 | 11.56 | 11.42 | 11.50 | 116 |
| AAA 格 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 短期 (1-3) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中期 (3-7) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 長期 (7-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 長期 (7-11) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 超長期 (11-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| AA 格 | 1,282 | 99.57 | 99.80 | 3.07 | 0.79 | 0.95 | 0.95 | 3.02 | 3.00 | 3.02 | 55 |
| 短期 (1-3) | 661 | 99.65 | 99.85 | 1.88 | 0.66 | 0.86 | 0.86 | 1.87 | 1.86 | 1.87 | 53 |
| 中期 (3-7) | 566 | 99.57 | 99.81 | 3.94 | 0.91 | 1.02 | 1.02 | 3.87 | 3.85 | 3.87 | 58 |
| 長期 (7-) | 56 | 98.80 | 99.06 | 8.32 | 1.07 | 1.28 | 1.27 | 7.96 | 7.91 | 7.95 | 56 |
| 長期 (7-11) | 56 | 98.80 | 99.06 | 8.32 | 1.07 | 1.28 | 1.27 | 7.96 | 7.91 | 7.95 | 56 |
| 超長期 (11-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| A 格 | 901 | 100.07 | 100.42 | 3.80 | 1.19 | 1.23 | 1.23 | 3.61 | 3.58 | 3.60 | 77 |
| 短期 (1-3) | 553 | 99.95 | 100.25 | 2.18 | 1.06 | 1.07 | 1.07 | 2.15 | 2.14 | 2.15 | 72 |
| 中期 (3-7) | 236 | 99.15 | 99.45 | 3.91 | 1.04 | 1.25 | 1.25 | 3.83 | 3.81 | 3.83 | 81 |
| 長期 (7-) | 112 | 102.61 | 103.30 | 11.61 | 2.15 | 1.95 | 1.98 | 10.14 | 10.04 | 10.10 | 97 |
| 長期 (7-11) | 50 | 98.10 | 98.39 | 8.84 | 1.43 | 1.73 | 1.72 | 8.26 | 8.18 | 8.25 | 97 |
| 超長期 (11-) | 62 | 106.30 | 107.32 | 13.88 | 2.73 | 2.12 | 2.18 | 11.55 | 11.43 | 11.49 | 97 |
| BBB 格 | 698 | 98.56 | 98.83 | 4.36 | 1.16 | 1.50 | 1.49 | 4.10 | 4.06 | 4.09 | 101 |
| 短期 (1-3) | 268 | 99.54 | 99.75 | 2.29 | 1.02 | 1.23 | 1.22 | 2.27 | 2.25 | 2.27 | 87 |
| 中期 (3-7) | 329 | 98.28 | 98.51 | 3.98 | 1.01 | 1.47 | 1.46 | 3.89 | 3.87 | 3.89 | 102 |
| 長期 (7-) | 101 | 96.89 | 97.40 | 11.15 | 2.04 | 2.37 | 2.34 | 9.78 | 9.66 | 9.75 | 138 |
| 長期 (7-11) | 46 | 98.73 | 99.06 | 8.38 | 1.86 | 2.06 | 2.05 | 7.75 | 7.67 | 7.74 | 135 |
| 超長期 (11-) | 54 | 95.33 | 95.99 | 13.50 | 2.19 | 2.64 | 2.59 | 11.56 | 11.41 | 11.51 | 140 |
| BB 格 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 短期 (1-3) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中期 (3-7) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 長期 (7-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 長期 (7-11) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 超長期 (11-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| B 格以下 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 短期 (1-3) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中期 (3-7) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 長期 (7-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 長期 (7-11) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 超長期 (11-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 格付なし | 225 | 98.37 | 98.73 | 2.67 | 1.27 | 1.79 | 1.78 | 2.60 | 2.58 | 2.60 | 141 |
| 短期 (1-3) | 178 | 98.87 | 99.22 | 2.11 | 1.31 | 1.76 | 1.75 | 2.07 | 2.06 | 2.07 | 142 |
| 中期 (3-7) | 39 | 96.99 | 97.40 | 4.30 | 1.11 | 1.87 | 1.85 | 4.18 | 4.15 | 4.18 | 139 |
| 長期 (7-) | 8 | 93.94 | 94.05 | 7.41 | 1.15 | 2.10 | 2.04 | 7.10 | 7.03 | 7.10 | 143 |
| 長期 (7-11) | 8 | 93.94 | 94.05 | 7.41 | 1.15 | 2.10 | 2.04 | 7.10 | 7.03 | 7.10 | 143 |
| 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9月末、10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 | 1,164 | 99.55 | 99.77 | 3.28 | 0.81 | 0.96 | 0.96 | 3.22 | 3.20 | 3.22 | 55 |
| 短期 (1-3) | 607 | 99.53 | 99.74 | 2.17 | 0.67 | 0.89 | 0.88 | 2.15 | 2.14 | 2.15 | 53 |
| 中期 (3-7) | 512 | 99.54 | 99.78 | 4.13 | 0.93 | 1.02 | 1.02 | 4.04 | 4.02 | 4.04 | 57 |
| 長期 (7-) | 45 | 99.93 | 100.21 | 8.65 | 1.24 | 1.27 | 1.27 | 8.20 | 8.15 | 8.20 | 53 |
| 長期 (7-11) | 45 | 99.93 | 100.21 | 8.65 | 1.24 | 1.27 | 1.27 | 8.20 | 8.15 | 8.20 | 53 |
| 超長期 (11-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| AAA~A 格 | 2,065 | 99.78 | 100.06 | 3.51 | 0.97 | 1.08 | 1.08 | 3.39 | 3.37 | 3.39 | 65 |
| 短期 (1-3) | 1,160 | 99.73 | 99.98 | 2.17 | 0.85 | 0.97 | 0.97 | 2.15 | 2.14 | 2.15 | 62 |
| 中期 (3-7) | 748 | 99.42 | 99.68 | 4.06 | 0.96 | 1.10 | 1.09 | 3.98 | 3.96 | 3.98 | 65 |
| 長期 (7-) | 157 | 101.85 | 102.43 | 10.77 | 1.89 | 1.76 | 1.78 | 9.60 | 9.51 | 9.57 | 85 |
| 長期 (7-11) | 95 | 98.96 | 99.24 | 8.75 | 1.34 | 1.51 | 1.50 | 8.23 | 8.17 | 8.23 | 76 |
| 超長期 (11-) | 62 | 106.30 | 107.32 | 13.88 | 2.73 | 2.12 | 2.18 | 11.55 | 11.43 | 11.49 | 97 |
| AAA~BBB 格 | 2,915 | 99.49 | 99.76 | 3.76 | 1.05 | 1.21 | 1.21 | 3.60 | 3.57 | 3.60 | 76 |
| 短期 (1-3) | 1,525 | 99.71 | 99.94 | 2.24 | 0.92 | 1.05 | 1.05 | 2.22 | 2.20 | 2.22 | 69 |
| 中期 (3-7) | 1,119 | 99.10 | 99.35 | 4.09 | 1.01 | 1.23 | 1.23 | 4.00 | 3.97 | 4.00 | 78 |
| 長期 (7-) | 270 | 99.88 | 100.42 | 11.04 | 1.98 | 2.02 | 2.02 | 9.74 | 9.64 | 9.71 | 107 |
| 長期 (7-11) | 149 | 98.93 | 99.22 | 8.70 | 1.55 | 1.73 | 1.72 | 8.12 | 8.05 | 8.11 | 98 |
| 超長期 (11-) | 121 | 101.06 | 101.90 | 13.94 | 2.50 | 2.38 | 2.38 | 11.69 | 11.55 | 11.63 | 117 |
| AAA~BB 格 | 2,915 | 99.49 | 99.76 | 3.76 | 1.05 | 1.21 | 1.21 | 3.60 | 3.57 | 3.60 | 76 |
| 短期 (1-3) | 1,525 | 99.71 | 99.94 | 2.24 | 0.92 | 1.05 | 1.05 | 2.22 | 2.20 | 2.22 | 69 |
| 中期 (3-7) | 1,119 | 99.10 | 99.35 | 4.09 | 1.01 | 1.23 | 1.23 | 4.00 | 3.97 | 4.00 | 78 |
| 長期 (7-) | 270 | 99.88 | 100.42 | 11.04 | 1.98 | 2.02 | 2.02 | 9.74 | 9.64 | 9.71 | 107 |
| 長期 (7-11) | 149 | 98.93 | 99.22 | 8.70 | 1.55 | 1.73 | 1.72 | 8.12 | 8.05 | 8.11 | 98 |
| 超長期 (11-) | 121 | 101.06 | 101.90 | 13.94 | 2.50 | 2.38 | 2.38 | 11.69 | 11.55 | 11.63 | 117 |
| AAA 格 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 短期 (1-3) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中期 (3-7) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 長期 (7-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 長期 (7-11) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 超長期 (11-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| AA 格 | 1,164 | 99.55 | 99.77 | 3.28 | 0.81 | 0.96 | 0.96 | 3.22 | 3.20 | 3.22 | 55 |
| 短期 (1-3) | 607 | 99.53 | 99.74 | 2.17 | 0.67 | 0.89 | 0.88 | 2.15 | 2.14 | 2.15 | 53 |
| 中期 (3-7) | 512 | 99.54 | 99.78 | 4.13 | 0.93 | 1.02 | 1.02 | 4.04 | 4.02 | 4.04 | 57 |
| 長期 (7-) | 45 | 99.93 | 100.21 | 8.65 | 1.24 | 1.27 | 1.27 | 8.20 | 8.15 | 8.20 | 53 |
| 長期 (7-11) | 45 | 99.93 | 100.21 | 8.65 | 1.24 | 1.27 | 1.27 | 8.20 | 8.15 | 8.20 | 53 |
| 超長期 (11-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| A 格 | 901 | 100.07 | 100.42 | 3.80 | 1.19 | 1.23 | 1.23 | 3.61 | 3.58 | 3.60 | 77 |
| 短期 (1-3) | 553 | 99.95 | 100.25 | 2.18 | 1.06 | 1.07 | 1.07 | 2.15 | 2.14 | 2.15 | 72 |
| 中期 (3-7) | 236 | 99.15 | 99.45 | 3.91 | 1.04 | 1.25 | 1.25 | 3.83 | 3.81 | 3.83 | 81 |
| 長期 (7-) | 112 | 102.61 | 103.30 | 11.61 | 2.15 | 1.95 | 1.98 | 10.14 | 10.04 | 10.10 | 97 |
| 長期 (7-11) | 50 | 98.10 | 98.39 | 8.84 | 1.43 | 1.73 | 1.72 | 8.26 | 8.18 | 8.25 | 97 |
| 超長期 (11-) | 62 | 106.30 | 107.32 | 13.88 | 2.73 | 2.12 | 2.18 | 11.55 | 11.43 | 11.49 | 97 |
| BBB 格 | 850 | 98.79 | 99.03 | 4.39 | 1.24 | 1.53 | 1.52 | 4.11 | 4.08 | 4.11 | 104 |
| 短期 (1-3) | 365 | 99.63 | 99.82 | 2.46 | 1.13 | 1.29 | 1.29 | 2.42 | 2.41 | 2.42 | 92 |
| 中期 (3-7) | 371 | 98.46 | 98.68 | 4.14 | 1.10 | 1.51 | 1.50 | 4.04 | 4.01 | 4.04 | 105 |
| 長期 (7-) | 113 | 97.17 | 97.65 | 11.41 | 2.09 | 2.39 | 2.36 | 9.93 | 9.81 | 9.90 | 138 |
| 長期 (7-11) | 55 | 98.88 | 99.19 | 8.61 | 1.92 | 2.10 | 2.09 | 7.93 | 7.84 | 7.92 | 136 |
| 超長期 (11-) | 59 | 95.59 | 96.22 | 14.00 | 2.25 | 2.68 | 2.62 | 11.85 | 11.69 | 11.78 | 140 |
| BB 格 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 短期 (1-3) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中期 (3-7) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 長期 (7-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 長期 (7-11) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 超長期 (11-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| B 格以下 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 短期 (1-3) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中期 (3-7) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 長期 (7-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 長期 (7-11) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 超長期 (11-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 格付なし | 210 | 98.29 | 98.64 | 2.79 | 1.29 | 1.82 | 1.81 | 2.71 | 2.69 | 2.71 | 143 |
| 短期 (1-3) | 163 | 98.81 | 99.16 | 2.20 | 1.34 | 1.80 | 1.79 | 2.17 | 2.15 | 2.17 | 144 |
| 中期 (3-7) | 39 | 96.99 | 97.40 | 4.30 | 1.11 | 1.87 | 1.85 | 4.18 | 4.15 | 4.18 | 139 |
| 長期 (7-) | 8 | 93.94 | 94.05 | 7.41 | 1.15 | 2.10 | 2.04 | 7.10 | 7.03 | 7.10 | 143 |
| 長期 (7-11) | 8 | 93.94 | 94.05 | 7.41 | 1.15 | 2.10 | 2.04 | 7.10 | 7.03 | 7.10 | 143 |
| 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9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 | 289 | 99.45 | 99.60 | 3.14 | 0.74 | 0.92 | 0.91 | 3.09 | 3.07 | 3.09 | 52 |
| 短期 (1-3) | 177 | 99.72 | 99.88 | 2.19 | 0.73 | 0.86 | 0.86 | 2.17 | 2.17 | 2.17 | 51 |
| 中期 (3-7) | 98 | 99.12 | 99.24 | 4.16 | 0.74 | 0.98 | 0.98 | 4.10 | 4.08 | 4.10 | 53 |
| 長期 (7-) | 14 | 98.45 | 98.53 | 8.12 | 0.94 | 1.20 | 1.18 | 7.83 | 7.79 | 7.83 | 50 |
| 長期 (7-11) | 14 | 98.45 | 98.53 | 8.12 | 0.94 | 1.20 | 1.18 | 7.83 | 7.79 | 7.83 | 50 |
| 超長期 (11-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| AAA~A 格 | 2,112 | 99.79 | 100.06 | 3.35 | 0.95 | 1.05 | 1.05 | 3.24 | 3.22 | 3.24 | 64 |
| 短期 (1-3) | 1,176 | 99.78 | 100.03 | 2.04 | 0.84 | 0.95 | 0.95 | 2.02 | 2.01 | 2.02 | 61 |
| 中期 (3-7) | 787 | 99.46 | 99.71 | 3.93 | 0.94 | 1.08 | 1.08 | 3.85 | 3.83 | 3.85 | 64 |
| 長期 (7-) | 150 | 101.62 | 102.21 | 10.60 | 1.78 | 1.69 | 1.71 | 9.50 | 9.41 | 9.47 | 79 |
| 長期 (7-11) | 88 | 98.36 | 98.65 | 8.32 | 1.11 | 1.37 | 1.36 | 7.94 | 7.88 | 7.93 | 65 |
| 超長期 (11-) | 62 | 106.30 | 107.32 | 13.88 | 2.73 | 2.12 | 2.18 | 11.55 | 11.43 | 11.49 | 97 |
| AAA~BBB 格 | 3,030 | 99.41 | 99.69 | 3.58 | 1.01 | 1.20 | 1.20 | 3.43 | 3.41 | 3.43 | 77 |
| 短期 (1-3) | 1,599 | 99.65 | 99.89 | 2.09 | 0.90 | 1.06 | 1.06 | 2.07 | 2.06 | 2.07 | 71 |
| 中期 (3-7) | 1,157 | 99.04 | 99.30 | 3.96 | 0.97 | 1.22 | 1.21 | 3.88 | 3.86 | 3.88 | 77 |
| 長期 (7-) | 274 | 99.56 | 100.09 | 10.68 | 1.88 | 1.97 | 1.97 | 9.51 | 9.41 | 9.48 | 105 |
| 長期 (7-11) | 158 | 98.38 | 98.67 | 8.47 | 1.43 | 1.69 | 1.68 | 7.96 | 7.89 | 7.95 | 96 |
| 超長期 (11-) | 116 | 101.16 | 102.02 | 13.70 | 2.48 | 2.35 | 2.36 | 11.56 | 11.42 | 11.50 | 116 |
| AAA~BB 格 | 3,030 | 99.41 | 99.69 | 3.58 | 1.01 | 1.20 | 1.20 | 3.43 | 3.41 | 3.43 | 77 |
| 短期 (1-3) | 1,599 | 99.65 | 99.89 | 2.09 | 0.90 | 1.06 | 1.06 | 2.07 | 2.06 | 2.07 | 71 |
| 中期 (3-7) | 1,157 | 99.04 | 99.30 | 3.96 | 0.97 | 1.22 | 1.21 | 3.88 | 3.86 | 3.88 | 77 |
| 長期 (7-) | 274 | 99.56 | 100.09 | 10.68 | 1.88 | 1.97 | 1.97 | 9.51 | 9.41 | 9.48 | 105 |
| 長期 (7-11) | 158 | 98.38 | 98.67 | 8.47 | 1.43 | 1.69 | 1.68 | 7.96 | 7.89 | 7.95 | 96 |
| 超長期 (11-) | 116 | 101.16 | 102.02 | 13.70 | 2.48 | 2.35 | 2.36 | 11.56 | 11.42 | 11.50 | 116 |
| AAA 格 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 短期 (1-3) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中期 (3-7) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 長期 (7-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 長期 (7-11) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 超長期 (11-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| AA 格 | 289 | 99.45 | 99.60 | 3.14 | 0.74 | 0.92 | 0.91 | 3.09 | 3.07 | 3.09 | 52 |
| 短期 (1-3) | 177 | 99.72 | 99.88 | 2.19 | 0.73 | 0.86 | 0.86 | 2.17 | 2.17 | 2.17 | 51 |
| 中期 (3-7) | 98 | 99.12 | 99.24 | 4.16 | 0.74 | 0.98 | 0.98 | 4.10 | 4.08 | 4.10 | 53 |
| 長期 (7-) | 14 | 98.45 | 98.53 | 8.12 | 0.94 | 1.20 | 1.18 | 7.83 | 7.79 | 7.83 | 50 |
| 長期 (7-11) | 14 | 98.45 | 98.53 | 8.12 | 0.94 | 1.20 | 1.18 | 7.83 | 7.79 | 7.83 | 50 |
| 超長期 (11-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| A 格 | 1,824 | 99.85 | 100.14 | 3.38 | 0.98 | 1.07 | 1.08 | 3.26 | 3.24 | 3.26 | 65 |
| 短期 (1-3) | 998 | 99.80 | 100.05 | 2.01 | 0.86 | 0.97 | 0.97 | 1.99 | 1.98 | 1.99 | 63 |
| 中期 (3-7) | 689 | 99.50 | 99.77 | 3.89 | 0.97 | 1.10 | 1.09 | 3.82 | 3.80 | 3.82 | 66 |
| 長期 (7-) | 136 | 101.94 | 102.58 | 10.85 | 1.86 | 1.74 | 1.76 | 9.66 | 9.57 | 9.63 | 82 |
| 長期 (7-11) | 75 | 98.34 | 98.67 | 8.36 | 1.14 | 1.40 | 1.39 | 7.96 | 7.90 | 7.95 | 68 |
| 超長期 (11-) | 62 | 106.30 | 107.32 | 13.88 | 2.73 | 2.12 | 2.18 | 11.55 | 11.43 | 11.49 | 97 |
| BBB 格 | 918 | 98.53 | 98.81 | 4.11 | 1.17 | 1.55 | 1.54 | 3.88 | 3.85 | 3.88 | 107 |
| 短期 (1-3) | 424 | 99.27 | 99.52 | 2.23 | 1.05 | 1.36 | 1.35 | 2.21 | 2.19 | 2.21 | 100 |
| 中期 (3-7) | 370 | 98.17 | 98.44 | 4.03 | 1.04 | 1.51 | 1.50 | 3.94 | 3.91 | 3.94 | 106 |
| 長期 (7-) | 124 | 97.06 | 97.51 | 10.78 | 1.99 | 2.33 | 2.30 | 9.53 | 9.42 | 9.50 | 137 |
| 長期 (7-11) | 70 | 98.42 | 98.70 | 8.66 | 1.84 | 2.09 | 2.08 | 7.99 | 7.90 | 7.98 | 134 |
| 超長期 (11-) | 54 | 95.33 | 95.99 | 13.50 | 2.19 | 2.64 | 2.59 | 11.56 | 11.41 | 11.51 | 140 |
| 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 | 99.21 | 99.64 | 2.14 | 1.41 | 1.71 | 1.70 | 2.09 | 2.07 | 2.09 | 137 |
| 短期 (1-3) | 61 | 99.64 | 100.08 | 1.60 | 1.53 | 1.77 | 1.76 | 1.58 | 1.56 | 1.58 | 146 |
| 中期 (3-7) | 13 | 98.12 | 98.53 | 3.81 | 0.97 | 1.45 | 1.44 | 3.74 | 3.71 | 3.74 | 101 |
| 長期 (7-) | 2 | 93.79 | 93.87 | 7.35 | 0.51 | 1.45 | 1.41 | 7.21 | 7.16 | 7.21 | 80 |
| 長期 (7-11) | 2 | 93.79 | 93.87 | 7.35 | 0.51 | 1.45 | 1.41 | 7.21 | 7.16 | 7.21 | 80 |
| 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9月末、10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 | 279 | 99.44 | 99.58 | 3.21 | 0.75 | 0.92 | 0.92 | 3.16 | 3.15 | 3.16 | 51 |
| 短期 (1-3) | 168 | 99.71 | 99.86 | 2.26 | 0.73 | 0.86 | 0.86 | 2.24 | 2.23 | 2.24 | 50 |
| 中期 (3-7) | 98 | 99.12 | 99.24 | 4.16 | 0.74 | 0.98 | 0.98 | 4.10 | 4.08 | 4.10 | 53 |
| 長期 (7-) | 14 | 98.45 | 98.53 | 8.12 | 0.94 | 1.20 | 1.18 | 7.83 | 7.79 | 7.83 | 50 |
| 長期 (7-11) | 14 | 98.45 | 98.53 | 8.12 | 0.94 | 1.20 | 1.18 | 7.83 | 7.79 | 7.83 | 50 |
| 超長期 (11-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| AAA~A 格 | 2,006 | 99.79 | 100.06 | 3.47 | 0.96 | 1.07 | 1.07 | 3.36 | 3.34 | 3.36 | 64 |
| 短期 (1-3) | 1,127 | 99.73 | 99.98 | 2.18 | 0.85 | 0.97 | 0.97 | 2.16 | 2.15 | 2.16 | 62 |
| 中期 (3-7) | 740 | 99.43 | 99.68 | 4.05 | 0.96 | 1.09 | 1.09 | 3.96 | 3.94 | 3.96 | 65 |
| 長期 (7-) | 139 | 102.22 | 102.84 | 10.90 | 1.89 | 1.72 | 1.74 | 9.69 | 9.61 | 9.66 | 80 |
| 長期 (7-11) | 77 | 98.95 | 99.25 | 8.51 | 1.21 | 1.38 | 1.37 | 8.08 | 8.03 | 8.08 | 65 |
| 超長期 (11-) | 62 | 106.30 | 107.32 | 13.88 | 2.73 | 2.12 | 2.18 | 11.55 | 11.43 | 11.49 | 97 |
| AAA~BBB 格 | 3,061 | 99.42 | 99.68 | 3.73 | 1.06 | 1.24 | 1.23 | 3.57 | 3.54 | 3.56 | 79 |
| 短期 (1-3) | 1,633 | 99.62 | 99.86 | 2.25 | 0.94 | 1.10 | 1.09 | 2.22 | 2.21 | 2.22 | 74 |
| 中期 (3-7) | 1,153 | 99.04 | 99.29 | 4.09 | 1.01 | 1.25 | 1.25 | 4.00 | 3.98 | 4.00 | 80 |
| 長期 (7-) | 276 | 99.76 | 100.29 | 10.97 | 1.96 | 2.03 | 2.02 | 9.69 | 9.59 | 9.66 | 108 |
| 長期 (7-11) | 155 | 98.75 | 99.04 | 8.65 | 1.55 | 1.75 | 1.74 | 8.08 | 8.01 | 8.08 | 100 |
| 超長期 (11-) | 121 | 101.06 | 101.90 | 13.94 | 2.50 | 2.38 | 2.38 | 11.69 | 11.55 | 11.63 | 117 |
| AAA~BB 格 | 3,061 | 99.42 | 99.68 | 3.73 | 1.06 | 1.24 | 1.23 | 3.57 | 3.54 | 3.56 | 79 |
| 短期 (1-3) | 1,633 | 99.62 | 99.86 | 2.25 | 0.94 | 1.10 | 1.09 | 2.22 | 2.21 | 2.22 | 74 |
| 中期 (3-7) | 1,153 | 99.04 | 99.29 | 4.09 | 1.01 | 1.25 | 1.25 | 4.00 | 3.98 | 4.00 | 80 |
| 長期 (7-) | 276 | 99.76 | 100.29 | 10.97 | 1.96 | 2.03 | 2.02 | 9.69 | 9.59 | 9.66 | 108 |
| 長期 (7-11) | 155 | 98.75 | 99.04 | 8.65 | 1.55 | 1.75 | 1.74 | 8.08 | 8.01 | 8.08 | 100 |
| 超長期 (11-) | 121 | 101.06 | 101.90 | 13.94 | 2.50 | 2.38 | 2.38 | 11.69 | 11.55 | 11.63 | 117 |
| AAA 格 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 短期 (1-3) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中期 (3-7) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 長期 (7-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 長期 (7-11) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 超長期 (11-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| AA 格 | 279 | 99.44 | 99.58 | 3.21 | 0.75 | 0.92 | 0.92 | 3.16 | 3.15 | 3.16 | 51 |
| 短期 (1-3) | 168 | 99.71 | 99.86 | 2.26 | 0.73 | 0.86 | 0.86 | 2.24 | 2.23 | 2.24 | 50 |
| 中期 (3-7) | 98 | 99.12 | 99.24 | 4.16 | 0.74 | 0.98 | 0.98 | 4.10 | 4.08 | 4.10 | 53 |
| 長期 (7-) | 14 | 98.45 | 98.53 | 8.12 | 0.94 | 1.20 | 1.18 | 7.83 | 7.79 | 7.83 | 50 |
| 長期 (7-11) | 14 | 98.45 | 98.53 | 8.12 | 0.94 | 1.20 | 1.18 | 7.83 | 7.79 | 7.83 | 50 |
| 超長期 (11-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| A 格 | 1,727 | 99.85 | 100.14 | 3.51 | 1.00 | 1.09 | 1.09 | 3.39 | 3.37 | 3.39 | 66 |
| 短期 (1-3) | 960 | 99.74 | 100.00 | 2.17 | 0.87 | 0.99 | 0.99 | 2.15 | 2.14 | 2.15 | 64 |
| 中期 (3-7) | 642 | 99.47 | 99.74 | 4.03 | 0.99 | 1.11 | 1.11 | 3.94 | 3.92 | 3.94 | 66 |
| 長期 (7-) | 125 | 102.63 | 103.32 | 11.20 | 1.99 | 1.77 | 1.80 | 9.89 | 9.80 | 9.85 | 83 |
| 長期 (7-11) | 63 | 99.05 | 99.41 | 8.59 | 1.27 | 1.41 | 1.41 | 8.13 | 8.08 | 8.13 | 68 |
| 超長期 (11-) | 62 | 106.30 | 107.32 | 13.88 | 2.73 | 2.12 | 2.18 | 11.55 | 11.43 | 11.49 | 97 |
| BBB 格 | 1,056 | 98.70 | 98.96 | 4.21 | 1.24 | 1.57 | 1.56 | 3.96 | 3.93 | 3.96 | 109 |
| 短期 (1-3) | 506 | 99.38 | 99.60 | 2.40 | 1.13 | 1.38 | 1.37 | 2.37 | 2.35 | 2.37 | 101 |
| 中期 (3-7) | 413 | 98.34 | 98.60 | 4.17 | 1.11 | 1.54 | 1.53 | 4.07 | 4.04 | 4.07 | 108 |
| 長期 (7-) | 137 | 97.28 | 97.71 | 11.03 | 2.04 | 2.35 | 2.32 | 9.68 | 9.56 | 9.65 | 138 |
| 長期 (7-11) | 78 | 98.56 | 98.83 | 8.80 | 1.88 | 2.11 | 2.10 | 8.09 | 8.00 | 8.08 | 136 |
| 超長期 (11-) | 59 | 95.59 | 96.22 | 14.00 | 2.25 | 2.68 | 2.62 | 11.85 | 11.69 | 11.78 | 140 |
| BB 格 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 短期 (1-3) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中期 (3-7) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 長期 (7-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 長期 (7-11) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 超長期 (11-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| B 格以下 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 短期 (1-3) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中期 (3-7) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 長期 (7-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 長期 (7-11) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 超長期 (11-) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 格付なし | 64 | 99.11 | 99.54 | 2.33 | 1.48 | 1.80 | 1.79 | 2.28 | 2.26 | 2.28 | 144 |
| 短期 (1-3) | 56 | 99.56 | 100.02 | 1.88 | 1.62 | 1.87 | 1.86 | 1.85 | 1.83 | 1.85 | 153 |
| 中期 (3-7) | 6 | 96.97 | 97.18 | 4.64 | 0.58 | 1.27 | 1.25 | 4.57 | 4.54 | 4.57 | 79 |
| 長期 (7-) | 2 | 93.79 | 93.87 | 7.35 | 0.51 | 1.45 | 1.41 | 7.21 | 7.16 | 7.21 | 80 |
| 長期 (7-11) | 2 | 93.79 | 93.87 | 7.35 | 0.51 | 1.45 | 1.41 | 7.21 | 7.16 | 7.21 | 80 |
| 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9月末 |
|----------|----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|
| 銘柄数 | 13,875 | 14,702 | 15,303 | 15,524 | 16,009 | 16,100 |
| 額面(10億円) | 970,751 | 1,016,799 | 1,055,162 | 1,084,026 | 1,123,852 | 1,137,187 |
| 時価単価(円) | 108.41 | 106.49 | 104.20 | 101.51 | 98.40 | 96.80 |
| 利含単価(円) | 108.53 | 106.60 | 104.31 | 101.62 | 98.50 | 96.91 |
| 残存年数(年) | 9.85 | 9.89 | 10.02 | 10.17 | 10.21 | 10.25 |
| 利率(%) | 0.89 | 0.83 | 0.79 | 0.77 | 0.78 | 0.81 |
| 単利(%) | 0.08 | 0.14 | 0.27 | 0.43 | 0.73 | 0.92 |
| 複利(%) | 0.08 | 0.14 | 0.27 | 0.43 | 0.72 | 0.89 |
| Dur(年) | 9.47 | 9.36 | 9.32 | 9.19 | 8.93 | 8.79 |
| M-Dur | 9.46 | 9.35 | 9.30 | 9.16 | 8.88 | 8.73 |
| E-Dur | 9.46 | 9.34 | 9.29 | 9.16 | 8.90 | 8.74 |
| 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 ヶ月間は組入銘柄は固定される。

累積投資収益指数の計算方法

ある時点における投資収益指数は以下の計算式から算出される。

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

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

各ポートフォリオの累積投資収益指数は以下の基準日を 100 としている。

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

ただし、

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

投資収益率の計算方法

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

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

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

レポートの表記等について

投資収益率 投資収益指数

- 「前月末からの投資収益率」は、「2024 年 8 月の月末営業日から 2024 年 9 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 9 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 9 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 8 月の月末営業日から 2024 年 9 月の月末営業日までの投資収益率(年率換算, %)
- 2024 年 8 月の月末営業日において、9 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 9 月ポートフォリオの、右ページには 10 月ポートフォリオの、2024 年 9 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 9 月末(暦上)における残存年数(至最終償還日)で区分。ただし 10 月ポートフォリオでは、2024 年 10 月末(暦上)における残存年数(至最終償還日)で区分。
- 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