

月間投資収益率 (2024年12月末)

累積投資 収益指数	前月末からの投資収益率			過去からの期間投資収益率	
	トータル	キャピタル	インカム	前年度末	前年末
総合	357.613	-1.24	-2.10	0.86	-3.21

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(%)

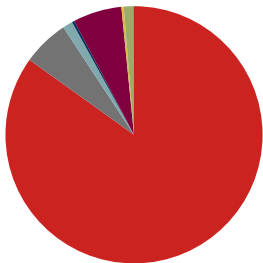
ポートフォリオ指標 (2024年12月末)

	翌月ポート (2025年1月)	当月ポート (2024年12月)	差
額面 [兆円]	1152.48	1143.27	9.20
デュレーション [年]	8.74	8.71	0.03
修正デュレーション	8.68	8.64	0.03
時価単価 [円]	95.33	95.32	0.01
利含単価 [円]	95.48	95.47	0.02
残存年数 [年]	10.30	10.26	0.04
利率 [%]	0.83	0.83	0.00
単利 [%]	1.14	1.14	0.00
複利 [%]	1.11	1.10	0.00
Tスプレッド [bp]	5	5	0

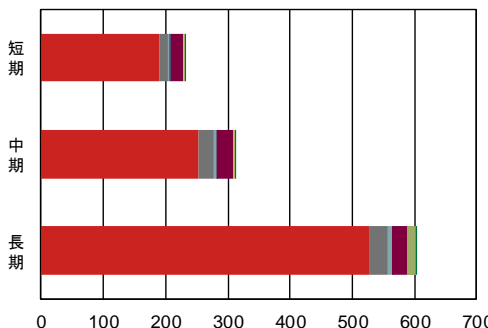
出所: NFRC

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

銘柄別額面構成 (2024年12月末)



残存別額面構成 (2024年12月末)



出所: NFRC

出所: NFRC

(兆円)

構成比	国債	地方債	政保債	金融債	事業債	円建外債	MBS	ABS
全体	84.9%	5.8%	1.3%	0.3%	6.1%	0.3%	1.2%	0.1%
短期	189.83	12.88	3.44	1.97	20.37	1.97	-	0.18
中期	252.46	24.73	4.16	1.25	26.75	1.19	-	0.31
長期	528.31	29.19	6.78	0.16	23.02	0.28	13.88	0.17

出所: NFRC

(兆円)

目次

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

銘柄別・投資収益率(2024年12月末)

	累積投資 収益指数	前月末からの投資収益率			過去からの投資収益率	
		トータル	キャピタル	インカム	前年度末	前年末
総合	357.613	-1.24	-2.10	0.86	-3.21	-2.91
国債	367.797	-1.29	-2.17	0.88	-3.40	-3.11
地方債	385.259	-1.56	-2.20	0.64	-2.14	-1.88
政保債	359.987	-0.96	-1.75	0.78	-2.80	-2.38
金融債	272.169	1.06	0.72	0.34	-0.61	-0.70
事業債	384.365	-0.22	-1.02	0.80	-1.96	-1.52
円建外債	356.246	-0.30	-1.36	1.06	0.36	0.61
MBS	122.702	-2.74	-3.42	0.68	-2.78	-2.49
ABS	112.908	-0.33	-1.11	0.77	-1.05	-1.05

出所:NFRC

投資収益率は年率換算(%)

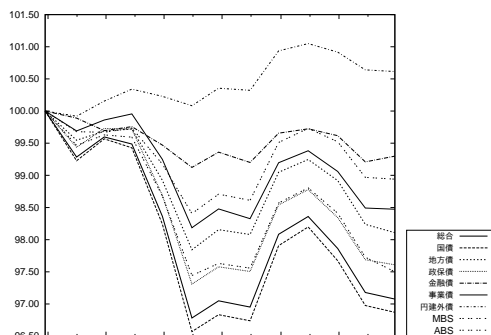
銘柄別・累積投資収益指数の推移

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
2023/12/29	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
2024/09/30	362.344	372.840	389.729	364.301	273.331	387.914	357.782	124.344	113.809
2024/10/31	360.511	370.841	388.443	362.695	273.039	386.656	357.312	123.849	113.571
2024/11/29	357.991	368.199	385.771	360.281	271.924	384.437	356.337	122.988	112.940
2024/12/02	357.403	367.578	385.185	359.712	271.740	383.964	355.995	122.781	112.803
2024/12/03	357.440	367.615	385.246	359.754	271.798	384.035	356.075	122.745	112.827
2024/12/04	358.019	368.223	385.838	360.285	272.019	384.537	356.380	122.937	112.977
2024/12/05	357.650	367.831	385.487	359.949	271.936	384.244	356.304	122.825	112.894
2024/12/06	358.103	368.320	385.849	360.369	272.020	384.578	356.521	122.955	112.977
2024/12/09	358.523	368.766	386.233	360.775	272.178	384.937	356.726	123.073	113.075
2024/12/10	358.103	368.318	385.837	360.360	272.068	384.623	356.592	122.933	112.984
2024/12/11	358.047	368.272	385.684	360.271	272.017	384.523	356.575	122.872	112.942
2024/12/12	358.508	368.765	386.081	360.719	272.147	384.895	356.491	123.011	113.037
2024/12/13	358.750	369.012	386.379	361.000	272.304	385.168	356.637	123.069	113.129
2024/12/16	357.979	368.177	385.768	360.301	272.153	384.615	356.452	122.852	112.999
2024/12/17	357.624	367.795	385.466	359.976	272.088	384.350	356.328	122.753	112.929
2024/12/18	358.092	368.301	385.825	360.374	272.190	384.719	356.496	122.877	113.011
2024/12/19	357.752	367.949	385.414	360.060	272.034	384.399	356.697	122.751	112.905
2024/12/20	358.515	368.750	386.186	360.800	272.330	385.081	356.781	123.000	113.105
2024/12/23	358.170	368.383	385.887	360.477	272.263	384.792	356.634	122.897	113.042
2024/12/24	358.255	368.487	385.833	360.555	272.248	384.822	356.390	122.893	113.025
2024/12/25	358.412	368.661	385.933	360.675	272.261	384.918	356.433	122.913	113.048
2024/12/26	357.909	368.138	385.347	360.173	272.094	384.466	356.172	122.739	112.907
2024/12/27	357.367	367.541	385.012	359.711	272.093	384.121	356.091	122.619	112.841
2024/12/30	357.613	367.797	385.259	359.987	272.169	384.365	356.246	122.702	112.908

出所:NFRC

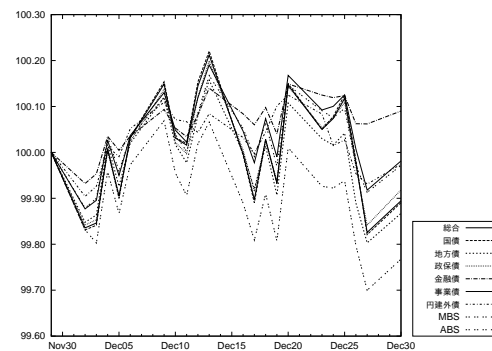
1983年12月末=100。MBSセクターは2003年3月末=100。ABSセクターは2008年3月末=100。

指数の推移(月次) 2023年12月末=100に補正。



出所:NFRC

指数の推移(日次) 2024年11月末=100に補正。



出所:NFRC

総合 残存別・投資収益率(2024年12月末)

	累積投資 収益指数	前月末からの投資収益率			過去からの投資収益率	
		トータル	キャピタル	インカム	前年度末	前年末
総合	357.613	-1.24	-2.10	0.86	-3.21	-2.91
短期 (1-3)	233.117	1.07	0.66	0.41	-0.46	-0.53
中期 (3-7)	333.614	-0.61	-1.28	0.67	-1.48	-1.53
長期 (7-)	521.517	-2.56	-3.71	1.15	-5.25	-4.60
長期 (7-11)	191.162	-3.81	-4.84	1.03	-2.25	-2.04
超長期 (11-)	229.388	-1.79	-3.02	1.23	-7.01	-6.10
(11-15)	220.738	-3.42	-4.40	0.98	-3.84	-3.18
(15-)	234.437	-1.22	-2.54	1.31	-8.15	-7.14

出所:NFRC

投資収益率は年率換算(%)

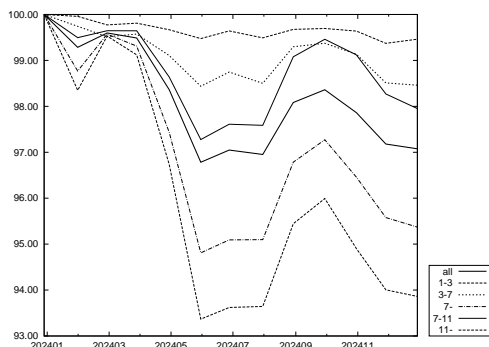
総合 残存別・投資収益指数の推移

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-)*
2023/12/29	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
2024/09/30	362.344	233.664	336.709	531.914	194.109	234.596	224.573	240.212
2024/10/31	360.511	233.530	335.904	527.468	193.444	231.933	223.423	236.950
2024/11/29	357.991	232.905	333.788	522.652	191.783	229.738	221.381	234.681
2024/12/02	357.403	232.806	333.413	521.377	191.379	229.131	220.707	234.094
2024/12/03	357.440	232.853	333.494	521.372	191.402	229.111	220.716	234.062
2024/12/04	358.019	232.972	333.953	522.525	191.797	229.639	221.200	234.611
2024/12/05	357.650	232.948	333.698	521.708	191.569	229.227	220.853	234.172
2024/12/06	358.103	232.993	333.868	522.824	191.792	229.853	221.330	234.858
2024/12/09	358.523	233.076	334.109	523.746	192.034	230.329	221.703	235.376
2024/12/10	358.103	233.012	333.912	522.767	191.738	229.852	221.222	234.897
2024/12/11	358.047	232.992	333.764	522.756	191.623	229.928	221.147	235.029
2024/12/12	358.508	233.056	333.991	523.825	191.885	230.492	221.618	235.632
2024/12/13	358.750	233.147	334.288	524.177	192.045	230.625	221.866	235.723
2024/12/16	357.979	233.071	333.948	522.324	191.676	229.584	221.175	234.545
2024/12/17	357.624	233.047	333.763	521.483	191.468	229.141	220.846	234.057
2024/12/18	358.092	233.103	333.971	522.599	191.724	229.744	221.212	234.751
2024/12/19	357.752	233.027	333.639	521.982	191.417	229.531	220.858	234.589
2024/12/20	358.515	233.184	334.221	523.522	191.900	230.268	221.532	235.356
2024/12/23	358.170	233.161	334.038	522.712	191.721	229.825	221.204	234.867
2024/12/24	358.255	233.164	333.969	523.014	191.589	230.135	221.279	235.265
2024/12/25	358.412	233.167	334.029	523.410	191.640	230.378	221.435	235.542
2024/12/26	357.909	233.113	333.659	522.334	191.190	229.946	220.944	235.128
2024/12/27	357.367	233.095	333.474	520.952	191.043	229.075	220.450	234.112
2024/12/30	357.613	233.117	333.614	521.517	191.162	229.388	220.738	234.437

出所:NFRC

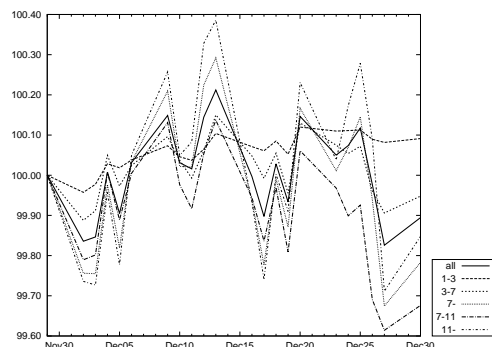
* は 1995 年 12 月末=100。それ以外は、1983 年 12 月末=100。

指数の推移(月次) 2023年12月末=100に補正。



出所:NFRC

指数の推移(日次) 2024年11月末=100に補正。



出所:NFRC

国債 残存別・投資収益率(2024年12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	367.797	-1.29	-2.17	0.88	-3.40	-3.11
短期(1-3)	220.414	1.01	0.60	0.41	-0.51	-0.58
中期(3-7)	332.423	-0.72	-1.39	0.68	-1.54	-1.61
長期(7-)	531.474	-2.48	-3.66	1.18	-5.44	-4.82
長期(7-11)	189.686	-3.85	-4.89	1.03	-2.29	-2.12
超長期(11-)	228.178	-1.66	-2.92	1.26	-7.29	-6.39
(11-15)	219.278	-3.46	-4.45	0.99	-3.90	-3.28
(15-)	233.391	-1.03	-2.39	1.36	-8.50	-7.50

出所:NFRC

投資収益率は年率換算(%)

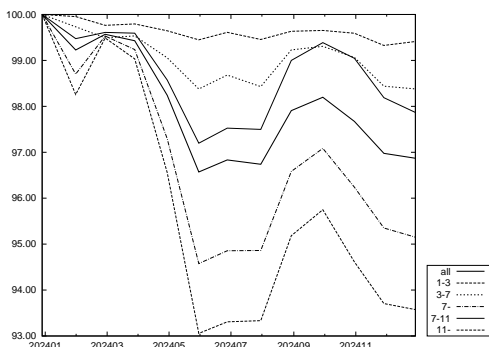
国債 残存別・投資収益指数の推移

国債 年/月/日	全体	短期 (1-3)	中期 (3-7)	長期 (7-)	長期*	超長期*		
					(7-11)	(11-)	(11-15)*	(15-)*
2023/12/29	379.681	221.718	337.902	558.559	193.819	243.845	226.756	252.421
2024/01/31	376.748	221.618	336.994	551.309	192.800	239.595	224.741	247.251
2024/02/29	378.041	221.194	336.185	555.938	193.064	242.595	226.168	250.893
2024/03/29	377.512	221.262	336.327	554.290	193.031	241.486	225.933	249.426
2024/04/30	373.000	220.931	334.713	543.451	191.054	235.449	222.150	242.446
2024/05/31	366.662	220.496	332.417	528.266	188.388	226.914	216.973	232.523
2024/06/28	367.658	220.855	333.447	529.824	189.023	227.526	217.488	233.177
2024/07/31	367.297	220.511	332.596	529.860	188.969	227.590	217.871	233.119
2024/08/30	371.736	220.909	335.296	539.477	191.879	232.100	221.835	237.873
2024/09/30	372.840	220.946	335.557	542.274	192.631	233.479	223.103	239.305
2024/10/31	370.841	220.814	334.742	537.559	191.969	230.711	221.962	235.892
2024/11/29	368.199	220.225	332.626	532.596	190.309	228.499	219.924	233.596
2024/12/02	367.578	220.131	332.249	531.283	189.906	227.887	219.248	233.002
2024/12/03	367.615	220.175	332.329	531.277	189.928	227.867	219.256	232.972
2024/12/04	368.223	220.288	332.789	532.467	190.320	228.402	219.740	233.530
2024/12/05	367.831	220.265	332.532	531.618	190.094	227.982	219.393	233.080
2024/12/06	368.320	220.307	332.701	532.790	190.316	228.627	219.870	233.792
2024/12/09	368.766	220.383	332.940	533.750	190.557	229.113	220.240	234.324
2024/12/10	368.318	220.323	332.740	532.735	190.260	228.630	219.760	233.836
2024/12/11	368.272	220.304	332.593	532.750	190.146	228.722	219.688	233.990
2024/12/12	368.765	220.365	332.821	533.864	190.408	229.299	220.159	234.610
2024/12/13	369.012	220.450	333.117	534.219	190.566	229.428	220.405	234.698
2024/12/16	368.177	220.378	332.773	532.269	190.198	228.354	219.713	233.474
2024/12/17	367.795	220.355	332.586	531.389	189.992	227.898	219.384	232.968
2024/12/18	368.301	220.405	332.793	532.567	190.247	228.523	219.753	233.692
2024/12/19	367.949	220.332	332.456	531.944	189.941	228.317	219.399	233.538
2024/12/20	368.750	220.480	333.039	533.533	190.420	229.062	220.069	234.318
2024/12/23	368.383	220.458	332.854	532.693	190.243	228.613	219.741	233.820
2024/12/24	368.487	220.461	332.784	533.036	190.111	228.944	219.819	234.247
2024/12/25	368.661	220.465	332.846	533.462	190.163	229.200	219.976	234.540
2024/12/26	368.138	220.416	332.479	532.370	189.717	228.771	219.493	234.129
2024/12/27	367.541	220.398	332.291	530.892	189.570	227.862	218.994	233.061
2024/12/30	367.797	220.414	332.423	531.474	189.686	228.178	219.278	233.391

出所:NFRC

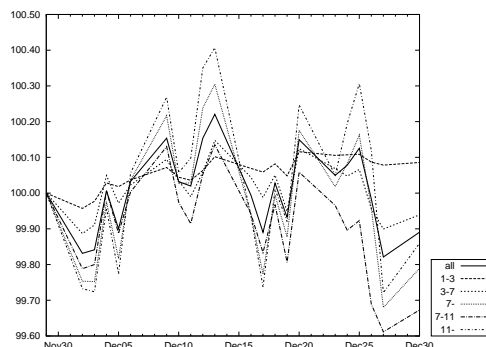
* は1995年12月末=100。それ以外は、1983年12月末=100。

指数の推移(月次) 2023年12月末=100に補正。



出所:NFRC

指数の推移(日次) 2024年11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12月末)

	累積投資 収益指数	前月末からの投資収益率			過去からの投資収益率	
		トータル	キャピタル	インカム	前年度末	前年末
除くMBS	357.499	-1.22	-2.08	0.86	-3.21	-2.91
短期(1-3)	233.117	1.07	0.66	0.41	-0.46	-0.53
中期(3-7)	333.614	-0.61	-1.28	0.67	-1.48	-1.53
長期(7-)	523.307	-2.55	-3.71	1.16	-5.31	-4.66
長期(7-11)	191.156	-3.82	-4.85	1.03	-2.25	-2.04
超長期(11-)	231.016	-1.75	-3.00	1.25	-7.18	-6.24
(11-15)	220.727	-3.42	-4.40	0.98	-3.84	-3.18
(15-)	236.264	-1.14	-2.49	1.35	-8.43	-7.39

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(%)

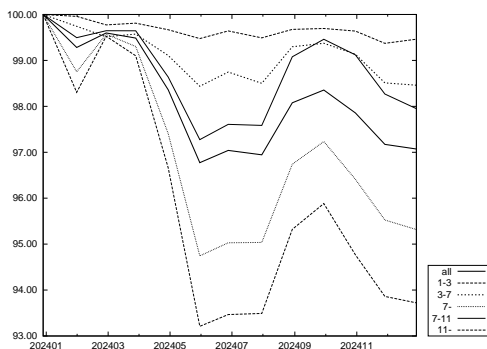
「除くMBS」残存別・投資収益指数の推移

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-)*
2023/12/29	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
2024/09/30	362.228	233.664	336.709	533.823	194.105	236.343	224.562	242.227
2024/10/31	360.391	233.530	335.904	529.304	193.440	233.593	223.412	238.813
2024/11/29	357.871	232.905	333.788	524.444	191.777	231.360	221.370	236.493
2024/12/02	357.283	232.806	333.413	523.155	191.374	230.741	220.696	235.891
2024/12/03	357.323	232.853	333.494	523.153	191.397	230.722	220.705	235.861
2024/12/04	357.901	232.972	333.953	524.319	191.791	231.260	221.190	236.424
2024/12/05	357.532	232.948	333.698	523.491	191.564	230.837	220.842	235.969
2024/12/06	357.986	232.993	333.868	524.624	191.787	231.483	221.319	236.684
2024/12/09	358.407	233.076	334.109	525.560	192.029	231.972	221.692	237.222
2024/12/10	357.986	233.012	333.912	524.568	191.733	231.484	221.211	236.728
2024/12/11	357.932	232.992	333.764	524.563	191.617	231.568	221.136	236.875
2024/12/12	358.393	233.056	333.991	525.647	191.880	232.148	221.607	237.500
2024/12/13	358.636	233.147	334.288	526.004	192.040	232.283	221.855	237.591
2024/12/16	357.864	233.071	333.948	524.121	191.670	231.209	221.165	236.363
2024/12/17	357.508	233.047	333.763	523.267	191.463	230.753	220.835	235.855
2024/12/18	357.978	233.103	333.971	524.401	191.719	231.374	221.201	236.579
2024/12/19	357.638	233.027	333.639	523.780	191.411	231.162	220.847	236.420
2024/12/20	358.401	233.184	334.221	525.337	191.894	231.914	221.521	237.208
2024/12/23	358.056	233.161	334.038	524.515	191.716	231.458	221.193	236.700
2024/12/24	358.142	233.164	333.969	524.826	191.583	231.783	221.268	237.123
2024/12/25	358.300	233.167	334.029	525.231	191.634	232.036	221.424	237.415
2024/12/26	357.797	233.113	333.659	524.143	191.184	231.596	220.933	236.993
2024/12/27	357.253	233.095	333.474	522.735	191.037	230.694	220.439	235.927
2024/12/30	357.499	233.117	333.614	523.307	191.156	231.016	220.727	236.264

出所:NFRC

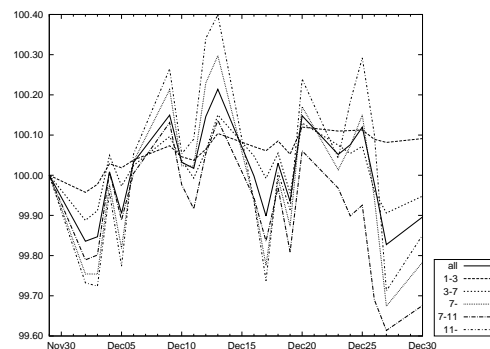
* は 1995年12月末=100。それ以外は、1983年12月末=100。

指数の推移(月次) 2023年12月末=100に補正。



出所:NFRC

指数の推移(日次) 2024年11月末=100に補正。



出所:NFRC

「除く ABS」「SDGs」残存別・投資収益率 (2024 年 12 月末)

	累積投資 収益指数	前月末からの投資収益率			過去からの投資収益率	
		トータル	キャピタル	インカム	前年度末	前年末
除く ABS	357.637	-1.24	-2.10	0.86	-3.21	-2.91
短期 (1-3)	233.082	1.07	0.66	0.41	-0.46	-0.54
中期 (3-7)	333.605	-0.61	-1.28	0.67	-1.48	-1.53
長期 (7-)	521.515	-2.56	-3.71	1.15	-5.25	-4.61
長期 (7-11)	191.155	-3.81	-4.84	1.03	-2.25	-2.04
超長期 (11-)	229.386	-1.79	-3.02	1.23	-7.02	-6.10
(11-15)	220.729	-3.42	-4.40	0.98	-3.84	-3.18
(15-)	234.439	-1.22	-2.54	1.31	-8.15	-7.14
SDGs	98.015	-1.27	-1.91	0.64	-2.17	-1.83

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 (%)

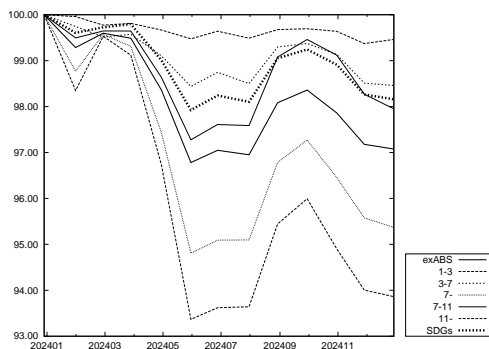
「除く ABS」「SDGs」残存別 投資収益指数の推移

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-)*	
2023/12/29	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
2024/09/30	362.369	233.628	336.701	531.912	194.103	234.593	224.564	240.214	99.099
2024/10/31	360.536	233.494	335.896	527.465	193.438	231.930	223.414	236.952	98.768
2024/11/29	358.015	232.870	333.779	522.649	191.776	229.735	221.373	234.682	98.121
2024/12/02	357.426	232.770	333.404	521.375	191.373	229.129	220.698	234.096	97.984
2024/12/03	357.464	232.817	333.485	521.369	191.396	229.108	220.707	234.064	97.997
2024/12/04	358.042	232.936	333.944	522.523	191.790	229.636	221.192	234.613	98.138
2024/12/05	357.674	232.913	333.689	521.705	191.563	229.224	220.844	234.173	98.058
2024/12/06	358.127	232.958	333.860	522.821	191.786	229.850	221.321	234.860	98.138
2024/12/09	358.547	233.040	334.100	523.743	192.027	230.326	221.694	235.377	98.232
2024/12/10	358.127	232.977	333.903	522.764	191.732	229.849	221.213	234.898	98.138
2024/12/11	358.071	232.956	333.755	522.753	191.616	229.926	221.138	235.031	98.110
2024/12/12	358.532	233.020	333.982	523.822	191.879	230.490	221.610	235.633	98.204
2024/12/13	358.774	233.112	334.280	524.175	192.039	230.622	221.858	235.725	98.279
2024/12/16	358.003	233.036	333.939	522.321	191.670	229.581	221.167	234.546	98.133
2024/12/17	357.648	233.012	333.754	521.480	191.462	229.139	220.837	234.058	98.064
2024/12/18	358.116	233.068	333.962	522.596	191.718	229.741	221.203	234.753	98.156
2024/12/19	357.776	232.992	333.630	521.979	191.410	229.529	220.849	234.591	98.064
2024/12/20	358.539	233.149	334.212	523.520	191.893	230.266	221.523	235.357	98.247
2024/12/23	358.194	233.125	334.029	522.709	191.715	229.823	221.195	234.868	98.174
2024/12/24	358.279	233.129	333.960	523.011	191.583	230.132	221.270	235.267	98.165
2024/12/25	358.436	233.132	334.020	523.408	191.633	230.375	221.426	235.544	98.184
2024/12/26	357.933	233.078	333.650	522.332	191.183	229.943	220.936	235.129	98.049
2024/12/27	357.391	233.060	333.465	520.949	191.036	229.073	220.441	234.114	97.969
2024/12/30	357.637	233.082	333.605	521.515	191.155	229.386	220.729	234.439	98.015

出所:NFRC

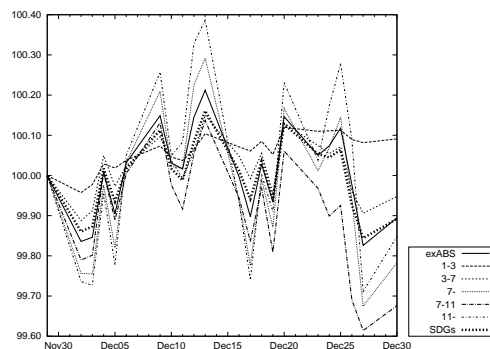
* は 1995 年 12 月末=100。 ** は 2017 年 12 月末=100。それ以外は、1983 年 12 月末=100。

指数の推移 (月次) 2023 年 12 月末=100 に補正。



出所:NFRC

指数の推移 (日次) 2024 年 11 月末=100 に補正。



出所:NFRC

「除く国債」残存別・投資収益率(2024年12月末)

	累積投資 収益指数	前月末からの投資収益率			過去からの投資収益率	
		トータル	キャピタル	インカム	前年度末	前年末
除く国債	168.607	-0.98	-1.70	0.72	-2.09	-1.75
短期(1-3)	133.105	1.37	0.93	0.44	-0.25	-0.30
中期(3-7)	165.371	-0.15	-0.78	0.62	-1.23	-1.17
長期(7-)	228.279	-3.08	-4.06	0.98	-3.85	-3.06
長期(7-11)	196.816	-3.53	-4.53	1.00	-1.95	-1.48
超長期(11-)	230.636	-2.79	-3.76	0.97	-5.03	-4.04

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(%)

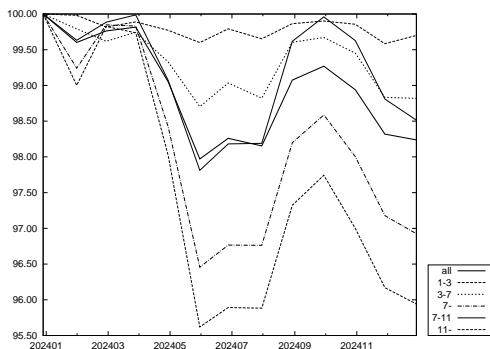
「除く国債」残存別・投資収益指数の推移

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-)
2023/12/29	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
2024/09/30	170.378	133.374	166.796	232.197	199.705	234.967
2024/10/31	169.810	133.313	166.426	230.816	199.038	233.173
2024/11/29	168.747	132.950	165.393	228.878	197.407	231.185
2024/12/02	168.512	132.894	165.215	228.365	197.008	230.635
2024/12/03	168.535	132.922	165.256	228.363	197.036	230.610
2024/12/04	168.773	132.990	165.477	228.823	197.438	231.070
2024/12/05	168.633	132.977	165.357	228.515	197.209	230.732
2024/12/06	168.788	133.006	165.444	228.897	197.435	231.196
2024/12/09	168.951	133.057	165.566	229.239	197.676	231.582
2024/12/10	168.793	133.021	165.474	228.861	197.392	231.169
2024/12/11	168.738	133.009	165.401	228.778	197.269	231.124
2024/12/12	168.905	133.046	165.509	229.167	197.529	231.574
2024/12/13	169.026	133.100	165.657	229.338	197.701	231.727
2024/12/16	168.768	133.058	165.499	228.713	197.331	230.969
2024/12/17	168.644	133.044	165.413	228.417	197.120	230.636
2024/12/18	168.803	133.084	165.516	228.781	197.374	231.050
2024/12/19	168.650	133.045	165.365	228.491	197.065	230.800
2024/12/20	168.964	133.135	165.648	229.107	197.558	231.452
2024/12/23	168.835	133.122	165.562	228.795	197.380	231.068
2024/12/24	168.831	133.123	165.530	228.818	197.247	231.207
2024/12/25	168.873	133.124	165.555	228.926	197.292	231.352
2024/12/26	168.649	133.086	165.369	228.441	196.820	230.903
2024/12/27	168.499	133.080	165.286	228.047	196.681	230.353
2024/12/30	168.607	133.105	165.371	228.279	196.816	230.636

出所:NFRC

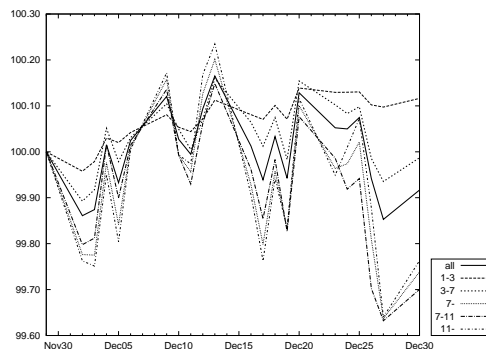
*は1995年12月末=100。それ以外は、1993年12月末=100。

指数の推移(月次) 2023年12月末=100に補正。



出所:NFRC

指数の推移(日次) 2024年11月末=100に補正。



出所:NFRC

銘柄 残存別・月間投資収益率 (2024 年 12 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	-1.24	1.07	-0.61	-2.56	-3.81	-1.79
国債	-1.29	1.01	-0.72	-2.48	-3.85	-1.66
30 年国債	-1.63	-	-1.62	-1.63	-3.57	-1.42
20 年国債	-2.84	1.03	-1.10	-4.04	-3.74	-4.23
10 年国債	-1.44	1.01	-0.92	-4.00	-4.00	-
5 年国債	0.72	1.01	0.37	-	-	-
中期国債	0.98	0.98	-	-	-	-
地方債	-1.56	1.13	-0.59	-3.68	-3.67	-3.69
東京都債	-1.23	1.11	-0.76	-3.30	-3.69	-2.75
五大都市債	-1.41	1.11	-0.38	-3.39	-3.49	-3.34
その他地方債	-1.60	1.13	-0.57	-3.82	-3.71	-3.96
政保債	-0.96	1.09	-0.25	-2.58	-3.59	-2.05
公営企業債券	0.89	1.12	0.59	-	-	-
その他政保債	-1.18	1.08	-0.41	-2.58	-3.59	-2.05
金融債	1.06	1.77	0.50	-3.52	-3.52	-
特定金融債	-	-	-	-	-	-
事業債	-0.22	1.58	0.30	-2.65	-3.38	-2.03
円建外債	-0.30	0.84	-1.61	-2.83	-3.23	-2.28
MBS	-2.74	-	-	-2.74	1.00	-2.79
ABS	-0.33	1.62	-0.26	-2.76	-3.07	-2.31

出所:NFRC

「除く(銘柄)」残存別・月間投資収益率 (2024 年 12 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	-0.98	1.37	-0.15	-3.08	-3.53	-2.79
除く 30 年国債	-1.17	1.07	-0.60	-2.95	-3.83	-2.08
除く 20 年国債	-0.66	1.08	-0.47	-1.76	-3.85	-0.53
除く 10 年国債	-1.17	1.10	-0.40	-2.27	-3.67	-1.79
除く 5 年国債	-1.47	1.10	-0.81	-2.56	-3.81	-1.79
除く中期国債	-1.31	1.09	-0.61	-2.56	-3.81	-1.79
除く地方債	-1.22	1.07	-0.62	-2.50	-3.82	-1.72
除く東京都債	-1.24	1.07	-0.61	-2.55	-3.81	-1.79
除く五大都市債	-1.24	1.07	-0.61	-2.55	-3.81	-1.78
除くその他地方債	-1.23	1.07	-0.62	-2.51	-3.82	-1.74
除く政保債	-1.25	1.07	-0.62	-2.56	-3.81	-1.79
除く公営企業債券	-1.24	1.07	-0.62	-2.56	-3.81	-1.79
除くその他政保債	-1.24	1.07	-0.62	-2.56	-3.81	-1.79
除く金融債	-1.25	1.07	-0.62	-2.55	-3.81	-1.79
除く特定金融債	-1.24	1.07	-0.61	-2.56	-3.81	-1.79
除く事業債	-1.31	1.02	-0.70	-2.55	-3.83	-1.78
除く円建外債	-1.24	1.08	-0.61	-2.56	-3.81	-1.79
除く MBS	-1.22	1.07	-0.61	-2.55	-3.82	-1.75
除く ABS	-1.24	1.07	-0.61	-2.56	-3.81	-1.79
除く MBS・ABS	-1.22	1.07	-0.61	-2.55	-3.82	-1.75

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12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	-0.22	1.58	0.30	-2.65	-3.38	-2.03
水産・農林業	-	-	-	-	-	-
鉱業	-1.34	1.56	-2.86	-	-	-
建設業	0.35	1.36	0.37	-3.38	-3.49	-3.24
食料品	0.71	1.45	0.80	-0.60	-2.47	2.79
繊維製品	0.37	1.27	0.72	-2.87	-3.21	-2.56
パルプ・紙	-0.22	1.16	-0.71	-3.31	-3.06	-3.40
化学	-0.19	1.38	-0.02	-3.22	-3.69	-2.77
医薬品	-1.04	1.24	-1.42	-2.64	-3.33	-2.45
石油・石炭製品	-1.73	1.33	-1.16	-3.52	-3.40	-4.00
ゴム製品	0.62	1.36	0.50	-3.52	-3.52	-
ガラス・土石製品	-0.35	1.32	0.56	-2.92	-2.85	-3.11
鉄鋼	0.61	1.29	0.92	-2.97	-3.11	-2.25
非鉄金属	0.18	1.40	-0.01	-3.29	-3.29	-
金属製品	0.65	1.37	0.57	-3.55	-3.55	-
機械	-0.26	1.33	0.18	-3.84	-3.84	-
電気機器	0.16	1.31	0.36	-4.19	-4.19	-
輸送用機器	0.87	2.39	0.79	-3.20	-3.29	-3.08
精密機器	-6.37	-1.03	-9.54	-3.23	-3.23	-
その他製品	-0.52	1.34	0.20	-3.43	-	-3.43
電気・ガス業	-0.90	1.36	-0.16	-2.76	-3.21	-2.31
陸運業	-1.00	1.33	-0.41	-1.89	-3.42	-1.17
海運業	0.52	1.28	1.08	-2.27	-2.27	-
空運業	-2.07	1.51	0.83	-4.63	-5.54	-3.73
倉庫・運輸関連業	-0.65	1.51	0.32	-3.72	-4.52	-2.96
情報・通信業	0.97	1.98	1.47	-3.53	-3.01	-4.78
卸売業	-0.64	1.37	0.56	-3.22	-3.29	-3.06
小売業	1.09	1.95	1.36	-1.75	-2.48	0.48
銀行業	1.69	2.00	1.67	-2.20	-2.20	-
証券、商品先物取引業	2.62	2.71	2.41	0.46	0.46	-
保険業	0.56	1.30	1.21	-3.57	-3.57	-
その他金融業	0.95	2.25	0.83	-4.06	-4.86	2.82
不動産業	-0.58	1.37	0.20	-2.78	-3.66	-1.62
サービス業	5.49	4.49	4.96	8.48	4.63	21.73
財投機関債	-0.73	1.17	0.01	-2.82	-3.54	-2.46

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12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	-0.22	1.51	0.22	-2.66	-3.38	-2.03
AAA～AA 格	-0.50	1.26	-0.05	-2.69	-3.63	-1.96
AAA 格	-0.09	1.19	-0.15	-3.19	-4.37	-0.92
AA 格	-0.61	1.28	-0.01	-2.62	-3.49	-2.04
A 格	0.45	2.09	0.80	-2.55	-2.73	-2.33
事業債 全体	-0.22	1.58	0.30	-2.65	-3.38	-2.03
AAA～AA 格	-0.48	1.32	0.03	-2.66	-3.59	-1.96
AAA 格	-0.09	1.19	-0.15	-3.19	-4.37	-0.92
AA 格	-0.60	1.38	0.09	-2.60	-3.44	-2.04
A 格	0.46	2.21	0.92	-2.61	-2.83	-2.33
円建外債 全体	-0.30	0.84	-1.61	-2.83	-3.23	-2.28
AAA～AA 格	-0.99	0.28	-2.21	-7.42	-7.71	-2.65
AAA 格	-	-	-	-	-	-
AA 格	-0.99	0.28	-2.21	-7.42	-7.71	-2.65
A 格	0.35	1.37	-0.92	-1.25	-0.05	-2.26

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 12 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	-0.48	1.32	0.03	-2.66	-3.59	-1.96
AAA~A 格	-0.22	1.58	0.30	-2.65	-3.38	-2.03
AAA~BBB 格	-0.22	1.58	0.30	-2.65	-3.38	-2.03
AAA~BB 格	-0.22	1.58	0.30	-2.65	-3.38	-2.03
AAA 格	-0.09	1.19	-0.15	-3.19	-4.37	-0.92
AA 格	-0.60	1.38	0.09	-2.60	-3.44	-2.04
A 格	0.46	2.21	0.92	-2.61	-2.83	-2.33
BBB 格	-	-	-	-	-	-
BB 格	-	-	-	-	-	-
B 格以下	-	-	-	-	-	-
格付なし	-	-	-	-	-	-
円建外債						
AAA~AA 格	-0.99	0.28	-2.21	-7.42	-7.71	-2.65
AAA~A 格	-0.30	0.84	-1.61	-2.83	-3.23	-2.28
AAA~BBB 格	-0.30	0.84	-1.61	-2.83	-3.23	-2.28
AAA~BB 格	-0.30	0.84	-1.61	-2.83	-3.23	-2.28
AAA 格	-	-	-	-	-	-
AA 格	-0.99	0.28	-2.21	-7.42	-7.71	-2.65
A 格	0.35	1.37	-0.92	-1.25	-0.05	-2.26
BBB 格	-	-	-	-	-	-
BB 格	-	-	-	-	-	-
B 格以下	-	-	-	-	-	-
格付なし	-	-	-	-	-	-

出所:NFRFC

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

事業債 円建外債 最低格付別・月間投資収益率(2024 年 12 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	0.02	1.41	0.49	-2.62	-3.39	-1.87
AAA~A 格	-0.23	1.58	0.26	-2.65	-3.38	-2.02
AAA~BBB 格	-0.22	1.58	0.29	-2.65	-3.38	-2.03
AAA~BB 格	-0.22	1.58	0.30	-2.65	-3.38	-2.03
AAA 格	-	-	-	-	-	-
AA 格	0.02	1.41	0.49	-2.62	-3.39	-1.87
A 格	-0.29	1.62	0.20	-2.66	-3.38	-2.05
BBB 格	0.06	1.57	1.26	-2.74	-3.38	-2.10
BB 格	1.02	-	1.41	-2.63	-	-2.63
B 格以下	-	-	-	-	-	-
格付なし	-	-	-	-	-	-
円建外債						
AAA~AA 格	0.94	1.24	0.73	-3.53	-3.53	-
AAA~A 格	-0.87	0.48	-2.41	-5.72	-8.15	-2.35
AAA~BBB 格	-0.30	0.84	-1.61	-2.83	-3.23	-2.28
AAA~BB 格	-0.30	0.84	-1.61	-2.83	-3.23	-2.28
AAA 格	-	-	-	-	-	-
AA 格	0.94	1.24	0.73	-3.53	-3.53	-
A 格	-1.34	0.26	-3.19	-5.94	-9.01	-2.35
BBB 格	0.82	1.69	-0.22	0.36	2.19	-2.20
BB 格	-	-	-	-	-	-
B 格以下	-	-	-	-	-	-
格付なし	-	-	-	-	-	-

出所:NFRFC

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

事業債 円建外債 R&I 格付別・月間投資収益率(2024年12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	-0.51	1.27	0.09	-2.62	-3.67	-1.86
AAA~A 格	-0.33	1.51	0.21	-2.72	-3.50	-2.07
AAA~BBB 格	-0.31	1.52	0.25	-2.72	-3.50	-2.07
AAA~BB 格	-0.31	1.52	0.25	-2.72	-3.50	-2.07
AAA 格	0.42	1.28	0.27	-3.36	-3.44	-3.15
AA 格	-0.53	1.27	0.09	-2.61	-3.67	-1.85
A 格	-0.01	1.93	0.39	-2.97	-3.18	-2.71
BBB 格	6.70	2.76	8.83	-	-	-
BB 格	-	-	-	-	-	-
B 格以下	-	-	-	-	-	-
格付なし	0.82	2.20	0.76	-1.43	-1.71	-1.03
円建外債						
AAA~AA 格	1.95	1.82	3.16	-1.04	-0.44	-2.65
AAA~A 格	-0.21	0.99	-1.27	-7.16	-7.77	-2.65
AAA~BBB 格	-0.21	0.99	-1.27	-7.16	-7.77	-2.65
AAA~BB 格	-0.21	0.99	-1.27	-7.16	-7.77	-2.65
AAA 格	-	-	-	-	-	-
AA 格	1.95	1.82	3.16	-1.04	-0.44	-2.65
A 格	-1.00	0.57	-2.09	-11.73	-11.73	-
BBB 格	-	-	-	-	-	-
BB 格	-	-	-	-	-	-
B 格以下	-	-	-	-	-	-
格付なし	-0.33	0.79	-1.75	-2.22	-2.19	-2.26

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12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	-0.19	1.36	0.06	-3.08	-3.70	-2.24
AAA~A 格	-0.03	1.48	0.36	-2.88	-3.33	-2.29
AAA~BBB 格	-0.03	1.48	0.36	-2.88	-3.33	-2.29
AAA~BB 格	-0.03	1.48	0.36	-2.88	-3.33	-2.29
AAA 格	-0.10	1.19	-0.16	-3.19	-4.37	-0.92
AA 格	-0.25	1.49	0.21	-3.04	-3.40	-2.60
A 格	0.39	1.84	1.09	-2.44	-2.49	-2.39
BBB 格	-	-	-	-	-	-
BB 格	-	-	-	-	-	-
B 格以下	-	-	-	-	-	-
格付なし	-0.52	1.78	0.18	-2.45	-3.46	-1.87
円建外債						
AAA~AA 格	1.76	1.80	2.39	-0.92	-0.52	-2.65
AAA~A 格	1.40	1.79	1.51	-0.19	2.87	-2.28
AAA~BBB 格	1.40	1.79	1.51	-0.19	2.87	-2.28
AAA~BB 格	1.40	1.79	1.51	-0.19	2.87	-2.28
AAA 格	-	-	-	-	-	-
AA 格	1.76	1.80	2.39	-0.92	-0.52	-2.65
A 格	1.27	1.78	1.16	-0.10	3.82	-2.26
BBB 格	-	-	-	-	-	-
BB 格	-	-	-	-	-	-
B 格以下	-	-	-	-	-	-
格付なし	-1.22	0.28	-2.54	-9.10	-9.10	-

出所:NFRFC

- 月間投資収益率とは、前月末~今月末までの投資収益率を年率換算(%)
- 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12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	-0.63	1.25	0.07	-2.76	-3.52	-2.26
AAA~BBB格	-0.62	1.25	0.11	-2.76	-3.51	-2.25
AAA~BB格	-0.62	1.25	0.11	-2.76	-3.51	-2.25
AAA格	-	-	-	-	-	-
AA格	-	-	-	-	-	-
A格	-0.63	1.25	0.07	-2.76	-3.52	-2.26
BBB格	-0.45	1.30	0.42	-2.73	-3.38	-2.14
BB格	-	-	-	-	-	-
B格以下	-	-	-	-	-	-
格付なし	0.02	1.75	0.39	-2.57	-3.31	-1.81
円建外債						
AAA~AA格	-1.52	-0.08	-2.74	-9.06	-9.06	-
AAA~A格	-0.88	0.45	-2.26	-5.60	-7.58	-2.35
AAA~BBB格	-0.34	0.80	-1.63	-2.83	-3.23	-2.28
AAA~BB格	-0.34	0.80	-1.63	-2.83	-3.23	-2.28
AAA格	-	-	-	-	-	-
AA格	-1.52	-0.08	-2.74	-9.06	-9.06	-
A格	0.11	1.13	-0.94	-3.73	-5.66	-2.35
BBB格	0.91	1.78	-0.30	1.00	3.86	-2.20
BB格	-	-	-	-	-	-
B格以下	-	-	-	-	-	-
格付なし	1.01	1.72	-0.82	-	-	-

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12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	-1.43	1.15	-1.15	-1.68	-3.57	-0.67
AAA~A格	-0.84	1.22	-0.49	-2.49	-3.93	-1.20
AAA~BBB格	-0.82	1.22	-0.47	-2.50	-3.92	-1.20
AAA~BB格	-0.79	1.22	-0.40	-2.50	-3.92	-1.21
AAA格	-	-	-	-	-	-
AA格	-1.43	1.15	-1.15	-1.68	-3.57	-0.67
A格	-0.81	1.22	-0.48	-2.58	-3.95	-1.26
BBB格	0.36	1.28	0.71	-3.06	-3.42	-2.25
BB格	1.02	-	1.41	-2.63	-	-2.63
B格以下	-	-	-	-	-	-
格付なし	-0.05	1.66	0.50	-2.72	-3.15	-2.35
円建外債						
AAA~AA格	0.99	1.31	0.72	-3.53	-3.53	-
AAA~A格	-0.94	0.42	-2.44	-5.79	-8.34	-2.35
AAA~BBB格	-0.34	0.80	-1.62	-2.85	-3.26	-2.28
AAA~BB格	-0.34	0.80	-1.62	-2.85	-3.26	-2.28
AAA格	-	-	-	-	-	-
AA格	0.99	1.31	0.72	-3.53	-3.53	-
A格	-1.46	0.15	-3.23	-6.02	-9.26	-2.35
BBB格	0.90	1.75	-0.08	0.36	2.19	-2.20
BB格	-	-	-	-	-	-
B格以下	-	-	-	-	-	-
格付なし	1.92	2.16	0.72	-0.61	-0.61	-

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12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	1,143,272	95.32	95.47	10.26	0.83	1.14	1.10	8.71	8.64	8.66	5
短期 (1-3)	230,642	99.65	99.72	1.99	0.41	0.60	0.60	1.98	1.97	1.98	5
中期 (3-7)	310,843	99.57	99.69	4.86	0.67	0.77	0.76	4.78	4.76	4.77	5
長期 (7-)	601,787	91.46	91.66	16.22	1.07	1.57	1.51	13.72	13.60	13.63	4
長期 (7-11)	207,024	100.39	100.56	8.75	1.05	1.01	1.02	8.36	8.32	8.35	3
超長期 (11-)	394,763	86.78	86.99	20.13	1.08	1.91	1.80	16.97	16.81	16.83	4
(11-15)	93,851	94.18	94.38	12.96	0.93	1.45	1.41	12.15	12.07	12.14	4
(15-)	300,913	84.47	84.69	22.37	1.12	2.07	1.94	18.64	18.46	18.47	4
国債	970,600	95.23	95.38	10.77	0.85	1.14	1.09	9.10	9.03	9.04	1
短期 (1-3)	189,830	99.73	99.80	1.98	0.41	0.55	0.55	1.97	1.97	1.97	0
中期 (3-7)	252,456	99.88	99.98	4.88	0.68	0.72	0.72	4.79	4.78	4.79	1
長期 (7-)	528,313	91.40	91.60	16.75	1.09	1.59	1.50	14.13	14.01	14.03	1
長期 (7-11)	180,067	100.70	100.86	8.77	1.06	0.98	0.99	8.37	8.33	8.37	0
超長期 (11-)	348,246	86.59	86.81	20.87	1.10	1.95	1.81	17.59	17.42	17.43	1
(11-15)	81,733	94.63	94.83	13.05	0.94	1.42	1.39	12.23	12.14	12.21	1
(15-)	266,514	84.12	84.35	23.27	1.15	2.13	1.96	19.44	19.24	19.23	2
地方債	66,798	96.45	96.59	7.32	0.62	1.01	1.02	6.74	6.69	6.72	12
短期 (1-3)	12,882	99.44	99.52	2.05	0.37	0.66	0.66	2.04	2.03	2.04	11
中期 (3-7)	24,729	98.27	98.38	4.95	0.50	0.84	0.83	4.88	4.86	4.88	11
長期 (7-)	29,186	93.58	93.78	11.66	0.84	1.33	1.36	10.59	10.51	10.54	13
政保債	14,373	95.40	95.62	9.24	0.75	1.12	1.07	7.94	7.88	7.91	7
短期 (1-3)	3,441	99.20	99.26	2.05	0.21	0.62	0.62	2.05	2.04	2.05	7
中期 (3-7)	4,157	99.87	100.08	4.45	0.68	0.76	0.76	4.38	4.36	4.38	7
長期 (7-)	6,775	90.74	91.04	15.83	1.07	1.63	1.54	13.59	13.48	13.53	8
金融債	3,376	98.40	98.47	3.11	0.33	0.87	0.87	3.07	3.05	3.07	26
短期 (1-3)	1,968	98.87	98.91	1.97	0.19	0.77	0.77	1.97	1.96	1.97	22
中期 (3-7)	1,249	97.96	98.06	4.25	0.50	0.97	0.96	4.20	4.18	4.20	29
長期 (7-)	159	96.04	96.16	8.31	0.82	1.38	1.36	8.02	7.96	8.01	41
事業債	70,142	95.35	95.53	7.42	0.77	1.30	1.25	6.31	6.26	6.28	39
短期 (1-3)	20,371	99.23	99.34	2.00	0.48	0.89	0.89	1.99	1.98	1.99	34
中期 (3-7)	26,750	98.05	98.22	4.71	0.70	1.12	1.10	4.62	4.59	4.62	40
長期 (7-)	23,021	88.77	89.04	15.35	1.09	1.93	1.80	12.74	12.62	12.64	42
長期 (7-11)	9,672	97.51	97.78	8.70	1.11	1.44	1.42	8.27	8.22	8.27	44
超長期 (11-)	13,349	82.44	82.71	20.17	1.08	2.35	2.13	16.57	16.39	16.39	40
円建外債	3,446	98.74	99.00	3.53	1.06	1.45	1.45	3.37	3.35	3.37	80
短期 (1-3)	1,974	99.25	99.48	2.20	0.96	1.31	1.31	2.17	2.16	2.17	74
中期 (3-7)	1,189	98.06	98.33	4.01	1.00	1.51	1.50	3.92	3.90	3.92	83
長期 (7-)	284	98.02	98.44	10.76	1.98	2.24	2.22	9.50	9.40	9.48	108
長期 (7-11)	166	97.43	97.89	8.63	1.62	1.99	1.97	8.02	7.94	8.01	101
超長期 (11-)	118	98.86	99.21	13.76	2.50	2.59	2.57	11.57	11.42	11.51	118
MBS	13,882	93.96	94.00	7.44	0.63	0.89	1.42	6.89	6.84	7.23	23
ABS	655	95.24	95.41	5.85	0.74	1.50	1.46	5.42	5.38	5.42	68
短期 (1-3)	176	98.84	98.96	2.07	0.64	1.20	1.19	2.06	2.05	2.06	64
中期 (3-7)	313	96.35	96.52	5.11	0.68	1.41	1.38	5.00	4.96	5.00	66
長期 (7-)	166	89.29	89.56	11.28	0.96	2.05	1.92	10.25	10.15	10.23	75

出所:NFRIC

「除く」銘柄 残存別・ポートフォリオ指標 (2024年12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	1,129,390	95.33	95.49	10.29	0.83	1.14	1.10	8.73	8.66	8.68	4
短期 (1-3)	230,642	99.65	99.72	1.99	0.41	0.60	0.60	1.98	1.97	1.98	5
中期 (3-7)	310,843	99.57	99.69	4.86	0.67	0.77	0.76	4.78	4.76	4.77	5
長期 (7-)	587,905	91.40	91.61	16.42	1.08	1.59	1.51	13.89	13.77	13.79	3
長期 (7-11)	206,852	100.39	100.56	8.76	1.05	1.01	1.02	8.36	8.32	8.36	3
超長期 (11-)	381,053	86.52	86.74	20.58	1.09	1.95	1.82	17.36	17.20	17.21	3
(11-15)	93,851	94.18	94.38	12.96	0.93	1.45	1.41	12.15	12.07	12.14	4
(15-)	287,203	84.02	84.25	23.08	1.14	2.13	1.96	19.27	19.07	19.06	3
除く ABS	1,142,617	95.32	95.47	10.26	0.83	1.14	1.10	8.71	8.64	8.67	4
短期 (1-3)	230,465	99.65	99.72	1.99	0.41	0.60	0.60	1.98	1.97	1.98	5
中期 (3-7)	310,530	99.58	99.69	4.86	0.67	0.76	0.76	4.78	4.76	4.77	5
長期 (7-)	601,621	91.46	91.66	16.22	1.07	1.57	1.51	13.72	13.61	13.63	4
長期 (7-11)	206,931	100.39	100.57	8.75	1.05	1.01	1.02	8.36	8.32	8.35	3
超長期 (11-)	394,691	86.78	86.99	20.13	1.08	1.91	1.80	16.97	16.81	16.84	4
(11-15)	93,799	94.18	94.38	12.96	0.93	1.45	1.41	12.15	12.07	12.14	4
(15-)	300,892	84.47	84.69	22.37	1.12	2.07	1.94	18.64	18.46	18.47	4
除く MBS・ABS	1,128,735	95.33	95.49	10.30	0.83	1.14	1.10	8.73	8.67	8.68	4
短期 (1-3)	230,465	99.65	99.72	1.99	0.41	0.60	0.60	1.98	1.97	1.98	5
中期 (3-7)	310,530	99.58	99.69	4.86	0.67	0.76	0.76	4.78	4.76	4.77	5
長期 (7-)	587,739	91.40	91.61	16.42	1.08	1.59	1.51	13.89	13.77	13.79	3
長期 (7-11)	206,759	100.39	100.57	8.76	1.05	1.01	1.02	8.36	8.32	8.36	3
超長期 (11-)	380,980	86.52	86.74	20.59	1.09	1.95	1.82	17.36	17.20	17.21	3
(11-15)	93,799	94.18	94.38	12.96	0.93	1.45	1.41	12.15	12.07	12.14	4
(15-)	287,182	84.02	84.25	23.08	1.14	2.13	1.96	19.27	19.08	19.06	3
除く 国債	172,672	95.79	95.95	7.37	0.70	1.13	1.16	6.53	6.48	6.53	25
短期 (1-3)	40,811	99.28	99.38	2.03	0.43	0.81	0.81	2.02	2.01	2.02	26
中期 (3-7)	58,387	98.26	98.41	4.77	0.61	0.98	0.97	4.69	4.67	4.69	26
長期 (7-)	73,474	91.90	92.10	12.39	0.91	1.46	1.53	10.79	10.70	10.80	24
長期 (7-11)	26,957	98.29	98.55	8.63	0.99	1.22	1.21	8.25	8.20	8.25	24
超長期 (11-)	46,517	88.19	88.36	14.57	0.86	1.62	1.73	12.43	12.31	12.45	24

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12月末、1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	1,152,477	95.33	95.48	10.30	0.83	1.14	1.11	8.74	8.68	8.70	5
短期 (1-3)	230,349	99.65	99.72	2.01	0.42	0.60	0.60	2.00	1.99	2.00	5
中期 (3-7)	313,724	99.57	99.69	4.87	0.67	0.77	0.76	4.78	4.76	4.78	5
長期 (7-)	608,403	91.51	91.71	16.24	1.07	1.57	1.51	13.73	13.62	13.65	4
長期 (7-11)	210,430	100.37	100.54	8.77	1.05	1.02	1.02	8.38	8.34	8.38	3
超長期 (11-)	397,974	86.83	87.05	20.20	1.08	1.91	1.80	17.01	16.85	16.87	4
(11-15)	93,855	94.17	94.37	12.96	0.93	1.45	1.41	12.16	12.07	12.14	4
(15-)	304,119	84.56	84.79	22.43	1.13	2.07	1.94	18.67	18.49	18.49	4
国債	979,414	95.25	95.40	10.81	0.85	1.14	1.10	9.13	9.06	9.07	1
短期 (1-3)	189,531	99.73	99.80	2.00	0.42	0.55	0.55	1.99	1.98	1.99	1
中期 (3-7)	255,016	99.88	99.98	4.88	0.68	0.72	0.72	4.79	4.78	4.79	1
長期 (7-)	534,868	91.45	91.66	16.77	1.09	1.59	1.50	14.14	14.02	14.04	1
長期 (7-11)	183,498	100.66	100.83	8.79	1.05	0.99	0.99	8.39	8.35	8.39	0
超長期 (11-)	351,370	86.65	86.87	20.94	1.11	1.95	1.81	17.62	17.45	17.46	2
(11-15)	81,733	94.63	94.83	13.05	0.94	1.42	1.39	12.23	12.14	12.21	1
(15-)	269,638	84.23	84.46	23.33	1.16	2.13	1.96	19.46	19.26	19.25	2
地方債	66,892	96.45	96.59	7.38	0.63	1.02	1.03	6.79	6.75	6.77	12
短期 (1-3)	12,801	99.41	99.49	2.11	0.37	0.67	0.67	2.10	2.09	2.10	11
中期 (3-7)	24,833	98.25	98.36	5.01	0.50	0.84	0.83	4.94	4.92	4.94	11
長期 (7-)	29,257	93.62	93.81	11.71	0.85	1.34	1.37	10.63	10.55	10.57	13
政保債	14,403	95.41	95.63	9.32	0.76	1.12	1.08	8.00	7.95	7.98	7
短期 (1-3)	3,391	99.17	99.23	2.10	0.21	0.62	0.62	2.09	2.09	2.09	7
中期 (3-7)	4,197	99.92	100.14	4.51	0.69	0.76	0.76	4.43	4.41	4.43	7
長期 (7-)	6,815	90.75	91.05	15.88	1.07	1.63	1.54	13.63	13.52	13.57	8
金融債	3,369	98.40	98.46	3.18	0.34	0.88	0.87	3.13	3.11	3.13	26
短期 (1-3)	1,955	98.85	98.89	2.03	0.20	0.78	0.78	2.02	2.02	2.02	23
中期 (3-7)	1,254	97.99	98.09	4.31	0.51	0.98	0.97	4.25	4.23	4.25	29
長期 (7-)	159	96.04	96.16	8.31	0.82	1.38	1.36	8.02	7.96	8.01	41
事業債	70,141	95.35	95.53	7.44	0.77	1.30	1.25	6.34	6.29	6.31	39
短期 (1-3)	20,350	99.22	99.33	2.04	0.48	0.89	0.89	2.03	2.02	2.03	34
中期 (3-7)	26,875	98.02	98.20	4.75	0.70	1.12	1.11	4.65	4.63	4.65	40
長期 (7-)	22,916	88.77	89.04	15.41	1.10	1.93	1.81	12.78	12.66	12.68	42
長期 (7-11)	9,592	97.59	97.85	8.75	1.12	1.44	1.42	8.31	8.25	8.31	44
超長期 (11-)	13,324	82.42	82.69	20.20	1.08	2.35	2.13	16.59	16.41	16.41	40
円建外債	3,675	98.81	99.06	3.61	1.10	1.47	1.46	3.43	3.41	3.43	81
短期 (1-3)	2,152	99.27	99.50	2.24	1.01	1.34	1.34	2.21	2.20	2.21	78
中期 (3-7)	1,221	98.15	98.42	4.10	1.02	1.50	1.49	4.01	3.98	4.01	82
長期 (7-)	301	98.12	98.51	11.41	2.04	2.29	2.26	9.90	9.79	9.86	108
長期 (7-11)	169	97.54	97.97	8.76	1.66	2.02	1.99	8.12	8.04	8.12	102
超長期 (11-)	132	98.86	99.20	14.81	2.54	2.63	2.61	12.16	12.00	12.07	116
MBS	13,925	93.98	94.01	7.47	0.64	0.89	1.42	6.92	6.87	7.27	22
ABS	657	95.25	95.43	5.91	0.75	1.50	1.46	5.49	5.44	5.48	67
短期 (1-3)	169	98.82	98.92	2.12	0.64	1.20	1.19	2.10	2.09	2.10	64
中期 (3-7)	327	96.36	96.53	5.14	0.69	1.41	1.39	5.03	5.00	5.03	66
長期 (7-)	162	89.29	89.55	11.44	0.99	2.06	1.93	10.38	10.28	10.36	75

出所:NFRIC

「除く」銘柄 残存別・ポートフォリオ指標 (2024年12月末、1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	1,138,551	95.35	95.50	10.34	0.83	1.14	1.10	8.76	8.70	8.71	4
短期 (1-3)	230,349	99.65	99.72	2.01	0.42	0.60	0.60	2.00	1.99	2.00	5
中期 (3-7)	313,724	99.57	99.69	4.87	0.67	0.77	0.76	4.78	4.76	4.78	5
長期 (7-)	594,478	91.45	91.66	16.45	1.08	1.59	1.51	13.90	13.78	13.80	3
長期 (7-11)	210,258	100.37	100.54	8.78	1.05	1.02	1.02	8.38	8.34	8.38	3
超長期 (11-)	384,220	86.58	86.80	20.65	1.10	1.95	1.82	17.39	17.23	17.24	3
(11-15)	93,855	94.17	94.37	12.96	0.93	1.45	1.41	12.16	12.07	12.14	4
(15-)	290,365	84.12	84.35	23.13	1.15	2.13	1.97	19.29	19.09	19.08	3
除く ABS	1,151,819	95.33	95.48	10.31	0.83	1.14	1.11	8.74	8.68	8.70	5
短期 (1-3)	230,181	99.65	99.72	2.01	0.42	0.60	0.60	2.00	1.99	2.00	5
中期 (3-7)	313,397	99.58	99.69	4.87	0.67	0.77	0.76	4.78	4.76	4.78	5
長期 (7-)	608,242	91.51	91.71	16.25	1.07	1.57	1.51	13.74	13.62	13.65	4
長期 (7-11)	210,341	100.37	100.54	8.77	1.05	1.02	1.02	8.38	8.34	8.37	3
超長期 (11-)	397,901	86.83	87.05	20.20	1.08	1.91	1.80	17.01	16.85	16.87	4
(11-15)	93,803	94.17	94.37	12.96	0.93	1.45	1.41	12.16	12.07	12.14	4
(15-)	304,098	84.57	84.79	22.43	1.13	2.07	1.94	18.67	18.49	18.49	4
除く MBS・ABS	1,137,894	95.35	95.50	10.34	0.83	1.14	1.10	8.77	8.70	8.72	4
短期 (1-3)	230,181	99.65	99.72	2.01	0.42	0.60	0.60	2.00	1.99	2.00	5
中期 (3-7)	313,397	99.58	99.69	4.87	0.67	0.77	0.76	4.78	4.76	4.78	5
長期 (7-)	594,317	91.45	91.66	16.45	1.08	1.59	1.51	13.90	13.78	13.80	3
長期 (7-11)	210,169	100.37	100.54	8.78	1.05	1.02	1.02	8.38	8.34	8.38	3
超長期 (11-)	384,147	86.58	86.80	20.65	1.10	1.95	1.82	17.39	17.23	17.24	3
(11-15)	93,803	94.17	94.37	12.96	0.93	1.45	1.41	12.16	12.07	12.14	4
(15-)	290,344	84.12	84.35	23.13	1.15	2.13	1.97	19.29	19.10	19.08	3
除く 国債	173,062	95.80	95.96	7.41	0.70	1.14	1.16	6.57	6.52	6.57	25
短期 (1-3)	40,819	99.26	99.36	2.08	0.44	0.82	0.82	2.07	2.06	2.07	26
中期 (3-7)	58,708	98.25	98.40	4.82	0.62	0.98	0.97	4.74	4.71	4.74	26
長期 (7-)	73,535	91.92	92.12	12.44	0.91	1.46	1.53	10.83	10.73	10.84	24
長期 (7-11)	26,932	98.34	98.59	8.69	1.01	1.22	1.22	8.30	8.25	8.30	24
超長期 (11-)	46,603	88.21	88.38	14.60	0.86	1.62	1.73	12.45	12.33	12.47	24

出所:NFRG

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

特定銘柄 残存別・ポートフォリオ指標 (2024年12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	187,009	90.62	90.90	20.55	1.46	1.89	1.78	17.01	16.85	16.87	2
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	3,182	110.08	110.48	5.93	2.52	0.73	0.77	5.55	5.53	5.54	1
長期(7-)	183,827	90.28	90.56	20.81	1.45	1.91	1.80	17.25	17.09	17.11	2
長期(7-11)	14,873	110.15	110.46	9.39	2.17	1.00	1.05	8.57	8.52	8.56	2
超長期(11-)	168,954	88.54	88.81	21.81	1.38	2.01	1.89	18.21	18.03	18.04	2
20年国債	296,438	97.57	97.77	10.35	1.32	1.15	1.13	9.37	9.31	9.35	1
短期(1-3)	26,692	103.31	103.65	2.09	2.17	0.55	0.56	2.05	2.05	2.05	1
中期(3-7)	65,961	106.29	106.59	5.18	2.01	0.71	0.73	4.94	4.92	4.94	1
長期(7-)	203,785	93.99	94.14	13.10	0.98	1.40	1.35	12.05	11.97	12.03	1
長期(7-11)	72,619	103.65	103.88	9.08	1.48	1.00	1.02	8.51	8.47	8.50	1
超長期(11-)	131,166	88.64	88.76	15.33	0.71	1.66	1.57	14.35	14.24	14.31	0
10年国債	291,091	97.35	97.39	5.45	0.24	0.77	0.76	5.36	5.34	5.36	0
短期(1-3)	67,785	99.04	99.06	2.08	0.10	0.56	0.56	2.08	2.07	2.08	0
中期(3-7)	130,731	96.81	96.83	5.09	0.10	0.74	0.72	5.07	5.05	5.07	0
長期(7-)	92,575	96.87	96.96	8.42	0.55	0.97	0.96	8.23	8.19	8.22	0
5年国債	116,560	98.91	98.94	2.92	0.19	0.61	0.61	2.91	2.90	2.91	1
短期(1-3)	63,978	98.96	98.97	2.11	0.05	0.56	0.56	2.10	2.10	2.10	0
中期(3-7)	52,582	98.84	98.90	3.91	0.36	0.68	0.67	3.89	3.87	3.89	1
中期国債	31,376	99.72	99.81	1.41	0.31	0.52	0.52	1.41	1.41	1.41	1
短期(1-3)	31,376	99.72	99.81	1.41	0.31	0.52	0.52	1.41	1.41	1.41	1
中期(3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
地方公共団体	56,966	96.55	96.69	7.12	0.59	0.99	1.01	6.59	6.55	6.57	11
短期(1-3)	11,338	99.37	99.44	2.05	0.33	0.66	0.66	2.04	2.04	2.04	11
中期(3-7)	21,188	98.13	98.23	4.94	0.46	0.83	0.82	4.87	4.85	4.87	11
長期(7-)	24,440	93.87	94.07	11.38	0.83	1.30	1.34	10.38	10.31	10.33	12
東京都債	4,494	97.77	98.02	7.19	0.72	1.00	0.98	6.56	6.52	6.54	11
短期(1-3)	980	99.45	99.59	2.11	0.40	0.66	0.66	2.10	2.09	2.10	11
中期(3-7)	1,925	98.25	98.43	5.06	0.51	0.83	0.83	4.98	4.96	4.98	10
長期(7-)	1,589	96.15	96.56	12.91	1.17	1.42	1.38	11.34	11.25	11.29	12
五大都市債	6,209	96.78	96.95	8.04	0.84	1.04	1.08	7.18	7.13	7.14	12
短期(1-3)	1,261	99.81	99.91	2.10	0.56	0.66	0.66	2.09	2.08	2.09	11
中期(3-7)	2,083	99.78	99.94	4.79	0.80	0.81	0.81	4.69	4.67	4.69	11
長期(7-)	2,866	93.27	93.48	13.02	0.99	1.40	1.48	11.51	11.42	11.43	14
その他地方公共団体	46,263	96.40	96.52	6.99	0.54	0.98	1.00	6.51	6.48	6.49	11
短期(1-3)	9,097	99.30	99.36	2.04	0.29	0.66	0.65	2.03	2.02	2.03	11
中期(3-7)	17,181	97.92	98.00	4.94	0.41	0.83	0.82	4.88	4.86	4.88	11
長期(7-)	19,985	93.78	93.95	11.02	0.77	1.27	1.32	10.14	10.07	10.09	12
その他地方債	9,832	95.83	96.02	8.48	0.81	1.16	1.12	7.59	7.54	7.57	17
短期(1-3)	1,545	99.98	100.09	2.02	0.64	0.70	0.70	2.01	2.00	2.01	15
中期(3-7)	3,541	99.09	99.24	5.05	0.72	0.89	0.88	4.95	4.93	4.95	16
長期(7-)	4,746	92.05	92.28	13.14	0.93	1.53	1.46	11.67	11.58	11.63	17
特定金融債	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
政保地方公営企業債	1,465	98.55	98.60	2.85	0.16	0.66	0.66	2.84	2.83	2.84	6
短期(1-3)	815	98.93	98.96	2.15	0.12	0.62	0.62	2.14	2.14	2.14	6
中期(3-7)	650	98.08	98.14	3.74	0.21	0.72	0.72	3.72	3.71	3.72	7
長期(7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
その他政保債	12,908	95.05	95.29	9.97	0.82	1.17	1.12	8.53	8.47	8.50	8
短期(1-3)	2,626	99.28	99.35	2.03	0.24	0.62	0.62	2.02	2.01	2.02	7
中期(3-7)	3,507	100.20	100.44	4.58	0.76	0.77	0.77	4.49	4.48	4.49	7
長期(7-)	6,775	90.74	91.04	15.83	1.07	1.63	1.54	13.59	13.48	13.53	8
SDGs	19,765	96.30	96.43	7.18	0.62	1.13	1.10	6.48	6.44	6.46	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。

特定銘柄 残存別・ポートフォリオ指標 (2024年12月末、1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	187,979	90.65	90.93	20.60	1.47	1.89	1.78	17.04	16.88	16.89	2
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	3,185	110.08	110.48	5.93	2.52	0.73	0.77	5.55	5.53	5.55	1
長期(7-)	184,794	90.31	90.59	20.85	1.45	1.91	1.81	17.28	17.12	17.13	2
長期(7-11)	14,875	110.15	110.46	9.39	2.17	1.00	1.05	8.57	8.52	8.56	2
超長期(11-)	169,919	88.58	88.85	21.85	1.39	2.01	1.89	18.23	18.05	18.06	2
20年国債	297,828	97.57	97.77	10.38	1.32	1.15	1.13	9.40	9.34	9.38	1
短期(1-3)	26,692	103.31	103.65	2.09	2.17	0.55	0.56	2.05	2.05	2.05	1
中期(3-7)	65,979	106.29	106.59	5.18	2.01	0.71	0.73	4.94	4.92	4.94	1
長期(7-)	205,157	94.02	94.17	13.13	0.99	1.40	1.35	12.08	11.99	12.05	1
長期(7-11)	72,811	103.65	103.87	9.08	1.48	1.00	1.02	8.51	8.47	8.50	1
超長期(11-)	132,345	88.72	88.83	15.36	0.72	1.66	1.57	14.37	14.26	14.33	0
10年国債	294,338	97.36	97.40	5.50	0.25	0.77	0.76	5.40	5.38	5.40	0
短期(1-3)	67,785	99.04	99.06	2.08	0.10	0.56	0.56	2.08	2.07	2.08	0
中期(3-7)	130,741	96.81	96.83	5.09	0.10	0.74	0.72	5.07	5.05	5.07	0
長期(7-)	95,812	96.92	97.01	8.47	0.56	0.97	0.96	8.26	8.22	8.26	0
5年国債	119,088	98.93	98.96	2.96	0.20	0.61	0.61	2.95	2.94	2.95	1
短期(1-3)	63,978	98.96	98.97	2.11	0.05	0.56	0.56	2.10	2.10	2.10	0
中期(3-7)	55,111	98.89	98.95	3.95	0.37	0.68	0.67	3.92	3.91	3.92	1
中期国債	31,076	99.75	99.84	1.49	0.35	0.53	0.53	1.49	1.49	1.49	2
短期(1-3)	31,076	99.75	99.84	1.49	0.35	0.53	0.53	1.49	1.49	1.49	2
中期(3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
地方公共団体	57,062	96.55	96.69	7.19	0.60	0.99	1.01	6.65	6.61	6.63	11
短期(1-3)	11,243	99.34	99.41	2.11	0.33	0.66	0.66	2.10	2.09	2.10	11
中期(3-7)	21,282	98.11	98.21	4.99	0.46	0.83	0.82	4.92	4.90	4.92	11
長期(7-)	24,537	93.93	94.12	11.42	0.84	1.30	1.35	10.42	10.34	10.36	12
東京都債	4,504	97.78	98.03	7.20	0.72	1.00	0.98	6.56	6.52	6.55	11
短期(1-3)	980	99.45	99.59	2.11	0.40	0.66	0.66	2.10	2.09	2.10	11
中期(3-7)	1,925	98.25	98.43	5.06	0.51	0.83	0.83	4.98	4.96	4.98	10
長期(7-)	1,599	96.17	96.58	12.89	1.17	1.42	1.38	11.32	11.24	11.28	12
五大都市債	6,192	96.77	96.94	8.08	0.84	1.05	1.08	7.21	7.16	7.18	12
短期(1-3)	1,251	99.79	99.89	2.16	0.56	0.67	0.67	2.15	2.14	2.15	11
中期(3-7)	2,073	99.77	99.93	4.82	0.81	0.81	0.82	4.72	4.70	4.72	11
長期(7-)	2,869	93.29	93.50	13.01	1.00	1.40	1.48	11.50	11.41	11.41	14
その他地方公共団体	46,365	96.40	96.52	7.07	0.55	0.98	1.00	6.58	6.54	6.56	11
短期(1-3)	9,012	99.26	99.32	2.10	0.29	0.66	0.66	2.09	2.09	2.09	11
中期(3-7)	17,285	97.89	97.98	5.00	0.41	0.83	0.82	4.94	4.92	4.94	11
長期(7-)	20,069	93.84	94.01	11.08	0.79	1.27	1.33	10.19	10.12	10.14	12
その他地方債	9,830	95.83	96.01	8.53	0.81	1.16	1.12	7.63	7.58	7.61	17
短期(1-3)	1,559	99.98	100.09	2.09	0.65	0.71	0.71	2.07	2.06	2.07	16
中期(3-7)	3,551	99.09	99.25	5.12	0.73	0.89	0.89	5.02	4.99	5.02	16
長期(7-)	4,720	92.00	92.23	13.21	0.93	1.54	1.47	11.73	11.64	11.69	17
特定金融債	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
政保地方公営企業債	1,425	98.52	98.56	2.90	0.15	0.67	0.66	2.89	2.88	2.89	6
短期(1-3)	825	98.86	98.89	2.26	0.11	0.63	0.62	2.25	2.24	2.25	6
中期(3-7)	600	98.04	98.11	3.79	0.21	0.73	0.72	3.78	3.76	3.78	7
長期(7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
その他政保債	12,978	95.06	95.30	10.02	0.82	1.17	1.13	8.59	8.52	8.55	8
短期(1-3)	2,566	99.27	99.34	2.05	0.24	0.62	0.62	2.04	2.03	2.04	7
中期(3-7)	3,597	100.23	100.48	4.63	0.77	0.77	0.77	4.53	4.52	4.53	7
長期(7-)	6,815	90.75	91.05	15.88	1.07	1.63	1.54	13.63	13.52	13.57	8
SDGs	20,073	96.35	96.47	7.22	0.63	1.13	1.10	6.51	6.47	6.49	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12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	70,142	95.35	95.53	7.42	0.77	1.30	1.25	6.31	6.26	6.28	39
短期 (1-3)	20,371	99.23	99.34	2.00	0.48	0.89	0.89	1.99	1.98	1.99	34
中期 (3-7)	26,750	98.05	98.22	4.71	0.70	1.12	1.10	4.62	4.59	4.62	40
長期 (7-)	23,021	88.77	89.04	15.35	1.09	1.93	1.80	12.74	12.62	12.64	42
長期 (7-11)	9,672	97.51	97.78	8.70	1.11	1.44	1.42	8.27	8.22	8.27	44
超長期 (11-)	13,349	82.44	82.71	20.17	1.08	2.35	2.13	16.57	16.39	16.39	40
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	96.11	96.16	4.73	0.21	1.03	1.01	4.64	4.61	4.64	32
短期 (1-3)	10	99.21	99.23	1.21	0.08	0.74	0.74	1.21	1.20	1.21	25
中期 (3-7)	20	94.55	94.62	6.50	0.28	1.17	1.14	6.44	6.40	6.44	35
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
建設業	1,250	97.45	97.54	4.29	0.52	1.08	1.07	4.13	4.11	4.13	38
短期 (1-3)	505	98.89	98.95	2.22	0.36	0.89	0.89	2.21	2.20	2.21	33
中期 (3-7)	595	97.71	97.85	4.49	0.60	1.12	1.11	4.42	4.40	4.42	41
長期 (7-)	150	91.56	91.60	10.50	0.75	1.63	1.55	9.90	9.82	9.89	43
長期 (7-11)	84	95.71	95.76	8.03	0.78	1.38	1.36	7.79	7.73	7.79	44
超長期 (11-)	66	86.29	86.31	13.64	0.71	1.97	1.83	12.88	12.76	12.86	41
食料品	1,543	97.51	97.63	5.08	0.54	1.07	1.06	4.81	4.78	4.80	31
短期 (1-3)	562	98.99	99.04	1.87	0.26	0.81	0.80	1.86	1.85	1.86	27
中期 (3-7)	606	97.89	98.00	4.47	0.52	1.02	1.01	4.41	4.39	4.41	32
長期 (7-)	375	94.70	94.92	10.88	1.02	1.57	1.52	10.06	9.98	10.04	37
長期 (7-11)	235	97.33	97.51	8.62	0.98	1.34	1.32	8.26	8.21	8.26	35
超長期 (11-)	140	90.27	90.58	14.67	1.09	1.98	1.89	13.32	13.19	13.27	39
繊維製品	225	97.31	97.47	4.60	0.53	1.10	1.08	4.38	4.35	4.38	37
短期 (1-3)	80	98.79	98.92	2.34	0.33	0.87	0.86	2.33	2.32	2.33	30
中期 (3-7)	109	97.99	98.12	3.99	0.52	1.06	1.05	3.94	3.92	3.94	38
長期 (7-)	36	91.98	92.25	11.48	1.03	1.80	1.72	10.68	10.58	10.66	50
長期 (7-11)	16	98.47	98.60	8.90	1.29	1.49	1.47	8.42	8.36	8.42	48
超長期 (11-)	20	86.79	87.17	13.54	0.83	2.08	1.94	12.72	12.59	12.70	52
パルプ・紙	325	96.01	96.11	4.81	0.44	1.25	1.22	4.52	4.48	4.51	50
短期 (1-3)	140	98.70	98.75	1.85	0.30	1.04	1.03	1.84	1.83	1.84	49
中期 (3-7)	140	95.75	95.84	5.02	0.41	1.25	1.22	4.94	4.91	4.94	50
長期 (7-)	45	88.47	88.70	13.39	0.98	2.02	1.90	12.36	12.25	12.34	51
長期 (7-11)	10	97.80	97.87	8.95	1.34	1.63	1.61	8.45	8.39	8.45	61
超長期 (11-)	35	85.80	86.08	14.65	0.88	2.15	2.00	13.63	13.50	13.60	48
化学	2,291	95.58	95.71	5.50	0.54	1.25	1.21	5.10	5.06	5.09	45
短期 (1-3)	735	98.82	98.91	2.20	0.36	0.92	0.92	2.19	2.18	2.19	36
中期 (3-7)	1,063	96.94	97.06	4.79	0.51	1.15	1.13	4.72	4.69	4.71	43
長期 (7-)	493	87.83	88.01	11.93	0.88	2.04	1.90	10.89	10.78	10.87	67
長期 (7-11)	220	96.22	96.45	8.26	0.94	1.48	1.45	7.93	7.88	7.93	51
超長期 (11-)	273	81.08	81.22	14.89	0.83	2.58	2.33	13.72	13.56	13.68	82
医薬品	815	95.89	96.06	5.94	0.57	1.22	1.19	5.58	5.54	5.58	41
短期 (1-3)	165	99.13	99.21	1.80	0.32	0.82	0.81	1.79	1.79	1.79	28
中期 (3-7)	525	96.41	96.56	5.57	0.56	1.20	1.18	5.45	5.42	5.45	43
長期 (7-)	125	89.41	89.79	12.95	0.94	1.90	1.79	11.69	11.59	11.66	48
長期 (7-11)	25	96.82	97.13	8.50	1.05	1.49	1.46	8.12	8.06	8.12	50
超長期 (11-)	100	87.56	87.96	14.07	0.91	2.02	1.89	12.68	12.56	12.64	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12月末、1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	70,141	95.35	95.53	7.44	0.77	1.30	1.25	6.34	6.29	6.31	39
短期 (1-3)	20,350	99.22	99.33	2.04	0.48	0.89	0.89	2.03	2.02	2.03	34
中期 (3-7)	26,875	98.02	98.20	4.75	0.70	1.12	1.11	4.65	4.63	4.65	40
長期 (7-)	22,916	88.77	89.04	15.41	1.10	1.93	1.81	12.78	12.66	12.68	42
長期 (7-11)	9,592	97.59	97.85	8.75	1.12	1.44	1.42	8.31	8.25	8.31	44
超長期 (11-)	13,324	82.42	82.69	20.20	1.08	2.35	2.13	16.59	16.41	16.41	40
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	96.11	96.16	4.73	0.21	1.03	1.01	4.64	4.61	4.64	32
短期 (1-3)	10	99.21	99.23	1.21	0.08	0.74	0.74	1.21	1.20	1.21	25
中期 (3-7)	20	94.55	94.62	6.50	0.28	1.17	1.14	6.44	6.40	6.44	35
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
建設業	1,250	97.45	97.54	4.29	0.52	1.08	1.07	4.13	4.11	4.13	38
短期 (1-3)	505	98.89	98.95	2.22	0.36	0.89	0.89	2.21	2.20	2.21	33
中期 (3-7)	595	97.71	97.85	4.49	0.60	1.12	1.11	4.42	4.40	4.42	41
長期 (7-)	150	91.56	91.60	10.50	0.75	1.63	1.55	9.90	9.82	9.89	43
長期 (7-11)	84	95.71	95.76	8.03	0.78	1.38	1.36	7.79	7.73	7.79	44
超長期 (11-)	66	86.29	86.31	13.64	0.71	1.97	1.83	12.88	12.76	12.86	41
食料品	1,543	97.51	97.63	5.08	0.54	1.07	1.06	4.81	4.78	4.80	31
短期 (1-3)	562	98.99	99.04	1.87	0.26	0.81	0.80	1.86	1.85	1.86	27
中期 (3-7)	606	97.89	98.00	4.47	0.52	1.02	1.01	4.41	4.39	4.41	32
長期 (7-)	375	94.70	94.92	10.88	1.02	1.57	1.52	10.06	9.98	10.04	37
長期 (7-11)	235	97.33	97.51	8.62	0.98	1.34	1.32	8.26	8.21	8.26	35
超長期 (11-)	140	90.27	90.58	14.67	1.09	1.98	1.89	13.32	13.19	13.27	39
繊維製品	225	97.31	97.47	4.60	0.53	1.10	1.08	4.38	4.35	4.38	37
短期 (1-3)	80	98.79	98.92	2.34	0.33	0.87	0.86	2.33	2.32	2.33	30
中期 (3-7)	109	97.99	98.12	3.99	0.52	1.06	1.05	3.94	3.92	3.94	38
長期 (7-)	36	91.98	92.25	11.48	1.03	1.80	1.72	10.68	10.58	10.66	50
長期 (7-11)	16	98.47	98.60	8.90	1.29	1.49	1.47	8.42	8.36	8.42	48
超長期 (11-)	20	86.79	87.17	13.54	0.83	2.08	1.94	12.72	12.59	12.70	52
パルプ・紙	325	96.01	96.11	4.81	0.44	1.25	1.22	4.52	4.48	4.51	50
短期 (1-3)	150	98.68	98.74	1.93	0.31	1.03	1.03	1.92	1.91	1.92	48
中期 (3-7)	130	95.55	95.63	5.17	0.41	1.27	1.24	5.09	5.06	5.09	52
長期 (7-)	45	88.47	88.70	13.39	0.98	2.02	1.90	12.36	12.25	12.34	51
長期 (7-11)	10	97.80	97.87	8.95	1.34	1.63	1.61	8.45	8.39	8.45	61
超長期 (11-)	35	85.80	86.08	14.65	0.88	2.15	2.00	13.63	13.50	13.60	48
化学	2,291	95.58	95.71	5.50	0.54	1.25	1.21	5.10	5.06	5.09	45
短期 (1-3)	735	98.82	98.91	2.20	0.36	0.92	0.92	2.19	2.18	2.19	36
中期 (3-7)	1,063	96.94	97.06	4.79	0.51	1.15	1.13	4.72	4.69	4.71	43
長期 (7-)	493	87.83	88.01	11.93	0.88	2.04	1.90	10.89	10.78	10.87	67
長期 (7-11)	220	96.22	96.45	8.26	0.94	1.48	1.45	7.93	7.88	7.93	51
超長期 (11-)	273	81.08	81.22	14.89	0.83	2.58	2.33	13.72	13.56	13.68	82
医薬品	815	95.89	96.06	5.94	0.57	1.22	1.19	5.58	5.54	5.58	41
短期 (1-3)	165	99.13	99.21	1.80	0.32	0.82	0.81	1.79	1.79	1.79	28
中期 (3-7)	525	96.41	96.56	5.57	0.56	1.20	1.18	5.45	5.42	5.45	43
長期 (7-)	125	89.41	89.79	12.95	0.94	1.90	1.79	11.69	11.59	11.66	48
長期 (7-11)	25	96.82	97.13	8.50	1.05	1.49	1.46	8.12	8.06	8.12	50
超長期 (11-)	100	87.56	87.96	14.07	0.91	2.02	1.89	12.68	12.56	12.64	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12月末)

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
石油・石炭製品	265	95.54	95.65	6.37	0.60	1.34	1.30	6.02	5.98	6.02	49
短期 (1-3)	50	98.84	98.97	1.99	0.30	0.91	0.91	1.98	1.97	1.98	36
中期 (3-7)	95	95.84	95.97	5.27	0.39	1.20	1.18	5.19	5.16	5.19	45
長期 (7-)	120	93.93	94.03	9.06	0.90	1.63	1.58	8.47	8.40	8.46	59
長期 (7-11)	95	95.79	95.86	7.47	0.84	1.46	1.44	7.24	7.19	7.24	57
超長期 (11-)	25	86.88	87.06	15.10	1.13	2.32	2.16	13.59	13.45	13.54	64
ゴム製品	330	97.82	97.90	3.53	0.39	1.01	1.00	3.47	3.45	3.47	36
短期 (1-3)	158	98.92	98.98	1.95	0.30	0.87	0.86	1.94	1.93	1.94	32
中期 (3-7)	147	97.07	97.16	4.51	0.41	1.09	1.08	4.46	4.43	4.46	38
長期 (7-)	25	95.29	95.45	7.75	0.76	1.45	1.42	7.51	7.46	7.51	53
長期 (7-11)	25	95.29	95.45	7.75	0.76	1.45	1.42	7.51	7.46	7.51	53
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
ガラス・土石製品	262	95.97	96.09	5.66	0.56	1.24	1.20	5.30	5.26	5.30	43
短期 (1-3)	68	98.87	98.90	1.96	0.29	0.88	0.88	1.95	1.94	1.95	33
中期 (3-7)	107	97.45	97.55	4.22	0.49	1.11	1.10	4.17	4.14	4.17	42
長期 (7-)	87	91.91	92.12	10.28	0.87	1.69	1.61	9.56	9.48	9.55	51
長期 (7-11)	62	96.16	96.34	8.45	0.89	1.42	1.39	8.13	8.07	8.13	44
超長期 (11-)	25	81.32	81.61	14.84	0.80	2.50	2.25	13.77	13.61	13.74	73
鉄鋼	445	97.87	97.96	3.93	0.52	1.08	1.07	3.81	3.79	3.81	41
短期 (1-3)	170	98.87	98.92	1.88	0.28	0.90	0.89	1.88	1.87	1.88	35
中期 (3-7)	222	97.75	97.85	4.20	0.57	1.10	1.09	4.14	4.12	4.14	42
長期 (7-)	53	95.18	95.37	9.37	1.09	1.63	1.58	8.81	8.73	8.80	56
長期 (7-11)	43	97.31	97.54	8.42	1.12	1.49	1.47	8.03	7.97	8.03	52
超長期 (11-)	10	85.99	86.04	13.45	0.95	2.32	2.16	12.58	12.44	12.55	74
非鉄金属	385	97.76	97.90	4.04	0.47	1.07	1.06	3.95	3.93	3.95	39
短期 (1-3)	165	98.72	98.80	2.05	0.30	0.95	0.94	2.04	2.04	2.04	39
中期 (3-7)	170	97.30	97.43	4.65	0.54	1.13	1.11	4.58	4.56	4.58	41
長期 (7-)	50	96.15	96.53	8.53	0.81	1.31	1.29	8.23	8.17	8.22	33
長期 (7-11)	50	96.15	96.53	8.53	0.81	1.31	1.29	8.23	8.17	8.22	33
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
金属製品	196	98.22	98.42	3.88	0.59	1.09	1.08	3.81	3.79	3.81	42
短期 (1-3)	65	98.66	98.77	2.33	0.39	0.99	0.98	2.32	2.30	2.32	42
中期 (3-7)	122	98.23	98.47	4.42	0.69	1.11	1.10	4.35	4.32	4.35	41
長期 (7-)	9	94.89	95.12	7.66	0.70	1.45	1.41	7.44	7.39	7.44	53
長期 (7-11)	9	94.89	95.12	7.66	0.70	1.45	1.41	7.44	7.39	7.44	53
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
機械	1,277	97.57	97.71	4.62	0.52	1.10	1.09	4.50	4.47	4.50	38
短期 (1-3)	430	98.74	98.81	2.20	0.32	0.91	0.91	2.19	2.18	2.19	35
中期 (3-7)	580	97.18	97.31	4.69	0.49	1.10	1.09	4.62	4.59	4.62	38
長期 (7-)	267	96.54	96.79	8.36	0.91	1.40	1.38	8.03	7.98	8.03	43
長期 (7-11)	267	96.54	96.79	8.36	0.91	1.40	1.38	8.03	7.98	8.03	43
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
電気機器	1,940	97.96	98.09	4.21	0.55	1.08	1.07	4.11	4.08	4.11	39
短期 (1-3)	760	98.85	98.93	2.23	0.37	0.90	0.90	2.21	2.20	2.21	34
中期 (3-7)	935	97.40	97.54	4.67	0.56	1.12	1.11	4.60	4.57	4.60	40
長期 (7-)	245	97.29	97.60	8.59	1.10	1.47	1.45	8.19	8.13	8.19	48
長期 (7-11)	245	97.29	97.60	8.59	1.10	1.47	1.45	8.19	8.13	8.19	48
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
輸送用機器	1,147	97.18	97.29	4.28	0.44	1.08	1.06	4.08	4.06	4.08	37
短期 (1-3)	545	98.90	98.97	1.78	0.26	0.88	0.88	1.78	1.77	1.78	35
中期 (3-7)	393	97.35	97.48	4.57	0.49	1.07	1.06	4.50	4.48	4.50	36
長期 (7-)	209	92.35	92.56	10.24	0.81	1.63	1.56	9.68	9.60	9.67	45
長期 (7-11)	119	96.64	96.83	8.46	0.92	1.39	1.37	8.12	8.07	8.12	41
超長期 (11-)	90	86.69	86.91	12.60	0.67	1.98	1.85	11.97	11.86	11.95	51

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12月末、1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	280	95.78	95.89	6.32	0.64	1.33	1.30	5.99	5.94	5.98	50
短期 (1-3)	50	98.84	98.97	1.99	0.30	0.91	0.91	1.98	1.97	1.98	36
中期 (3-7)	110	96.40	96.53	5.31	0.52	1.22	1.20	5.22	5.19	5.22	46
長期 (7-)	120	93.93	94.03	9.06	0.90	1.63	1.58	8.47	8.40	8.46	59
長期 (7-11)	95	95.79	95.86	7.47	0.84	1.46	1.44	7.24	7.19	7.24	57
超長期 (11-)	25	86.88	87.06	15.10	1.13	2.32	2.16	13.59	13.45	13.54	64
ゴム製品	330	97.82	97.90	3.53	0.39	1.01	1.00	3.47	3.45	3.47	36
短期 (1-3)	158	98.92	98.98	1.95	0.30	0.87	0.86	1.94	1.93	1.94	32
中期 (3-7)	147	97.07	97.16	4.51	0.41	1.09	1.08	4.46	4.43	4.46	38
長期 (7-)	25	95.29	95.45	7.75	0.76	1.45	1.42	7.51	7.46	7.51	53
長期 (7-11)	25	95.29	95.45	7.75	0.76	1.45	1.42	7.51	7.46	7.51	53
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
ガラス・土石製品	267	96.03	96.16	5.64	0.57	1.23	1.20	5.29	5.25	5.29	42
短期 (1-3)	68	98.87	98.90	1.96	0.29	0.88	0.88	1.95	1.94	1.95	33
中期 (3-7)	112	97.54	97.64	4.25	0.51	1.11	1.09	4.20	4.17	4.20	42
長期 (7-)	87	91.91	92.12	10.28	0.87	1.69	1.61	9.56	9.48	9.55	51
長期 (7-11)	62	96.16	96.34	8.45	0.89	1.42	1.39	8.13	8.07	8.13	44
超長期 (11-)	25	81.32	81.61	14.84	0.80	2.50	2.25	13.77	13.61	13.74	73
鉄鋼	475	98.00	98.09	3.90	0.55	1.08	1.07	3.78	3.76	3.78	41
短期 (1-3)	192	99.00	99.05	2.00	0.36	0.91	0.91	1.99	1.98	1.99	36
中期 (3-7)	230	97.82	97.92	4.22	0.58	1.11	1.09	4.16	4.14	4.16	42
長期 (7-)	53	95.18	95.37	9.37	1.09	1.63	1.58	8.81	8.73	8.80	56
長期 (7-11)	43	97.31	97.54	8.42	1.12	1.49	1.47	8.03	7.97	8.03	52
超長期 (11-)	10	85.99	86.04	13.45	0.95	2.32	2.16	12.58	12.44	12.55	74
非鉄金属	395	97.82	97.95	4.07	0.49	1.07	1.06	3.97	3.95	3.97	39
短期 (1-3)	165	98.72	98.80	2.05	0.30	0.95	0.94	2.04	2.04	2.04	39
中期 (3-7)	180	97.45	97.58	4.67	0.57	1.13	1.11	4.60	4.57	4.60	41
長期 (7-)	50	96.15	96.53	8.53	0.81	1.31	1.29	8.23	8.17	8.22	33
長期 (7-11)	50	96.15	96.53	8.53	0.81	1.31	1.29	8.23	8.17	8.22	33
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
金属製品	196	98.22	98.42	3.88	0.59	1.09	1.08	3.81	3.79	3.81	42
短期 (1-3)	65	98.66	98.77	2.33	0.39	0.99	0.98	2.32	2.30	2.32	42
中期 (3-7)	122	98.23	98.47	4.42	0.69	1.11	1.10	4.35	4.32	4.35	41
長期 (7-)	9	94.89	95.12	7.66	0.70	1.45	1.41	7.44	7.39	7.44	53
長期 (7-11)	9	94.89	95.12	7.66	0.70	1.45	1.41	7.44	7.39	7.44	53
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
機械	1,277	97.57	97.71	4.62	0.52	1.10	1.09	4.50	4.47	4.50	38
短期 (1-3)	430	98.74	98.81	2.20	0.32	0.91	0.91	2.19	2.18	2.19	35
中期 (3-7)	580	97.18	97.31	4.69	0.49	1.10	1.09	4.62	4.59	4.62	38
長期 (7-)	267	96.54	96.79	8.36	0.91	1.40	1.38	8.03	7.98	8.03	43
長期 (7-11)	267	96.54	96.79	8.36	0.91	1.40	1.38	8.03	7.98	8.03	43
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
電気機器	1,940	97.96	98.09	4.21	0.55	1.08	1.07	4.11	4.08	4.11	39
短期 (1-3)	760	98.85	98.93	2.23	0.37	0.90	0.90	2.21	2.20	2.21	34
中期 (3-7)	935	97.40	97.54	4.67	0.56	1.12	1.11	4.60	4.57	4.60	40
長期 (7-)	245	97.29	97.60	8.59	1.10	1.47	1.45	8.19	8.13	8.19	48
長期 (7-11)	245	97.29	97.60	8.59	1.10	1.47	1.45	8.19	8.13	8.19	48
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
輸送用機器	1,097	97.06	97.16	4.43	0.42	1.07	1.05	4.22	4.20	4.22	36
短期 (1-3)	505	98.83	98.87	1.88	0.21	0.86	0.86	1.87	1.86	1.87	32
中期 (3-7)	383	97.29	97.40	4.61	0.47	1.06	1.05	4.54	4.52	4.54	35
長期 (7-)	209	92.35	92.56	10.24	0.81	1.63	1.56	9.68	9.60	9.67	45
長期 (7-11)	119	96.64	96.83	8.46	0.92	1.39	1.37	8.12	8.07	8.12	41
超長期 (11-)	90	86.69	86.91	12.60	0.67	1.98	1.85	11.97	11.86	11.95	51

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12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	259	97.27	97.40	4.39	0.66	1.32	1.30	4.28	4.25	4.27	61
短期 (1-3)	70	99.02	99.09	2.04	0.43	0.98	0.97	2.04	2.03	2.04	42
中期 (3-7)	154	96.81	96.96	4.66	0.70	1.42	1.40	4.57	4.54	4.57	69
長期 (7-)	35	95.81	95.99	7.88	0.97	1.58	1.55	7.57	7.51	7.57	65
長期 (7-11)	35	95.81	95.99	7.88	0.97	1.58	1.55	7.57	7.51	7.57	65
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
その他製品	180	94.34	94.46	6.97	0.52	1.27	1.23	6.52	6.47	6.51	35
短期 (1-3)	15	98.40	98.41	2.10	0.20	0.99	0.98	2.10	2.09	2.10	42
中期 (3-7)	120	97.41	97.51	4.94	0.52	1.07	1.06	4.87	4.84	4.87	34
長期 (7-)	45	84.80	85.00	14.02	0.63	2.00	1.84	13.28	13.15	13.26	38
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	45	84.80	85.00	14.02	0.63	2.00	1.84	13.28	13.15	13.26	38
電気・ガス業	12,360	94.38	94.58	8.05	0.83	1.45	1.40	7.04	6.97	7.01	48
短期 (1-3)	2,664	99.19	99.29	2.05	0.48	0.88	0.88	2.04	2.03	2.04	33
中期 (3-7)	4,273	97.66	97.84	4.94	0.74	1.21	1.20	4.83	4.80	4.83	49
長期 (7-)	5,424	89.43	89.69	13.44	1.07	1.97	1.86	11.65	11.53	11.60	56
長期 (7-11)	2,534	96.38	96.64	8.68	1.09	1.57	1.54	8.25	8.19	8.25	57
超長期 (11-)	2,890	83.34	83.59	17.62	1.06	2.38	2.17	15.09	14.92	14.99	56
陸運業	6,506	88.76	89.04	13.91	1.03	1.67	1.53	10.39	10.28	10.25	35
短期 (1-3)	784	100.48	100.72	2.02	0.99	0.81	0.81	2.00	1.99	2.00	27
中期 (3-7)	1,745	99.75	100.02	5.02	1.04	1.05	1.05	4.88	4.85	4.88	33
長期 (7-)	3,977	81.63	81.92	20.15	1.04	2.21	1.97	15.37	15.20	15.13	38
長期 (7-11)	1,039	98.80	99.13	8.75	1.19	1.35	1.34	8.29	8.24	8.29	36
超長期 (11-)	2,938	75.56	75.83	24.18	0.98	2.61	2.26	18.64	18.42	18.30	39
海運業	169	98.52	98.74	4.83	0.92	1.21	1.20	4.67	4.64	4.67	48
短期 (1-3)	20	100.74	100.82	1.53	1.46	0.92	0.93	1.51	1.51	1.51	41
中期 (3-7)	119	98.62	98.85	4.31	0.77	1.17	1.16	4.23	4.21	4.23	48
長期 (7-)	30	96.65	96.91	9.08	1.14	1.56	1.54	8.62	8.56	8.62	53
長期 (7-11)	30	96.65	96.91	9.08	1.14	1.56	1.54	8.62	8.56	8.62	53
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
空運業	315	93.59	93.70	7.80	0.98	1.80	1.73	7.03	6.96	7.02	79
短期 (1-3)	90	99.18	99.28	1.62	0.65	1.17	1.17	1.62	1.61	1.62	64
中期 (3-7)	40	95.61	95.67	4.35	0.36	1.41	1.38	4.31	4.28	4.31	70
長期 (7-)	185	90.43	90.56	11.55	1.28	2.23	2.11	10.54	10.42	10.52	90
長期 (7-11)	85	98.25	98.38	9.18	1.53	1.76	1.75	8.57	8.50	8.57	73
超長期 (11-)	100	83.78	83.90	13.57	1.07	2.70	2.48	12.50	12.34	12.47	107
倉庫・運輸関連業	122	94.95	95.10	6.65	0.63	1.38	1.34	6.27	6.22	6.26	50
短期 (1-3)	18	99.00	99.19	2.78	0.68	1.04	1.03	2.76	2.74	2.76	44
中期 (3-7)	67	96.37	96.48	4.89	0.45	1.24	1.22	4.82	4.79	4.82	51
長期 (7-)	37	90.33	90.56	11.79	0.93	1.84	1.74	10.98	10.88	10.97	50
長期 (7-11)	17	97.35	97.69	9.01	1.18	1.51	1.49	8.54	8.47	8.53	49
超長期 (11-)	20	84.55	84.68	14.08	0.72	2.15	1.98	13.30	13.17	13.28	51
情報・通信業	2,394	96.84	97.10	4.55	0.95	1.59	1.56	4.24	4.20	4.24	86
短期 (1-3)	921	99.07	99.28	2.05	0.76	1.24	1.24	2.03	2.02	2.03	69
中期 (3-7)	1,115	97.07	97.33	4.69	0.94	1.59	1.56	4.57	4.53	4.57	86
長期 (7-)	358	90.37	90.80	10.59	1.50	2.59	2.43	9.38	9.26	9.36	132
長期 (7-11)	240	95.17	95.64	8.84	1.40	2.06	2.00	8.29	8.21	8.29	101
超長期 (11-)	118	80.56	80.90	14.15	1.73	3.87	3.49	12.01	11.80	11.95	208
卸売業	1,282	97.20	97.44	6.30	0.90	1.27	1.25	5.94	5.90	5.93	43
短期 (1-3)	143	99.90	100.11	2.06	0.89	0.95	0.95	2.04	2.03	2.04	40
中期 (3-7)	687	98.77	99.02	4.60	0.84	1.13	1.12	4.50	4.48	4.50	43
長期 (7-)	452	93.96	94.20	10.22	0.99	1.60	1.54	9.54	9.46	9.53	44
長期 (7-11)	307	97.55	97.77	8.52	1.07	1.39	1.38	8.13	8.08	8.13	42
超長期 (11-)	145	86.37	86.66	13.82	0.82	2.09	1.95	12.90	12.77	12.87	51

出所:NFRC

- 東証 33 業種分類を参考に NFRC で分類

事業債 業種別・ポートフォリオ指標 (3/4) (2024年12月末、1月ポートフォリオ)

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
精密機器	259	97.27	97.40	4.39	0.66	1.32	1.30	4.28	4.25	4.27	61
短期 (1-3)	70	99.02	99.09	2.04	0.43	0.98	0.97	2.04	2.03	2.04	42
中期 (3-7)	154	96.81	96.96	4.66	0.70	1.42	1.40	4.57	4.54	4.57	69
長期 (7-)	35	95.81	95.99	7.88	0.97	1.58	1.55	7.57	7.51	7.57	65
長期 (7-11)	35	95.81	95.99	7.88	0.97	1.58	1.55	7.57	7.51	7.57	65
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
その他製品	180	94.34	94.46	6.97	0.52	1.27	1.23	6.52	6.47	6.51	35
短期 (1-3)	15	98.40	98.41	2.10	0.20	0.99	0.98	2.10	2.09	2.10	42
中期 (3-7)	120	97.41	97.51	4.94	0.52	1.07	1.06	4.87	4.84	4.87	34
長期 (7-)	45	84.80	85.00	14.02	0.63	2.00	1.84	13.28	13.15	13.26	38
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	45	84.80	85.00	14.02	0.63	2.00	1.84	13.28	13.15	13.26	38
電気・ガス業	12,256	94.33	94.53	8.13	0.84	1.46	1.41	7.12	7.05	7.09	49
短期 (1-3)	2,601	99.16	99.26	2.14	0.49	0.90	0.90	2.13	2.12	2.13	34
中期 (3-7)	4,242	97.59	97.77	5.00	0.74	1.22	1.20	4.89	4.86	4.89	49
長期 (7-)	5,414	89.46	89.71	13.47	1.08	1.97	1.86	11.66	11.55	11.61	56
長期 (7-11)	2,524	96.46	96.72	8.71	1.10	1.57	1.55	8.27	8.21	8.27	57
超長期 (11-)	2,890	83.34	83.59	17.62	1.06	2.38	2.17	15.09	14.92	14.99	56
陸運業	6,491	88.74	89.01	13.95	1.03	1.67	1.54	10.43	10.33	10.30	35
短期 (1-3)	784	100.45	100.69	2.11	0.98	0.82	0.82	2.09	2.08	2.09	27
中期 (3-7)	1,765	99.64	99.90	5.11	1.03	1.06	1.05	4.97	4.94	4.97	33
長期 (7-)	3,942	81.53	81.81	20.27	1.04	2.22	1.98	15.46	15.29	15.22	38
長期 (7-11)	1,034	98.88	99.21	8.91	1.22	1.36	1.35	8.42	8.36	8.42	35
超長期 (11-)	2,908	75.36	75.63	24.31	0.98	2.62	2.27	18.75	18.52	18.40	39
海運業	169	98.52	98.74	4.83	0.92	1.21	1.20	4.67	4.64	4.67	48
短期 (1-3)	20	100.74	100.82	1.53	1.46	0.92	0.93	1.51	1.51	1.51	41
中期 (3-7)	119	98.62	98.85	4.31	0.77	1.17	1.16	4.23	4.21	4.23	48
長期 (7-)	30	96.65	96.91	9.08	1.14	1.56	1.54	8.62	8.56	8.62	53
長期 (7-11)	30	96.65	96.91	9.08	1.14	1.56	1.54	8.62	8.56	8.62	53
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
空運業	315	93.59	93.70	7.80	0.98	1.80	1.73	7.03	6.96	7.02	79
短期 (1-3)	90	99.18	99.28	1.62	0.65	1.17	1.17	1.62	1.61	1.62	64
中期 (3-7)	40	95.61	95.67	4.35	0.36	1.41	1.38	4.31	4.28	4.31	70
長期 (7-)	185	90.43	90.56	11.55	1.28	2.23	2.11	10.54	10.42	10.52	90
長期 (7-11)	85	98.25	98.38	9.18	1.53	1.76	1.75	8.57	8.50	8.57	73
超長期 (11-)	100	83.78	83.90	13.57	1.07	2.70	2.48	12.50	12.34	12.47	107
倉庫・運輸関連業	122	94.95	95.10	6.65	0.63	1.38	1.34	6.27	6.22	6.26	50
短期 (1-3)	18	99.00	99.19	2.78	0.68	1.04	1.03	2.76	2.74	2.76	44
中期 (3-7)	67	96.37	96.48	4.89	0.45	1.24	1.22	4.82	4.79	4.82	51
長期 (7-)	37	90.33	90.56	11.79	0.93	1.84	1.74	10.98	10.88	10.97	50
長期 (7-11)	17	97.35	97.69	9.01	1.18	1.51	1.49	8.54	8.47	8.53	49
超長期 (11-)	20	84.55	84.68	14.08	0.72	2.15	1.98	13.30	13.17	13.28	51
情報・通信業	2,394	96.84	97.10	4.55	0.95	1.59	1.56	4.24	4.20	4.24	86
短期 (1-3)	921	99.07	99.28	2.05	0.76	1.24	1.24	2.03	2.02	2.03	69
中期 (3-7)	1,130	97.01	97.27	4.72	0.94	1.59	1.57	4.60	4.56	4.60	86
長期 (7-)	343	90.27	90.71	10.74	1.54	2.62	2.47	9.49	9.37	9.47	134
長期 (7-11)	225	95.34	95.83	8.96	1.45	2.07	2.01	8.38	8.30	8.38	102
超長期 (11-)	118	80.56	80.90	14.15	1.73	3.87	3.49	12.01	11.80	11.95	208
卸売業	1,307	97.25	97.49	6.30	0.91	1.27	1.25	5.94	5.89	5.93	43
短期 (1-3)	148	99.87	100.07	2.04	0.88	0.95	0.95	2.02	2.01	2.02	40
中期 (3-7)	697	98.79	99.03	4.61	0.84	1.13	1.12	4.51	4.48	4.51	42
長期 (7-)	462	94.09	94.33	10.21	1.01	1.60	1.55	9.53	9.45	9.52	45
長期 (7-11)	317	97.63	97.84	8.56	1.09	1.40	1.39	8.16	8.11	8.16	42
超長期 (11-)	145	86.37	86.66	13.82	0.82	2.09	1.95	12.90	12.77	12.87	51

出所:NFRC

- 東証 33 業種分類を参考に NFRC で分類

事業債 業種別・ポートフォリオ指標 (4/4) (2024年12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	1,020	97.63	97.79	4.44	0.68	1.24	1.22	4.27	4.24	4.26	52
短期 (1-3)	310	98.69	98.76	2.06	0.36	1.00	0.99	2.05	2.04	2.05	44
中期 (3-7)	559	97.89	98.06	4.25	0.69	1.20	1.19	4.18	4.15	4.18	51
長期 (7-)	151	94.53	94.80	10.03	1.28	1.88	1.84	9.34	9.26	9.33	75
長期 (7-11)	111	96.72	97.08	8.80	1.42	1.86	1.83	8.26	8.19	8.26	85
超長期 (11-)	40	88.47	88.50	13.43	0.88	1.97	1.85	12.63	12.51	12.61	44
銀行業	1,415	99.73	99.98	3.49	1.22	1.22	1.22	3.39	3.36	3.39	59
短期 (1-3)	654	100.41	100.68	1.83	1.40	1.12	1.13	1.80	1.79	1.80	59
中期 (3-7)	713	99.20	99.42	4.63	1.05	1.28	1.28	4.51	4.48	4.51	58
長期 (7-)	48	98.19	98.62	9.06	1.32	1.57	1.55	8.52	8.45	8.51	55
長期 (7-11)	48	98.19	98.62	9.06	1.32	1.57	1.55	8.52	8.45	8.51	55
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
証券、商品先物取引業	860	98.98	99.14	2.33	0.77	1.24	1.23	2.30	2.29	2.30	66
短期 (1-3)	626	99.13	99.28	1.80	0.69	1.19	1.19	1.79	1.78	1.79	65
中期 (3-7)	229	98.67	98.85	3.69	0.98	1.36	1.35	3.62	3.60	3.62	70
長期 (7-)	5	94.12	94.41	7.68	0.90	1.77	1.72	7.40	7.34	7.40	84
長期 (7-11)	5	94.12	94.41	7.68	0.90	1.77	1.72	7.40	7.34	7.40	84
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
保険業	330	97.96	98.03	3.24	0.38	1.04	1.03	3.17	3.15	3.17	41
短期 (1-3)	210	98.61	98.65	2.12	0.26	0.94	0.93	2.12	2.11	2.12	38
中期 (3-7)	70	98.21	98.30	3.32	0.48	1.04	1.03	3.30	3.28	3.30	40
長期 (7-)	50	94.86	95.02	7.79	0.75	1.49	1.45	7.56	7.51	7.56	56
長期 (7-11)	50	94.86	95.02	7.79	0.75	1.49	1.45	7.56	7.51	7.56	56
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
その他金融業	6,673	98.06	98.17	3.99	0.56	1.08	1.07	3.88	3.86	3.88	40
短期 (1-3)	2,787	98.96	99.04	1.96	0.38	0.94	0.93	1.95	1.94	1.95	39
中期 (3-7)	3,226	97.69	97.81	4.64	0.61	1.11	1.10	4.56	4.53	4.56	40
長期 (7-)	660	96.06	96.26	9.44	1.10	1.55	1.51	8.88	8.81	8.88	48
長期 (7-11)	582	97.49	97.69	8.85	1.12	1.45	1.44	8.42	8.36	8.42	45
超長期 (11-)	78	85.40	85.56	13.86	0.96	2.34	2.16	12.81	12.67	12.78	73
不動産業	2,640	94.74	94.93	7.36	0.75	1.37	1.33	6.37	6.31	6.34	47
短期 (1-3)	556	99.33	99.48	2.06	0.56	0.94	0.94	2.05	2.04	2.05	39
中期 (3-7)	1,110	97.27	97.43	4.63	0.59	1.18	1.17	4.55	4.53	4.55	47
長期 (7-)	975	89.25	89.48	13.50	1.03	1.89	1.77	11.35	11.24	11.28	51
長期 (7-11)	507	97.04	97.24	8.47	1.06	1.44	1.42	8.09	8.04	8.09	46
超長期 (11-)	468	80.81	81.08	18.94	1.00	2.47	2.22	15.57	15.40	15.41	57
サービス業	881	93.12	93.27	5.39	0.73	1.99	1.87	5.00	4.95	5.00	113
短期 (1-3)	241	97.85	97.91	2.03	0.39	1.52	1.51	2.02	2.00	2.02	96
中期 (3-7)	455	94.64	94.81	5.26	0.71	1.73	1.66	5.10	5.06	5.10	93
長期 (7-)	185	83.22	83.43	10.09	1.22	3.41	3.02	9.30	9.16	9.28	193
長期 (7-11)	135	88.21	88.45	9.19	1.13	2.76	2.52	8.70	8.60	8.70	150
超長期 (11-)	50	69.74	69.88	12.50	1.45	5.65	4.73	11.32	11.07	11.29	341
財投機関債	20,011	95.36	95.57	9.03	0.81	1.20	1.16	7.51	7.45	7.46	19
短期 (1-3)	5,654	99.49	99.61	1.97	0.42	0.71	0.71	1.96	1.96	1.96	17
中期 (3-7)	6,239	99.18	99.37	4.60	0.71	0.88	0.88	4.52	4.50	4.52	18
長期 (7-)	8,117	89.54	89.84	17.35	1.17	1.85	1.74	14.34	14.20	14.22	21
長期 (7-11)	2,443	99.62	99.89	8.89	1.14	1.19	1.19	8.44	8.39	8.43	19
超長期 (11-)	5,674	85.20	85.51	20.99	1.18	2.18	2.01	17.31	17.13	17.13	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12月末、1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	1,020	97.63	97.79	4.44	0.68	1.24	1.22	4.27	4.24	4.26	52
短期 (1-3)	310	98.69	98.76	2.06	0.36	1.00	0.99	2.05	2.04	2.05	44
中期 (3-7)	559	97.89	98.06	4.25	0.69	1.20	1.19	4.18	4.15	4.18	51
長期 (7-)	151	94.53	94.80	10.03	1.28	1.88	1.84	9.34	9.26	9.33	75
長期 (7-11)	111	96.72	97.08	8.80	1.42	1.86	1.83	8.26	8.19	8.26	85
超長期 (11-)	40	88.47	88.50	13.43	0.88	1.97	1.85	12.63	12.51	12.61	44
銀行業	1,355	99.69	99.92	3.59	1.20	1.23	1.23	3.49	3.47	3.49	59
短期 (1-3)	604	100.37	100.60	1.92	1.36	1.13	1.14	1.90	1.89	1.90	59
中期 (3-7)	703	99.20	99.42	4.66	1.06	1.29	1.29	4.53	4.51	4.53	58
長期 (7-)	48	98.19	98.62	9.06	1.32	1.57	1.55	8.52	8.45	8.51	55
長期 (7-11)	48	98.19	98.62	9.06	1.32	1.57	1.55	8.52	8.45	8.51	55
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
証券、商品先物取引業	860	98.98	99.14	2.33	0.77	1.24	1.23	2.30	2.29	2.30	66
短期 (1-3)	626	99.13	99.28	1.80	0.69	1.19	1.19	1.79	1.78	1.79	65
中期 (3-7)	229	98.67	98.85	3.69	0.98	1.36	1.35	3.62	3.60	3.62	70
長期 (7-)	5	94.12	94.41	7.68	0.90	1.77	1.72	7.40	7.34	7.40	84
長期 (7-11)	5	94.12	94.41	7.68	0.90	1.77	1.72	7.40	7.34	7.40	84
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
保険業	335	97.98	98.05	3.26	0.39	1.04	1.03	3.19	3.17	3.19	41
短期 (1-3)	210	98.61	98.65	2.12	0.26	0.94	0.93	2.12	2.11	2.12	38
中期 (3-7)	75	98.29	98.38	3.42	0.51	1.04	1.03	3.39	3.38	3.39	40
長期 (7-)	50	94.86	95.02	7.79	0.75	1.49	1.45	7.56	7.51	7.56	56
長期 (7-11)	50	94.86	95.02	7.79	0.75	1.49	1.45	7.56	7.51	7.56	56
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
その他金融業	6,613	98.05	98.16	4.04	0.57	1.08	1.07	3.92	3.90	3.92	40
短期 (1-3)	2,744	98.94	99.02	2.01	0.39	0.94	0.94	2.00	1.99	2.00	39
中期 (3-7)	3,229	97.68	97.80	4.68	0.62	1.12	1.10	4.59	4.57	4.59	40
長期 (7-)	640	96.15	96.35	9.52	1.12	1.54	1.51	8.94	8.87	8.93	47
長期 (7-11)	562	97.64	97.84	8.91	1.14	1.45	1.43	8.47	8.41	8.47	44
超長期 (11-)	78	85.40	85.56	13.86	0.96	2.34	2.16	12.81	12.67	12.78	73
不動産業	2,630	94.72	94.91	7.39	0.75	1.38	1.33	6.39	6.33	6.36	47
短期 (1-3)	546	99.32	99.47	2.08	0.56	0.94	0.94	2.06	2.05	2.06	39
中期 (3-7)	1,110	97.27	97.43	4.63	0.59	1.18	1.17	4.55	4.53	4.55	47
長期 (7-)	975	89.25	89.48	13.50	1.03	1.89	1.77	11.35	11.24	11.28	51
長期 (7-11)	507	97.04	97.24	8.47	1.06	1.44	1.42	8.09	8.04	8.09	46
超長期 (11-)	468	80.81	81.08	18.94	1.00	2.47	2.22	15.57	15.40	15.41	57
サービス業	871	93.04	93.19	5.44	0.73	2.00	1.89	5.05	5.00	5.05	114
短期 (1-3)	231	97.78	97.84	2.07	0.40	1.56	1.54	2.06	2.05	2.06	99
中期 (3-7)	455	94.64	94.81	5.26	0.71	1.73	1.66	5.10	5.06	5.10	93
長期 (7-)	185	83.22	83.43	10.09	1.22	3.41	3.02	9.30	9.16	9.28	193
長期 (7-11)	135	88.21	88.45	9.19	1.13	2.76	2.52	8.70	8.60	8.70	150
超長期 (11-)	50	69.74	69.88	12.50	1.45	5.65	4.73	11.32	11.07	11.29	341
財投機関債	20,229	95.40	95.61	8.99	0.82	1.20	1.15	7.49	7.43	7.44	19
短期 (1-3)	5,813	99.49	99.60	2.00	0.43	0.72	0.72	1.99	1.99	1.99	17
中期 (3-7)	6,334	99.14	99.33	4.66	0.71	0.89	0.88	4.57	4.55	4.57	18
長期 (7-)	8,082	89.54	89.84	17.42	1.18	1.85	1.74	14.40	14.26	14.27	21
長期 (7-11)	2,403	99.75	100.03	8.96	1.17	1.19	1.19	8.49	8.44	8.48	19
超長期 (11-)	5,679	85.22	85.52	21.00	1.18	2.18	2.01	17.32	17.14	17.14	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12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	52,764	95.12	95.31	7.96	0.76	1.25	1.20	6.63	6.58	6.59	31
短期 (1-3)	15,420	99.32	99.44	2.03	0.48	0.84	0.83	2.02	2.01	2.02	29
中期 (3-7)	19,163	98.38	98.55	4.70	0.69	1.03	1.03	4.61	4.58	4.61	32
長期 (7-)	18,181	88.12	88.38	16.43	1.07	1.90	1.76	13.41	13.28	13.29	33
長期 (7-11)	7,076	97.94	98.19	8.70	1.06	1.33	1.32	8.30	8.24	8.29	34
超長期 (11-)	11,106	81.86	82.14	21.35	1.08	2.32	2.10	17.31	17.12	17.10	32
AAA~A 格	73,588	95.51	95.70	7.23	0.78	1.30	1.26	6.17	6.12	6.14	41
短期 (1-3)	22,344	99.23	99.35	2.02	0.53	0.93	0.92	2.01	2.00	2.01	38
中期 (3-7)	27,939	98.05	98.22	4.68	0.71	1.13	1.12	4.59	4.56	4.59	42
長期 (7-)	23,305	88.88	89.16	15.30	1.10	1.93	1.81	12.70	12.57	12.60	43
長期 (7-11)	9,838	97.51	97.78	8.70	1.12	1.45	1.43	8.27	8.21	8.27	45
超長期 (11-)	13,467	82.58	82.86	20.12	1.09	2.35	2.14	16.52	16.34	16.34	41
AAA~BBB 格	73,588	95.51	95.70	7.23	0.78	1.30	1.26	6.17	6.12	6.14	41
短期 (1-3)	22,344	99.23	99.35	2.02	0.53	0.93	0.92	2.01	2.00	2.01	38
中期 (3-7)	27,939	98.05	98.22	4.68	0.71	1.13	1.12	4.59	4.56	4.59	42
長期 (7-)	23,305	88.88	89.16	15.30	1.10	1.93	1.81	12.70	12.57	12.60	43
長期 (7-11)	9,838	97.51	97.78	8.70	1.12	1.45	1.43	8.27	8.21	8.27	45
超長期 (11-)	13,467	82.58	82.86	20.12	1.09	2.35	2.14	16.52	16.34	16.34	41
AAA~BB 格	73,588	95.51	95.70	7.23	0.78	1.30	1.26	6.17	6.12	6.14	41
短期 (1-3)	22,344	99.23	99.35	2.02	0.53	0.93	0.92	2.01	2.00	2.01	38
中期 (3-7)	27,939	98.05	98.22	4.68	0.71	1.13	1.12	4.59	4.56	4.59	42
長期 (7-)	23,305	88.88	89.16	15.30	1.10	1.93	1.81	12.70	12.57	12.60	43
長期 (7-11)	9,838	97.51	97.78	8.70	1.12	1.45	1.43	8.27	8.21	8.27	45
超長期 (11-)	13,467	82.58	82.86	20.12	1.09	2.35	2.14	16.52	16.34	16.34	41
AAA 格	11,669	96.72	96.82	5.50	0.48	0.98	0.95	4.74	4.71	4.72	22
短期 (1-3)	4,525	99.03	99.08	2.00	0.23	0.74	0.74	1.99	1.98	1.99	19
中期 (3-7)	5,157	98.05	98.16	4.60	0.51	0.93	0.92	4.54	4.51	4.54	23
長期 (7-)	1,987	88.00	88.21	15.80	0.96	1.74	1.61	12.35	12.23	12.21	29
長期 (7-11)	1,185	97.12	97.30	8.65	0.91	1.29	1.28	8.31	8.26	8.31	30
超長期 (11-)	802	74.52	74.77	26.36	1.04	2.61	2.24	20.11	19.87	19.72	28
AA 格	41,095	94.66	94.88	8.66	0.84	1.33	1.28	7.18	7.12	7.14	34
短期 (1-3)	10,895	99.45	99.59	2.05	0.59	0.88	0.88	2.03	2.02	2.03	33
中期 (3-7)	14,006	98.50	98.69	4.73	0.76	1.07	1.06	4.64	4.61	4.64	36
長期 (7-)	16,194	88.13	88.40	16.51	1.09	1.91	1.78	13.55	13.41	13.43	33
長期 (7-11)	5,890	98.11	98.37	8.71	1.09	1.34	1.33	8.29	8.24	8.29	35
超長期 (11-)	10,304	82.43	82.71	20.96	1.09	2.30	2.09	17.12	16.93	16.92	32
A 格	20,824	96.48	96.68	5.39	0.83	1.44	1.41	5.00	4.96	5.00	65
短期 (1-3)	6,925	99.03	99.17	1.99	0.62	1.13	1.12	1.98	1.97	1.98	58
中期 (3-7)	8,776	97.32	97.52	4.64	0.77	1.35	1.33	4.54	4.51	4.54	63
長期 (7-)	5,124	91.61	91.90	11.28	1.21	2.05	1.96	10.26	10.16	10.24	77
長期 (7-11)	2,762	96.42	96.73	8.69	1.25	1.74	1.70	8.20	8.13	8.20	73
超長期 (11-)	2,361	85.99	86.24	14.32	1.15	2.47	2.29	12.96	12.81	12.92	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12月末、1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	52,709	95.06	95.25	8.06	0.76	1.25	1.20	6.72	6.66	6.68	31
短期 (1-3)	15,153	99.32	99.43	2.06	0.47	0.83	0.83	2.05	2.04	2.05	27
中期 (3-7)	19,194	98.35	98.52	4.76	0.69	1.03	1.02	4.67	4.64	4.67	32
長期 (7-)	18,363	88.11	88.38	16.45	1.08	1.90	1.77	13.44	13.31	13.32	33
長期 (7-11)	7,107	98.00	98.25	8.77	1.08	1.34	1.33	8.35	8.29	8.34	34
超長期 (11-)	11,256	81.87	82.15	21.31	1.08	2.33	2.10	17.29	17.10	17.09	32
AAA~A 格	73,816	95.52	95.71	7.25	0.79	1.31	1.26	6.19	6.14	6.16	41
短期 (1-3)	22,503	99.22	99.34	2.06	0.53	0.93	0.93	2.05	2.04	2.05	38
中期 (3-7)	28,097	98.03	98.21	4.72	0.72	1.13	1.12	4.63	4.60	4.63	42
長期 (7-)	23,217	88.89	89.16	15.35	1.11	1.94	1.81	12.74	12.62	12.64	43
長期 (7-11)	9,761	97.59	97.85	8.75	1.13	1.45	1.43	8.31	8.25	8.31	45
超長期 (11-)	13,456	82.58	82.85	20.15	1.10	2.35	2.14	16.54	16.36	16.36	41
AAA~BBB 格	73,816	95.52	95.71	7.25	0.79	1.31	1.26	6.19	6.14	6.16	41
短期 (1-3)	22,503	99.22	99.34	2.06	0.53	0.93	0.93	2.05	2.04	2.05	38
中期 (3-7)	28,097	98.03	98.21	4.72	0.72	1.13	1.12	4.63	4.60	4.63	42
長期 (7-)	23,217	88.89	89.16	15.35	1.11	1.94	1.81	12.74	12.62	12.64	43
長期 (7-11)	9,761	97.59	97.85	8.75	1.13	1.45	1.43	8.31	8.25	8.31	45
超長期 (11-)	13,456	82.58	82.85	20.15	1.10	2.35	2.14	16.54	16.36	16.36	41
AAA~BB 格	73,816	95.52	95.71	7.25	0.79	1.31	1.26	6.19	6.14	6.16	41
短期 (1-3)	22,503	99.22	99.34	2.06	0.53	0.93	0.93	2.05	2.04	2.05	38
中期 (3-7)	28,097	98.03	98.21	4.72	0.72	1.13	1.12	4.63	4.60	4.63	42
長期 (7-)	23,217	88.89	89.16	15.35	1.11	1.94	1.81	12.74	12.62	12.64	43
長期 (7-11)	9,761	97.59	97.85	8.75	1.13	1.45	1.43	8.31	8.25	8.31	45
超長期 (11-)	13,456	82.58	82.85	20.15	1.10	2.35	2.14	16.54	16.36	16.36	41
AAA 格	11,855	96.77	96.87	5.49	0.48	0.98	0.95	4.73	4.70	4.71	22
短期 (1-3)	4,678	99.05	99.10	2.03	0.25	0.74	0.74	2.02	2.01	2.02	19
中期 (3-7)	5,227	98.03	98.15	4.66	0.51	0.94	0.93	4.59	4.57	4.59	23
長期 (7-)	1,951	87.91	88.12	16.00	0.98	1.76	1.62	12.48	12.36	12.34	30
長期 (7-11)	1,145	97.25	97.44	8.73	0.94	1.30	1.29	8.37	8.32	8.37	31
超長期 (11-)	805	74.62	74.87	26.34	1.05	2.61	2.24	20.09	19.85	19.70	28
AA 格	40,854	94.57	94.78	8.80	0.84	1.33	1.28	7.31	7.25	7.26	33
短期 (1-3)	10,475	99.44	99.58	2.07	0.58	0.87	0.86	2.06	2.05	2.06	31
中期 (3-7)	13,967	98.47	98.66	4.79	0.75	1.07	1.06	4.69	4.67	4.69	35
長期 (7-)	16,412	88.14	88.41	16.51	1.09	1.92	1.79	13.56	13.43	13.44	33
長期 (7-11)	5,962	98.14	98.40	8.77	1.10	1.34	1.33	8.34	8.29	8.34	35
超長期 (11-)	10,451	82.43	82.71	20.92	1.09	2.31	2.09	17.10	16.91	16.90	32
A 格	21,107	96.65	96.85	5.25	0.84	1.44	1.41	4.88	4.84	4.88	66
短期 (1-3)	7,350	99.02	99.17	2.06	0.65	1.16	1.15	2.05	2.03	2.05	60
中期 (3-7)	8,903	97.33	97.53	4.64	0.78	1.36	1.34	4.53	4.50	4.53	64
長期 (7-)	4,854	91.82	92.11	11.19	1.23	2.06	1.97	10.19	10.08	10.17	79
長期 (7-11)	2,654	96.49	96.81	8.70	1.28	1.75	1.71	8.20	8.13	8.20	74
超長期 (11-)	2,200	86.19	86.45	14.19	1.17	2.49	2.31	12.86	12.72	12.83	86
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 12 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	51,094	95.00	95.18	8.11	0.76	1.25	1.20	6.75	6.70	6.71	30
短期 (1-3)	14,455	99.33	99.44	2.02	0.46	0.82	0.82	2.01	2.00	2.01	27
中期 (3-7)	18,531	98.37	98.54	4.72	0.68	1.02	1.02	4.63	4.61	4.63	31
長期 (7-)	18,109	88.08	88.35	16.46	1.07	1.90	1.76	13.44	13.31	13.32	33
長期 (7-11)	7,007	97.94	98.19	8.70	1.06	1.33	1.32	8.30	8.24	8.29	34
超長期 (11-)	11,101	81.85	82.13	21.35	1.08	2.32	2.10	17.32	17.13	17.11	31
AAA ~ A 格	70,142	95.35	95.53	7.42	0.77	1.30	1.25	6.31	6.26	6.28	39
短期 (1-3)	20,371	99.23	99.34	2.00	0.48	0.89	0.89	1.99	1.98	1.99	34
中期 (3-7)	26,750	98.05	98.22	4.71	0.70	1.12	1.10	4.62	4.59	4.62	40
長期 (7-)	23,021	88.77	89.04	15.35	1.09	1.93	1.80	12.74	12.62	12.64	42
長期 (7-11)	9,672	97.51	97.78	8.70	1.11	1.44	1.42	8.27	8.22	8.27	44
超長期 (11-)	13,349	82.44	82.71	20.17	1.08	2.35	2.13	16.57	16.39	16.39	40
AAA ~ BBB 格	70,142	95.35	95.53	7.42	0.77	1.30	1.25	6.31	6.26	6.28	39
短期 (1-3)	20,371	99.23	99.34	2.00	0.48	0.89	0.89	1.99	1.98	1.99	34
中期 (3-7)	26,750	98.05	98.22	4.71	0.70	1.12	1.10	4.62	4.59	4.62	40
長期 (7-)	23,021	88.77	89.04	15.35	1.09	1.93	1.80	12.74	12.62	12.64	42
長期 (7-11)	9,672	97.51	97.78	8.70	1.11	1.44	1.42	8.27	8.22	8.27	44
超長期 (11-)	13,349	82.44	82.71	20.17	1.08	2.35	2.13	16.57	16.39	16.39	40
AAA ~ BB 格	70,142	95.35	95.53	7.42	0.77	1.30	1.25	6.31	6.26	6.28	39
短期 (1-3)	20,371	99.23	99.34	2.00	0.48	0.89	0.89	1.99	1.98	1.99	34
中期 (3-7)	26,750	98.05	98.22	4.71	0.70	1.12	1.10	4.62	4.59	4.62	40
長期 (7-)	23,021	88.77	89.04	15.35	1.09	1.93	1.80	12.74	12.62	12.64	42
長期 (7-11)	9,672	97.51	97.78	8.70	1.11	1.44	1.42	8.27	8.22	8.27	44
超長期 (11-)	13,349	82.44	82.71	20.17	1.08	2.35	2.13	16.57	16.39	16.39	40
AAA 格	11,669	96.72	96.82	5.50	0.48	0.98	0.95	4.74	4.71	4.72	22
短期 (1-3)	4,525	99.03	99.08	2.00	0.23	0.74	0.74	1.99	1.98	1.99	19
中期 (3-7)	5,157	98.05	98.16	4.60	0.51	0.93	0.92	4.54	4.51	4.54	23
長期 (7-)	1,987	88.00	88.21	15.80	0.96	1.74	1.61	12.35	12.23	12.21	29
長期 (7-11)	1,185	97.12	97.30	8.65	0.91	1.29	1.28	8.31	8.26	8.31	30
超長期 (11-)	802	74.52	74.77	26.36	1.04	2.61	2.24	20.11	19.87	19.72	28
AA 格	39,425	94.49	94.70	8.89	0.84	1.33	1.28	7.36	7.30	7.32	33
短期 (1-3)	9,931	99.47	99.60	2.03	0.57	0.85	0.85	2.01	2.00	2.01	30
中期 (3-7)	13,373	98.50	98.69	4.76	0.75	1.06	1.05	4.67	4.64	4.67	35
長期 (7-)	16,121	88.09	88.36	16.54	1.09	1.92	1.78	13.57	13.44	13.45	33
長期 (7-11)	5,822	98.11	98.37	8.71	1.09	1.34	1.32	8.30	8.24	8.29	35
超長期 (11-)	10,299	82.42	82.70	20.96	1.09	2.30	2.09	17.12	16.93	16.92	32
A 格	19,048	96.29	96.48	5.54	0.79	1.42	1.38	5.14	5.10	5.13	61
短期 (1-3)	5,916	98.99	99.11	1.97	0.53	1.07	1.06	1.95	1.94	1.95	52
中期 (3-7)	8,220	97.31	97.49	4.69	0.75	1.32	1.30	4.58	4.55	4.58	60
長期 (7-)	4,913	91.33	91.60	11.28	1.16	2.04	1.94	10.27	10.17	10.26	75
長期 (7-11)	2,665	96.38	96.68	8.69	1.23	1.72	1.68	8.21	8.14	8.21	71
超長期 (11-)	2,248	85.34	85.58	14.34	1.08	2.46	2.28	13.04	12.89	13.00	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12月末、1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	51,916	95.00	95.19	8.13	0.76	1.25	1.21	6.78	6.72	6.74	30
短期(1-3)	14,642	99.32	99.42	2.05	0.46	0.82	0.82	2.04	2.03	2.04	27
中期(3-7)	18,933	98.35	98.51	4.76	0.68	1.03	1.02	4.67	4.65	4.67	31
長期(7-)	18,341	88.10	88.37	16.46	1.08	1.90	1.77	13.45	13.32	13.33	33
長期(7-11)	7,089	98.00	98.25	8.77	1.08	1.34	1.32	8.35	8.30	8.35	34
超長期(11-)	11,252	81.87	82.15	21.31	1.08	2.33	2.10	17.30	17.11	17.09	32
AAA~A格	70,141	95.35	95.53	7.44	0.77	1.30	1.25	6.34	6.29	6.31	39
短期(1-3)	20,350	99.22	99.33	2.04	0.48	0.89	0.89	2.03	2.02	2.03	34
中期(3-7)	26,875	98.02	98.20	4.75	0.70	1.12	1.11	4.65	4.63	4.65	40
長期(7-)	22,916	88.77	89.04	15.41	1.10	1.93	1.81	12.78	12.66	12.68	42
長期(7-11)	9,592	97.59	97.85	8.75	1.12	1.44	1.42	8.31	8.25	8.31	44
超長期(11-)	13,324	82.42	82.69	20.20	1.08	2.35	2.13	16.59	16.41	16.41	40
AAA~BBB格	70,141	95.35	95.53	7.44	0.77	1.30	1.25	6.34	6.29	6.31	39
短期(1-3)	20,350	99.22	99.33	2.04	0.48	0.89	0.89	2.03	2.02	2.03	34
中期(3-7)	26,875	98.02	98.20	4.75	0.70	1.12	1.11	4.65	4.63	4.65	40
長期(7-)	22,916	88.77	89.04	15.41	1.10	1.93	1.81	12.78	12.66	12.68	42
長期(7-11)	9,592	97.59	97.85	8.75	1.12	1.44	1.42	8.31	8.25	8.31	44
超長期(11-)	13,324	82.42	82.69	20.20	1.08	2.35	2.13	16.59	16.41	16.41	40
AAA~BB格	70,141	95.35	95.53	7.44	0.77	1.30	1.25	6.34	6.29	6.31	39
短期(1-3)	20,350	99.22	99.33	2.04	0.48	0.89	0.89	2.03	2.02	2.03	34
中期(3-7)	26,875	98.02	98.20	4.75	0.70	1.12	1.11	4.65	4.63	4.65	40
長期(7-)	22,916	88.77	89.04	15.41	1.10	1.93	1.81	12.78	12.66	12.68	42
長期(7-11)	9,592	97.59	97.85	8.75	1.12	1.44	1.42	8.31	8.25	8.31	44
超長期(11-)	13,324	82.42	82.69	20.20	1.08	2.35	2.13	16.59	16.41	16.41	40
AAA格	11,855	96.77	96.87	5.49	0.48	0.98	0.95	4.73	4.70	4.71	22
短期(1-3)	4,678	99.05	99.10	2.03	0.25	0.74	0.74	2.02	2.01	2.02	19
中期(3-7)	5,227	98.03	98.15	4.66	0.51	0.94	0.93	4.59	4.57	4.59	23
長期(7-)	1,951	87.91	88.12	16.00	0.98	1.76	1.62	12.48	12.36	12.34	30
長期(7-11)	1,145	97.25	97.44	8.73	0.94	1.30	1.29	8.37	8.32	8.37	31
超長期(11-)	805	74.62	74.87	26.34	1.05	2.61	2.24	20.09	19.85	19.70	28
AA格	40,060	94.48	94.69	8.91	0.84	1.34	1.28	7.39	7.33	7.35	33
短期(1-3)	9,964	99.44	99.57	2.06	0.56	0.86	0.85	2.05	2.04	2.05	30
中期(3-7)	13,706	98.46	98.65	4.80	0.75	1.06	1.06	4.70	4.68	4.70	35
長期(7-)	16,390	88.13	88.40	16.52	1.09	1.92	1.79	13.57	13.43	13.45	33
長期(7-11)	5,944	98.14	98.40	8.77	1.10	1.34	1.33	8.35	8.29	8.34	35
超長期(11-)	10,446	82.42	82.71	20.93	1.09	2.31	2.09	17.10	16.91	16.91	32
A格	18,226	96.33	96.52	5.49	0.79	1.42	1.39	5.10	5.06	5.10	62
短期(1-3)	5,709	98.97	99.09	2.02	0.54	1.08	1.08	2.01	1.99	2.01	53
中期(3-7)	7,942	97.26	97.44	4.71	0.75	1.33	1.31	4.61	4.58	4.61	61
長期(7-)	4,575	91.43	91.71	11.16	1.18	2.05	1.95	10.20	10.10	10.18	77
長期(7-11)	2,503	96.42	96.73	8.69	1.25	1.73	1.69	8.21	8.14	8.20	72
超長期(11-)	2,072	85.40	85.65	14.15	1.08	2.48	2.29	12.91	12.77	12.88	84
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 12 月末)

	額面 (10 億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
AAA ~ AA 格	12,053	95.00	95.15	7.07	0.66	1.22	1.17	5.84	5.79	5.81	35
短期 (1-3)	3,801	99.19	99.28	2.04	0.45	0.86	0.86	2.03	2.02	2.03	31
中期 (3-7)	4,947	98.00	98.15	4.59	0.63	1.08	1.07	4.52	4.49	4.52	37
長期 (7-)	3,306	85.70	85.91	16.56	0.94	1.94	1.77	13.16	13.03	13.02	38
長期 (7-11)	1,450	96.78	97.00	8.65	0.95	1.38	1.36	8.29	8.23	8.29	39
超長期 (11-)	1,856	77.05	77.25	22.73	0.93	2.48	2.18	17.94	17.74	17.67	36
AAA ~ A 格	68,069	95.34	95.52	7.43	0.76	1.29	1.24	6.31	6.26	6.28	38
短期 (1-3)	20,038	99.24	99.35	2.00	0.48	0.89	0.88	1.99	1.98	1.99	34
中期 (3-7)	25,651	98.02	98.19	4.71	0.69	1.10	1.09	4.62	4.60	4.62	39
長期 (7-)	22,380	88.76	89.03	15.39	1.09	1.93	1.80	12.76	12.63	12.66	42
長期 (7-11)	9,387	97.54	97.81	8.70	1.11	1.44	1.42	8.28	8.22	8.27	44
超長期 (11-)	12,993	82.42	82.70	20.22	1.08	2.34	2.13	16.59	16.41	16.41	40
AAA ~ BBB 格	69,902	95.33	95.52	7.42	0.76	1.29	1.25	6.31	6.26	6.28	38
短期 (1-3)	20,371	99.23	99.34	2.00	0.48	0.89	0.89	1.99	1.98	1.99	34
中期 (3-7)	26,535	98.02	98.19	4.71	0.69	1.11	1.10	4.62	4.60	4.62	39
長期 (7-)	22,996	88.77	89.04	15.35	1.09	1.93	1.80	12.74	12.62	12.64	42
長期 (7-11)	9,672	97.51	97.78	8.70	1.11	1.44	1.42	8.27	8.22	8.27	44
超長期 (11-)	13,324	82.42	82.69	20.18	1.08	2.35	2.13	16.58	16.40	16.40	40
AAA ~ BB 格	70,142	95.35	95.53	7.42	0.77	1.30	1.25	6.31	6.26	6.28	39
短期 (1-3)	20,371	99.23	99.34	2.00	0.48	0.89	0.89	1.99	1.98	1.99	34
中期 (3-7)	26,750	98.05	98.22	4.71	0.70	1.12	1.10	4.62	4.59	4.62	40
長期 (7-)	23,021	88.77	89.04	15.35	1.09	1.93	1.80	12.74	12.62	12.64	42
長期 (7-11)	9,672	97.51	97.78	8.70	1.11	1.44	1.42	8.27	8.22	8.27	44
超長期 (11-)	13,349	82.44	82.71	20.17	1.08	2.35	2.13	16.57	16.39	16.39	40
AAA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA 格	12,053	95.00	95.15	7.07	0.66	1.22	1.17	5.84	5.79	5.81	35
短期 (1-3)	3,801	99.19	99.28	2.04	0.45	0.86	0.86	2.03	2.02	2.03	31
中期 (3-7)	4,947	98.00	98.15	4.59	0.63	1.08	1.07	4.52	4.49	4.52	37
長期 (7-)	3,306	85.70	85.91	16.56	0.94	1.94	1.77	13.16	13.03	13.02	38
長期 (7-11)	1,450	96.78	97.00	8.65	0.95	1.38	1.36	8.29	8.23	8.29	39
超長期 (11-)	1,856	77.05	77.25	22.73	0.93	2.48	2.18	17.94	17.74	17.67	36
A 格	56,015	95.41	95.60	7.50	0.78	1.30	1.26	6.41	6.36	6.38	39
短期 (1-3)	16,237	99.25	99.37	1.99	0.49	0.89	0.89	1.98	1.97	1.98	34
中期 (3-7)	20,705	98.03	98.21	4.74	0.70	1.11	1.10	4.65	4.62	4.65	39
長期 (7-)	19,074	89.29	89.57	15.19	1.12	1.92	1.80	12.69	12.57	12.60	42
長期 (7-11)	7,937	97.68	97.95	8.71	1.14	1.44	1.43	8.28	8.22	8.27	45
超長期 (11-)	11,137	83.32	83.60	19.80	1.10	2.32	2.12	16.38	16.20	16.21	40
BBB 格	1,834	95.07	95.25	7.29	0.79	1.43	1.38	6.45	6.40	6.43	51
短期 (1-3)	333	98.64	98.70	2.01	0.41	1.11	1.10	2.00	1.99	2.00	55
中期 (3-7)	884	98.02	98.20	4.63	0.76	1.21	1.20	4.53	4.50	4.53	50
長期 (7-)	617	88.91	89.15	13.95	1.03	1.96	1.84	12.14	12.02	12.08	50
長期 (7-11)	285	96.55	96.80	8.51	0.98	1.46	1.43	8.14	8.09	8.14	47
超長期 (11-)	332	82.35	82.59	18.62	1.07	2.46	2.24	16.16	15.98	16.05	52
BB 格	240	100.03	100.49	5.41	2.26	2.10	2.09	4.90	4.84	4.89	133
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	215	100.93	101.42	4.25	2.25	1.99	2.00	4.05	4.01	4.05	132
長期 (7-)	25	92.30	92.50	15.41	2.37	3.11	2.99	12.85	12.66	12.77	146
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	25	92.30	92.50	15.41	2.37	3.11	2.99	12.85	12.66	12.77	146
B 格以下	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
格付なし	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

出所:NFRC

- 格付は、格付会社 4 社の最低格付をもとに分類

事業債 最低格付別・ポートフォリオ指標 (2024年12月末、1月ポートフォリオ)

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
AAA~AA格	12,082	95.01	95.16	7.08	0.66	1.22	1.17	5.86	5.81	5.82	35
短期(1-3)	3,808	99.17	99.26	2.06	0.45	0.86	0.86	2.05	2.04	2.05	31
中期(3-7)	4,955	98.02	98.16	4.61	0.63	1.08	1.07	4.53	4.51	4.53	37
長期(7-)	3,319	85.76	85.97	16.54	0.94	1.93	1.77	13.15	13.02	13.01	37
長期(7-11)	1,460	96.80	97.02	8.66	0.96	1.38	1.36	8.30	8.24	8.29	39
超長期(11-)	1,859	77.09	77.29	22.73	0.94	2.48	2.18	17.94	17.73	17.67	36
AAA~A格	68,068	95.34	95.52	7.46	0.76	1.29	1.25	6.34	6.29	6.31	38
短期(1-3)	20,018	99.23	99.34	2.04	0.48	0.89	0.89	2.03	2.02	2.03	34
中期(3-7)	25,766	98.00	98.17	4.75	0.69	1.11	1.10	4.66	4.64	4.66	39
長期(7-)	22,284	88.76	89.03	15.44	1.10	1.93	1.80	12.80	12.67	12.70	42
長期(7-11)	9,317	97.62	97.88	8.75	1.13	1.44	1.42	8.32	8.26	8.31	44
超長期(11-)	12,967	82.40	82.68	20.25	1.08	2.35	2.13	16.61	16.43	16.43	40
AAA~BBB格	69,901	95.33	95.52	7.45	0.76	1.29	1.25	6.34	6.29	6.31	38
短期(1-3)	20,350	99.22	99.33	2.04	0.48	0.89	0.89	2.03	2.02	2.03	34
中期(3-7)	26,660	98.00	98.17	4.75	0.69	1.11	1.10	4.66	4.63	4.66	39
長期(7-)	22,891	88.76	89.03	15.41	1.10	1.93	1.80	12.78	12.66	12.68	42
長期(7-11)	9,592	97.59	97.85	8.75	1.12	1.44	1.42	8.31	8.25	8.31	44
超長期(11-)	13,299	82.40	82.67	20.21	1.08	2.35	2.13	16.60	16.42	16.42	40
AAA~BB格	70,141	95.35	95.53	7.44	0.77	1.30	1.25	6.34	6.29	6.31	39
短期(1-3)	20,350	99.22	99.33	2.04	0.48	0.89	0.89	2.03	2.02	2.03	34
中期(3-7)	26,875	98.02	98.20	4.75	0.70	1.12	1.11	4.65	4.63	4.65	40
長期(7-)	22,916	88.77	89.04	15.41	1.10	1.93	1.81	12.78	12.66	12.68	42
長期(7-11)	9,592	97.59	97.85	8.75	1.12	1.44	1.42	8.31	8.25	8.31	44
超長期(11-)	13,324	82.42	82.69	20.20	1.08	2.35	2.13	16.59	16.41	16.41	40
AAA格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA格	12,082	95.01	95.16	7.08	0.66	1.22	1.17	5.86	5.81	5.82	35
短期(1-3)	3,808	99.17	99.26	2.06	0.45	0.86	0.86	2.05	2.04	2.05	31
中期(3-7)	4,955	98.02	98.16	4.61	0.63	1.08	1.07	4.53	4.51	4.53	37
長期(7-)	3,319	85.76	85.97	16.54	0.94	1.93	1.77	13.15	13.02	13.01	37
長期(7-11)	1,460	96.80	97.02	8.66	0.96	1.38	1.36	8.30	8.24	8.29	39
超長期(11-)	1,859	77.09	77.29	22.73	0.94	2.48	2.18	17.94	17.73	17.67	36
A格	55,986	95.41	95.60	7.54	0.79	1.31	1.26	6.44	6.39	6.41	39
短期(1-3)	16,210	99.24	99.36	2.04	0.49	0.89	0.89	2.02	2.02	2.02	34
中期(3-7)	20,812	98.00	98.17	4.79	0.70	1.11	1.10	4.69	4.67	4.69	39
長期(7-)	18,965	89.29	89.57	15.25	1.13	1.93	1.81	12.74	12.61	12.64	42
長期(7-11)	7,857	97.77	98.04	8.77	1.16	1.45	1.43	8.32	8.26	8.32	45
超長期(11-)	11,108	83.29	83.58	19.83	1.11	2.33	2.12	16.40	16.22	16.23	40
BBB格	1,834	95.07	95.25	7.29	0.79	1.43	1.38	6.45	6.40	6.43	51
短期(1-3)	333	98.64	98.70	2.01	0.41	1.11	1.10	2.00	1.99	2.00	55
中期(3-7)	894	97.99	98.16	4.65	0.76	1.21	1.20	4.56	4.53	4.56	50
長期(7-)	607	88.81	89.05	14.06	1.04	1.97	1.84	12.23	12.11	12.17	50
長期(7-11)	275	96.61	96.86	8.56	1.00	1.46	1.44	8.19	8.13	8.18	47
超長期(11-)	332	82.35	82.59	18.62	1.07	2.46	2.24	16.16	15.98	16.05	52
BB格	240	100.03	100.49	5.41	2.26	2.10	2.09	4.90	4.84	4.89	133
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	215	100.93	101.42	4.25	2.25	1.99	2.00	4.05	4.01	4.05	132
長期(7-)	25	92.30	92.50	15.41	2.37	3.11	2.99	12.85	12.66	12.77	146
長期(7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期(11-)	25	92.30	92.50	15.41	2.37	3.11	2.99	12.85	12.66	12.77	146
B格以下	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
格付なし	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

出所:NFRC

- 格付は、格付会社4社の最低格付をもとに分類

事業債 R&I 格付別・ポートフォリオ指標 (2024年12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	41,934	94.87	95.07	8.55	0.79	1.25	1.20	7.01	6.95	6.97	28
短期 (1-3)	11,674	99.41	99.52	2.01	0.47	0.79	0.79	2.00	1.99	2.00	24
中期 (3-7)	14,567	98.73	98.91	4.67	0.72	0.99	0.98	4.58	4.56	4.58	28
長期 (7-)	15,694	87.91	88.19	17.02	1.10	1.90	1.76	13.75	13.61	13.61	30
長期 (7-11)	5,893	98.31	98.56	8.77	1.09	1.31	1.30	8.35	8.30	8.35	31
超長期 (11-)	9,801	81.66	81.96	21.97	1.11	2.33	2.10	17.65	17.45	17.42	29
AAA~A 格	64,326	95.26	95.45	7.62	0.77	1.28	1.24	6.44	6.39	6.41	36
短期 (1-3)	18,484	99.27	99.39	1.99	0.47	0.86	0.86	1.98	1.97	1.98	31
中期 (3-7)	23,957	98.21	98.39	4.70	0.70	1.08	1.07	4.61	4.58	4.61	37
長期 (7-)	21,885	88.64	88.91	15.58	1.09	1.93	1.80	12.88	12.76	12.78	41
長期 (7-11)	9,048	97.52	97.78	8.71	1.09	1.42	1.40	8.29	8.23	8.29	42
超長期 (11-)	12,837	82.37	82.66	20.42	1.09	2.35	2.13	16.71	16.53	16.53	39
AAA~BBB 格	64,507	95.26	95.45	7.61	0.77	1.29	1.24	6.43	6.38	6.40	37
短期 (1-3)	18,547	99.27	99.38	1.99	0.47	0.86	0.86	1.98	1.97	1.98	32
中期 (3-7)	24,075	98.20	98.38	4.70	0.70	1.09	1.08	4.60	4.58	4.60	38
長期 (7-)	21,885	88.64	88.91	15.58	1.09	1.93	1.80	12.88	12.76	12.78	41
長期 (7-11)	9,048	97.52	97.78	8.71	1.09	1.42	1.40	8.29	8.23	8.29	42
超長期 (11-)	12,837	82.37	82.66	20.42	1.09	2.35	2.13	16.71	16.53	16.53	39
AAA~BB 格	64,507	95.26	95.45	7.61	0.77	1.29	1.24	6.43	6.38	6.40	37
短期 (1-3)	18,547	99.27	99.38	1.99	0.47	0.86	0.86	1.98	1.97	1.98	32
中期 (3-7)	24,075	98.20	98.38	4.70	0.70	1.09	1.08	4.60	4.58	4.60	38
長期 (7-)	21,885	88.64	88.91	15.58	1.09	1.93	1.80	12.88	12.76	12.78	41
長期 (7-11)	9,048	97.52	97.78	8.71	1.09	1.42	1.40	8.29	8.23	8.29	42
超長期 (11-)	12,837	82.37	82.66	20.42	1.09	2.35	2.13	16.71	16.53	16.53	39
AAA 格	955	97.92	97.99	3.62	0.35	0.91	0.90	3.53	3.51	3.52	25
短期 (1-3)	485	98.96	99.00	1.93	0.22	0.79	0.78	1.92	1.91	1.92	24
中期 (3-7)	370	97.85	97.94	4.32	0.46	0.96	0.95	4.26	4.24	4.26	26
長期 (7-)	100	93.20	93.24	9.22	0.57	1.36	1.32	8.92	8.86	8.92	29
長期 (7-11)	70	95.52	95.57	8.13	0.62	1.23	1.21	7.93	7.89	7.93	28
超長期 (11-)	30	87.77	87.81	11.76	0.45	1.70	1.59	11.43	11.34	11.43	32
AA 格	40,979	94.80	95.00	8.67	0.80	1.26	1.20	7.10	7.04	7.05	28
短期 (1-3)	11,189	99.43	99.55	2.01	0.48	0.79	0.79	2.00	1.99	2.00	24
中期 (3-7)	14,197	98.75	98.94	4.68	0.72	0.99	0.98	4.59	4.57	4.59	28
長期 (7-)	15,594	87.88	88.16	17.07	1.10	1.90	1.77	13.78	13.64	13.64	30
長期 (7-11)	5,823	98.34	98.60	8.78	1.09	1.31	1.30	8.35	8.30	8.35	31
超長期 (11-)	9,771	81.64	81.94	22.01	1.11	2.33	2.10	17.67	17.47	17.44	29
A 格	22,391	95.98	96.16	5.88	0.72	1.35	1.32	5.39	5.35	5.38	53
短期 (1-3)	6,810	99.04	99.15	1.95	0.47	0.98	0.98	1.94	1.93	1.94	43
中期 (3-7)	9,390	97.40	97.57	4.73	0.68	1.23	1.22	4.64	4.61	4.64	51
長期 (7-)	6,191	90.47	90.72	11.94	1.07	1.99	1.89	10.76	10.65	10.73	67
長期 (7-11)	3,155	96.05	96.32	8.61	1.11	1.64	1.61	8.19	8.12	8.18	64
超長期 (11-)	3,036	84.67	84.91	15.40	1.04	2.40	2.22	13.80	13.64	13.74	70
BBB 格	181	96.61	96.78	3.60	1.03	2.05	2.01	3.49	3.46	3.49	137
短期 (1-3)	63	97.55	97.62	1.88	0.82	2.16	2.14	1.87	1.85	1.87	160
中期 (3-7)	118	96.11	96.34	4.52	1.13	1.98	1.93	4.37	4.32	4.37	124
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	5,636	96.31	96.45	5.20	0.74	1.41	1.37	4.89	4.85	4.89	63
短期 (1-3)	1,824	98.86	98.97	2.14	0.61	1.15	1.14	2.13	2.12	2.13	59
中期 (3-7)	2,676	96.67	96.81	4.82	0.68	1.37	1.34	4.72	4.69	4.72	63
長期 (7-)	1,136	91.37	91.58	10.98	1.10	1.96	1.84	10.11	10.01	10.10	68
長期 (7-11)	624	97.42	97.68	8.48	1.30	1.66	1.61	8.01	7.94	8.00	66
超長期 (11-)	512	83.99	84.15	14.03	0.85	2.39	2.17	13.08	12.94	13.05	72

出所:NFRC

- 格付は、R&Iの格付をもとに NFRC で分類

事業債 R&I 格付別・ポートフォリオ指標 (2024年12月末、1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	42,013	94.88	95.08	8.57	0.79	1.25	1.20	7.03	6.97	6.98	28
短期 (1-3)	11,729	99.40	99.51	2.05	0.47	0.79	0.79	2.04	2.03	2.04	24
中期 (3-7)	14,655	98.71	98.89	4.72	0.72	0.99	0.99	4.63	4.60	4.63	28
長期 (7-)	15,628	87.90	88.18	17.07	1.11	1.90	1.77	13.79	13.65	13.65	30
長期 (7-11)	5,853	98.37	98.63	8.82	1.10	1.31	1.30	8.39	8.34	8.39	31
超長期 (11-)	9,776	81.63	81.93	22.01	1.11	2.33	2.10	17.68	17.48	17.45	29
AAA~A 格	64,275	95.25	95.44	7.65	0.77	1.29	1.24	6.48	6.42	6.44	36
短期 (1-3)	18,437	99.26	99.37	2.03	0.47	0.86	0.86	2.02	2.01	2.02	31
中期 (3-7)	24,059	98.18	98.36	4.74	0.70	1.09	1.08	4.65	4.62	4.65	37
長期 (7-)	21,780	88.63	88.90	15.64	1.10	1.93	1.80	12.93	12.80	12.82	40
長期 (7-11)	8,968	97.60	97.86	8.76	1.11	1.42	1.41	8.33	8.28	8.33	42
超長期 (11-)	12,812	82.35	82.63	20.45	1.09	2.35	2.13	16.73	16.55	16.55	39
AAA~BBB 格	64,456	95.26	95.45	7.64	0.77	1.29	1.24	6.47	6.41	6.43	37
短期 (1-3)	18,499	99.25	99.36	2.03	0.47	0.87	0.86	2.02	2.01	2.02	31
中期 (3-7)	24,177	98.17	98.35	4.74	0.71	1.09	1.08	4.65	4.62	4.65	38
長期 (7-)	21,780	88.63	88.90	15.64	1.10	1.93	1.80	12.93	12.80	12.82	40
長期 (7-11)	8,968	97.60	97.86	8.76	1.11	1.42	1.41	8.33	8.28	8.33	42
超長期 (11-)	12,812	82.35	82.63	20.45	1.09	2.35	2.13	16.73	16.55	16.55	39
AAA~BB 格	64,456	95.26	95.45	7.64	0.77	1.29	1.24	6.47	6.41	6.43	37
短期 (1-3)	18,499	99.25	99.36	2.03	0.47	0.87	0.86	2.02	2.01	2.02	31
中期 (3-7)	24,177	98.17	98.35	4.74	0.71	1.09	1.08	4.65	4.62	4.65	38
長期 (7-)	21,780	88.63	88.90	15.64	1.10	1.93	1.80	12.93	12.80	12.82	40
長期 (7-11)	8,968	97.60	97.86	8.76	1.11	1.42	1.41	8.33	8.28	8.33	42
超長期 (11-)	12,812	82.35	82.63	20.45	1.09	2.35	2.13	16.73	16.55	16.55	39
AAA 格	955	97.92	97.99	3.62	0.35	0.91	0.90	3.53	3.51	3.52	25
短期 (1-3)	485	98.96	99.00	1.93	0.22	0.79	0.78	1.92	1.91	1.92	24
中期 (3-7)	370	97.85	97.94	4.32	0.46	0.96	0.95	4.26	4.24	4.26	26
長期 (7-)	100	93.20	93.24	9.22	0.57	1.36	1.32	8.92	8.86	8.92	29
長期 (7-11)	70	95.52	95.57	8.13	0.62	1.23	1.21	7.93	7.89	7.93	28
超長期 (11-)	30	87.77	87.81	11.76	0.45	1.70	1.59	11.43	11.34	11.43	32
AA 格	41,058	94.81	95.01	8.68	0.80	1.26	1.21	7.11	7.06	7.07	28
短期 (1-3)	11,244	99.42	99.53	2.05	0.48	0.79	0.79	2.04	2.03	2.04	24
中期 (3-7)	14,285	98.73	98.91	4.73	0.73	0.99	0.99	4.64	4.61	4.64	28
長期 (7-)	15,528	87.87	88.15	17.12	1.11	1.91	1.77	13.82	13.69	13.69	30
長期 (7-11)	5,783	98.41	98.67	8.83	1.11	1.31	1.30	8.40	8.34	8.39	31
超長期 (11-)	9,746	81.61	81.91	22.04	1.11	2.33	2.11	17.70	17.50	17.47	29
A 格	22,262	95.96	96.13	5.93	0.73	1.35	1.32	5.44	5.40	5.43	53
短期 (1-3)	6,707	99.02	99.13	2.00	0.47	0.98	0.98	1.99	1.98	1.99	43
中期 (3-7)	9,404	97.36	97.53	4.77	0.68	1.23	1.22	4.68	4.65	4.68	51
長期 (7-)	6,151	90.48	90.74	11.98	1.08	1.99	1.89	10.80	10.69	10.77	66
長期 (7-11)	3,115	96.15	96.43	8.66	1.13	1.64	1.61	8.22	8.16	8.22	64
超長期 (11-)	3,036	84.67	84.91	15.40	1.04	2.40	2.22	13.80	13.64	13.74	70
BBB 格	181	96.61	96.78	3.60	1.03	2.05	2.01	3.49	3.46	3.49	137
短期 (1-3)	63	97.55	97.62	1.88	0.82	2.16	2.14	1.87	1.85	1.87	160
中期 (3-7)	118	96.11	96.34	4.52	1.13	1.98	1.93	4.37	4.32	4.37	124
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	5,686	96.34	96.48	5.18	0.74	1.41	1.37	4.88	4.84	4.88	63
短期 (1-3)	1,851	98.87	98.98	2.15	0.62	1.15	1.14	2.14	2.12	2.14	59
中期 (3-7)	2,699	96.69	96.83	4.83	0.68	1.37	1.34	4.72	4.69	4.72	63
長期 (7-)	1,136	91.37	91.58	10.98	1.10	1.96	1.84	10.11	10.01	10.10	68
長期 (7-11)	624	97.42	97.68	8.48	1.30	1.66	1.61	8.01	7.94	8.00	66
超長期 (11-)	512	83.99	84.15	14.03	0.85	2.39	2.17	13.08	12.94	13.05	72

出所:NFRG

- 格付は、R&Iの格付をもとに NFRG で分類

事業債 JCR 格付別・ポートフォリオ指標 (2024年12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	30,430	96.19	96.33	5.92	0.59	1.14	1.11	5.26	5.23	5.25	34
短期 (1-3)	10,282	99.12	99.20	2.00	0.38	0.83	0.83	1.99	1.99	1.99	28
中期 (3-7)	12,828	97.69	97.83	4.70	0.56	1.05	1.04	4.63	4.60	4.63	34
長期 (7-)	7,320	89.45	89.67	13.56	0.95	1.80	1.69	11.56	11.46	11.50	41
長期 (7-11)	3,892	96.71	96.92	8.56	0.95	1.39	1.37	8.20	8.15	8.20	40
超長期 (11-)	3,428	81.21	81.43	19.25	0.95	2.35	2.12	16.10	15.93	15.95	43
AAA~A 格	42,460	96.12	96.27	5.86	0.66	1.25	1.21	5.27	5.23	5.26	44
短期 (1-3)	13,830	99.07	99.17	1.99	0.42	0.90	0.90	1.98	1.97	1.98	35
中期 (3-7)	17,969	97.56	97.71	4.71	0.64	1.16	1.14	4.63	4.60	4.63	44
長期 (7-)	10,661	89.86	90.10	12.82	1.02	1.91	1.80	11.14	11.04	11.09	56
長期 (7-11)	5,631	96.29	96.53	8.61	1.03	1.53	1.50	8.22	8.16	8.21	53
超長期 (11-)	5,030	82.66	82.90	17.53	1.01	2.41	2.19	14.96	14.79	14.84	59
AAA~BBB 格	42,460	96.12	96.27	5.86	0.66	1.25	1.21	5.27	5.23	5.26	44
短期 (1-3)	13,830	99.07	99.17	1.99	0.42	0.90	0.90	1.98	1.97	1.98	35
中期 (3-7)	17,969	97.56	97.71	4.71	0.64	1.16	1.14	4.63	4.60	4.63	44
長期 (7-)	10,661	89.86	90.10	12.82	1.02	1.91	1.80	11.14	11.04	11.09	56
長期 (7-11)	5,631	96.29	96.53	8.61	1.03	1.53	1.50	8.22	8.16	8.21	53
超長期 (11-)	5,030	82.66	82.90	17.53	1.01	2.41	2.19	14.96	14.79	14.84	59
AAA~BB 格	42,460	96.12	96.27	5.86	0.66	1.25	1.21	5.27	5.23	5.26	44
短期 (1-3)	13,830	99.07	99.17	1.99	0.42	0.90	0.90	1.98	1.97	1.98	35
中期 (3-7)	17,969	97.56	97.71	4.71	0.64	1.16	1.14	4.63	4.60	4.63	44
長期 (7-)	10,661	89.86	90.10	12.82	1.02	1.91	1.80	11.14	11.04	11.09	56
長期 (7-11)	5,631	96.29	96.53	8.61	1.03	1.53	1.50	8.22	8.16	8.21	53
超長期 (11-)	5,030	82.66	82.90	17.53	1.01	2.41	2.19	14.96	14.79	14.84	59
AAA 格	11,569	96.70	96.81	5.52	0.48	0.98	0.96	4.76	4.72	4.73	22
短期 (1-3)	4,465	99.04	99.09	1.99	0.23	0.74	0.74	1.99	1.98	1.99	19
中期 (3-7)	5,117	98.05	98.16	4.61	0.51	0.93	0.92	4.55	4.52	4.55	22
長期 (7-)	1,987	88.00	88.21	15.80	0.96	1.74	1.61	12.35	12.23	12.21	29
長期 (7-11)	1,185	97.12	97.30	8.65	0.91	1.29	1.28	8.31	8.26	8.31	30
超長期 (11-)	802	74.52	74.77	26.36	1.04	2.61	2.24	20.11	19.87	19.72	28
AA 格	18,860	95.88	96.03	6.17	0.66	1.24	1.21	5.58	5.54	5.57	41
短期 (1-3)	5,818	99.18	99.28	2.01	0.49	0.91	0.91	2.00	1.99	2.00	36
中期 (3-7)	7,710	97.46	97.60	4.77	0.60	1.14	1.12	4.68	4.65	4.68	42
長期 (7-)	5,332	89.99	90.21	12.73	0.94	1.82	1.72	11.28	11.17	11.24	46
長期 (7-11)	2,706	96.53	96.76	8.51	0.96	1.43	1.41	8.15	8.10	8.15	45
超長期 (11-)	2,626	83.25	83.47	17.07	0.92	2.28	2.08	15.01	14.85	14.92	47
A 格	12,030	95.93	96.14	5.71	0.84	1.51	1.47	5.28	5.23	5.27	69
短期 (1-3)	3,548	98.95	99.09	1.94	0.54	1.09	1.09	1.93	1.92	1.93	55
中期 (3-7)	5,141	97.22	97.43	4.74	0.83	1.41	1.39	4.62	4.59	4.62	68
長期 (7-)	3,341	90.75	91.05	11.19	1.19	2.16	2.05	10.24	10.13	10.22	87
長期 (7-11)	1,740	95.34	95.66	8.74	1.23	1.85	1.80	8.26	8.18	8.25	83
超長期 (11-)	1,602	85.77	86.03	13.86	1.14	2.53	2.34	12.63	12.48	12.60	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	27,682	94.16	94.40	9.80	0.92	1.37	1.31	7.94	7.87	7.88	31
短期 (1-3)	6,540	99.56	99.71	2.03	0.62	0.87	0.87	2.02	2.01	2.02	32
中期 (3-7)	8,781	99.05	99.26	4.70	0.83	1.03	1.03	4.60	4.57	4.60	33
長期 (7-)	12,361	87.83	88.13	17.54	1.15	1.94	1.80	14.15	14.01	14.01	30
長期 (7-11)	4,041	99.23	99.51	8.82	1.21	1.31	1.30	8.35	8.30	8.35	31
超長期 (11-)	8,320	82.30	82.60	21.77	1.13	2.31	2.09	17.55	17.36	17.33	29

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12月末、1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	31,224	96.17	96.30	6.00	0.60	1.15	1.12	5.33	5.29	5.32	34
短期 (1-3)	10,443	99.10	99.18	2.04	0.38	0.84	0.83	2.03	2.02	2.03	28
中期 (3-7)	13,210	97.69	97.82	4.75	0.57	1.06	1.05	4.67	4.65	4.67	34
長期 (7-)	7,571	89.46	89.68	13.62	0.96	1.81	1.70	11.62	11.52	11.56	42
長期 (7-11)	3,964	96.80	97.01	8.62	0.97	1.40	1.38	8.25	8.20	8.25	41
超長期 (11-)	3,607	81.39	81.61	19.12	0.95	2.35	2.12	16.02	15.85	15.88	44
AAA~A 格	43,205	96.10	96.25	5.93	0.67	1.25	1.22	5.33	5.29	5.32	44
短期 (1-3)	13,990	99.06	99.15	2.03	0.42	0.90	0.90	2.02	2.01	2.02	35
中期 (3-7)	18,339	97.55	97.70	4.76	0.64	1.16	1.14	4.67	4.64	4.67	44
長期 (7-)	10,877	89.84	90.08	12.90	1.03	1.92	1.81	11.21	11.10	11.16	56
長期 (7-11)	5,668	96.37	96.61	8.67	1.05	1.54	1.51	8.26	8.20	8.26	53
超長期 (11-)	5,209	82.74	82.97	17.50	1.01	2.41	2.19	14.94	14.78	14.83	59
AAA~BBB 格	43,205	96.10	96.25	5.93	0.67	1.25	1.22	5.33	5.29	5.32	44
短期 (1-3)	13,990	99.06	99.15	2.03	0.42	0.90	0.90	2.02	2.01	2.02	35
中期 (3-7)	18,339	97.55	97.70	4.76	0.64	1.16	1.14	4.67	4.64	4.67	44
長期 (7-)	10,877	89.84	90.08	12.90	1.03	1.92	1.81	11.21	11.10	11.16	56
長期 (7-11)	5,668	96.37	96.61	8.67	1.05	1.54	1.51	8.26	8.20	8.26	53
超長期 (11-)	5,209	82.74	82.97	17.50	1.01	2.41	2.19	14.94	14.78	14.83	59
AAA~BB 格	43,205	96.10	96.25	5.93	0.67	1.25	1.22	5.33	5.29	5.32	44
短期 (1-3)	13,990	99.06	99.15	2.03	0.42	0.90	0.90	2.02	2.01	2.02	35
中期 (3-7)	18,339	97.55	97.70	4.76	0.64	1.16	1.14	4.67	4.64	4.67	44
長期 (7-)	10,877	89.84	90.08	12.90	1.03	1.92	1.81	11.21	11.10	11.16	56
長期 (7-11)	5,668	96.37	96.61	8.67	1.05	1.54	1.51	8.26	8.20	8.26	53
超長期 (11-)	5,209	82.74	82.97	17.50	1.01	2.41	2.19	14.94	14.78	14.83	59
AAA 格	11,755	96.75	96.86	5.51	0.49	0.98	0.96	4.75	4.72	4.73	22
短期 (1-3)	4,618	99.05	99.10	2.02	0.25	0.74	0.74	2.02	2.01	2.02	19
中期 (3-7)	5,187	98.03	98.15	4.67	0.51	0.94	0.93	4.60	4.58	4.60	23
長期 (7-)	1,951	87.91	88.12	16.00	0.98	1.76	1.62	12.48	12.36	12.34	30
長期 (7-11)	1,145	97.25	97.44	8.73	0.94	1.30	1.29	8.37	8.32	8.37	31
超長期 (11-)	805	74.62	74.87	26.34	1.05	2.61	2.24	20.09	19.85	19.70	28
AA 格	19,469	95.81	95.96	6.29	0.67	1.26	1.22	5.69	5.64	5.67	41
短期 (1-3)	5,826	99.14	99.24	2.06	0.48	0.91	0.91	2.05	2.04	2.05	36
中期 (3-7)	8,023	97.47	97.61	4.80	0.61	1.14	1.13	4.72	4.69	4.72	42
長期 (7-)	5,620	90.00	90.22	12.80	0.96	1.83	1.72	11.33	11.23	11.29	46
長期 (7-11)	2,818	96.62	96.84	8.58	0.99	1.44	1.41	8.21	8.15	8.20	45
超長期 (11-)	2,802	83.34	83.55	17.05	0.93	2.28	2.09	14.98	14.82	14.89	48
A 格	11,981	95.92	96.13	5.74	0.85	1.51	1.47	5.31	5.27	5.31	69
短期 (1-3)	3,547	98.95	99.08	2.00	0.55	1.10	1.10	1.98	1.97	1.98	55
中期 (3-7)	5,128	97.18	97.39	4.79	0.83	1.41	1.39	4.67	4.64	4.67	68
長期 (7-)	3,306	90.72	91.01	11.24	1.20	2.17	2.06	10.27	10.17	10.26	87
長期 (7-11)	1,705	95.36	95.68	8.78	1.24	1.86	1.81	8.28	8.21	8.28	83
超長期 (11-)	1,602	85.77	86.03	13.86	1.14	2.53	2.34	12.63	12.48	12.60	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	26,936	94.14	94.38	9.88	0.93	1.37	1.31	7.99	7.92	7.93	31
短期 (1-3)	6,360	99.56	99.71	2.06	0.62	0.87	0.87	2.05	2.04	2.05	31
中期 (3-7)	8,537	99.05	99.26	4.71	0.83	1.03	1.03	4.61	4.59	4.61	32
長期 (7-)	12,039	87.80	88.09	17.67	1.16	1.94	1.80	14.24	14.09	14.09	29
長期 (7-11)	3,924	99.35	99.64	8.86	1.22	1.30	1.30	8.38	8.33	8.38	31
超長期 (11-)	8,115	82.21	82.51	21.93	1.13	2.31	2.10	17.65	17.46	17.43	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12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	24,157	95.39	95.61	8.57	0.82	1.24	1.19	7.16	7.10	7.12	25
短期 (1-3)	6,813	99.41	99.54	2.00	0.45	0.77	0.77	1.99	1.98	1.99	22
中期 (3-7)	7,844	98.81	99.01	4.62	0.70	0.94	0.94	4.54	4.51	4.54	24
長期 (7-)	9,500	89.69	89.99	16.53	1.17	1.87	1.76	13.64	13.51	13.53	29
長期 (7-11)	3,408	98.97	99.24	8.75	1.13	1.28	1.28	8.32	8.27	8.31	29
超長期 (11-)	6,092	84.49	84.81	20.89	1.19	2.25	2.07	17.12	16.94	16.94	29
AAA~BBB 格	26,049	95.40	95.62	8.48	0.83	1.25	1.21	7.11	7.05	7.07	28
短期 (1-3)	7,083	99.39	99.52	2.00	0.45	0.78	0.78	1.99	1.98	1.99	23
中期 (3-7)	8,825	98.82	99.02	4.61	0.74	0.98	0.98	4.53	4.50	4.52	28
長期 (7-)	10,142	89.65	89.94	16.37	1.16	1.88	1.76	13.55	13.42	13.44	31
長期 (7-11)	3,693	98.79	99.06	8.73	1.12	1.30	1.29	8.31	8.25	8.30	31
超長期 (11-)	6,449	84.41	84.73	20.75	1.19	2.27	2.08	17.06	16.87	16.88	31
AAA~BB 格	26,049	95.40	95.62	8.48	0.83	1.25	1.21	7.11	7.05	7.07	28
短期 (1-3)	7,083	99.39	99.52	2.00	0.45	0.78	0.78	1.99	1.98	1.99	23
中期 (3-7)	8,825	98.82	99.02	4.61	0.74	0.98	0.98	4.53	4.50	4.52	28
長期 (7-)	10,142	89.65	89.94	16.37	1.16	1.88	1.76	13.55	13.42	13.44	31
長期 (7-11)	3,693	98.79	99.06	8.73	1.12	1.30	1.29	8.31	8.25	8.30	31
超長期 (11-)	6,449	84.41	84.73	20.75	1.19	2.27	2.08	17.06	16.87	16.88	31
AAA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
A 格	24,157	95.39	95.61	8.57	0.82	1.24	1.19	7.16	7.10	7.12	25
短期 (1-3)	6,813	99.41	99.54	2.00	0.45	0.77	0.77	1.99	1.98	1.99	22
中期 (3-7)	7,844	98.81	99.01	4.62	0.70	0.94	0.94	4.54	4.51	4.54	24
長期 (7-)	9,500	89.69	89.99	16.53	1.17	1.87	1.76	13.64	13.51	13.53	29
長期 (7-11)	3,408	98.97	99.24	8.75	1.13	1.28	1.28	8.32	8.27	8.31	29
超長期 (11-)	6,092	84.49	84.81	20.89	1.19	2.25	2.07	17.12	16.94	16.94	29
BBB 格	1,893	95.55	95.77	7.40	0.95	1.46	1.41	6.53	6.47	6.51	53
短期 (1-3)	270	98.89	98.95	2.04	0.31	0.87	0.86	2.03	2.02	2.03	31
中期 (3-7)	981	98.89	99.13	4.56	1.04	1.29	1.29	4.44	4.41	4.44	60
長期 (7-)	642	89.04	89.28	14.00	1.08	2.00	1.88	12.17	12.04	12.11	53
長期 (7-11)	285	96.55	96.80	8.51	0.98	1.46	1.43	8.14	8.09	8.14	47
超長期 (11-)	357	83.05	83.28	18.39	1.16	2.51	2.30	15.90	15.72	15.79	59
BB 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
B 格以下	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
格付なし	44,093	95.31	95.48	6.79	0.73	1.32	1.28	5.83	5.79	5.81	46
短期 (1-3)	13,288	99.14	99.25	2.00	0.50	0.95	0.95	1.99	1.98	1.99	40
中期 (3-7)	17,926	97.67	97.83	4.75	0.68	1.18	1.17	4.66	4.63	4.66	46
長期 (7-)	12,879	88.08	88.33	14.55	1.04	1.97	1.83	12.10	11.98	12.01	51
長期 (7-11)	5,979	96.73	96.99	8.68	1.10	1.52	1.50	8.26	8.19	8.25	52
超長期 (11-)	6,901	80.59	80.83	19.64	0.98	2.43	2.18	16.09	15.91	15.91	49

出所:NFRC

- 格付は、Moody's の格付をもとに NFRC で分類

事業債 Moody's 格付別・ポートフォリオ指標 (2024年12月末、1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	24,247	95.41	95.62	8.58	0.82	1.24	1.19	7.17	7.11	7.13	25
短期 (1-3)	6,852	99.40	99.53	2.04	0.46	0.77	0.77	2.03	2.02	2.03	22
中期 (3-7)	7,934	98.79	98.98	4.67	0.70	0.95	0.94	4.58	4.56	4.58	24
長期 (7-)	9,461	89.69	89.99	16.59	1.18	1.87	1.76	13.68	13.55	13.57	29
長期 (7-11)	3,373	99.06	99.33	8.80	1.15	1.29	1.28	8.36	8.31	8.35	29
超長期 (11-)	6,088	84.49	84.81	20.90	1.19	2.25	2.07	17.14	16.95	16.96	29
AAA~BBB 格	26,139	95.42	95.63	8.49	0.83	1.25	1.21	7.13	7.07	7.09	27
短期 (1-3)	7,122	99.38	99.51	2.04	0.45	0.78	0.78	2.03	2.02	2.03	23
中期 (3-7)	8,925	98.79	98.99	4.66	0.74	0.98	0.98	4.57	4.55	4.57	28
長期 (7-)	10,093	89.64	89.94	16.43	1.17	1.88	1.77	13.59	13.46	13.49	31
長期 (7-11)	3,648	98.87	99.14	8.79	1.14	1.30	1.29	8.35	8.29	8.34	31
超長期 (11-)	6,445	84.41	84.73	20.76	1.19	2.27	2.08	17.07	16.89	16.89	31
AAA~BB 格	26,139	95.42	95.63	8.49	0.83	1.25	1.21	7.13	7.07	7.09	27
短期 (1-3)	7,122	99.38	99.51	2.04	0.45	0.78	0.78	2.03	2.02	2.03	23
中期 (3-7)	8,925	98.79	98.99	4.66	0.74	0.98	0.98	4.57	4.55	4.57	28
長期 (7-)	10,093	89.64	89.94	16.43	1.17	1.88	1.77	13.59	13.46	13.49	31
長期 (7-11)	3,648	98.87	99.14	8.79	1.14	1.30	1.29	8.35	8.29	8.34	31
超長期 (11-)	6,445	84.41	84.73	20.76	1.19	2.27	2.08	17.07	16.89	16.89	31
AAA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
A 格	24,247	95.41	95.62	8.58	0.82	1.24	1.19	7.17	7.11	7.13	25
短期 (1-3)	6,852	99.40	99.53	2.04	0.46	0.77	0.77	2.03	2.02	2.03	22
中期 (3-7)	7,934	98.79	98.98	4.67	0.70	0.95	0.94	4.58	4.56	4.58	24
長期 (7-)	9,461	89.69	89.99	16.59	1.18	1.87	1.76	13.68	13.55	13.57	29
長期 (7-11)	3,373	99.06	99.33	8.80	1.15	1.29	1.28	8.36	8.31	8.35	29
超長期 (11-)	6,088	84.49	84.81	20.90	1.19	2.25	2.07	17.14	16.95	16.96	29
BBB 格	1,893	95.55	95.77	7.40	0.95	1.46	1.41	6.53	6.47	6.51	53
短期 (1-3)	270	98.89	98.95	2.04	0.31	0.87	0.86	2.03	2.02	2.03	31
中期 (3-7)	991	98.85	99.09	4.58	1.04	1.30	1.29	4.47	4.44	4.47	59
長期 (7-)	632	88.95	89.19	14.11	1.09	2.01	1.89	12.26	12.13	12.20	54
長期 (7-11)	275	96.61	96.86	8.56	1.00	1.46	1.44	8.19	8.13	8.18	47
超長期 (11-)	357	83.05	83.28	18.39	1.16	2.51	2.30	15.90	15.72	15.79	59
BB 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
B 格以下	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
格付なし	44,002	95.30	95.47	6.82	0.73	1.32	1.28	5.87	5.82	5.84	46
短期 (1-3)	13,229	99.13	99.23	2.04	0.50	0.95	0.95	2.03	2.02	2.03	40
中期 (3-7)	17,951	97.64	97.80	4.79	0.69	1.18	1.17	4.70	4.67	4.70	46
長期 (7-)	12,823	88.08	88.33	14.59	1.04	1.97	1.84	12.13	12.01	12.04	51
長期 (7-11)	5,944	96.80	97.06	8.72	1.11	1.53	1.50	8.29	8.23	8.29	52
超長期 (11-)	6,879	80.54	80.78	19.67	0.98	2.43	2.18	16.12	15.94	15.93	49

出所:NFRC

- 格付は、Moody's の格付をもとに NFRC で分類

事業債 S&P 格付別・ポートフォリオ指標 (2024年12月末)

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
AAA~AA 格	851	84.18	84.33	17.37	0.98	1.91	1.71	13.28	13.14	13.14	31
短期 (1-3)	40	102.11	102.17	1.98	1.75	0.78	0.79	1.96	1.95	1.96	25
中期 (3-7)	135	97.22	97.26	5.50	0.46	1.04	1.03	5.42	5.39	5.42	28
長期 (7-)	676	80.51	80.70	20.66	1.03	2.21	1.95	16.02	15.84	15.83	33
長期 (7-11)	192	99.41	99.61	8.61	1.19	1.28	1.28	8.18	8.13	8.17	31
超長期 (11-)	484	73.02	73.19	25.44	0.98	2.71	2.31	20.25	20.01	19.97	34
AAA~A 格	16,246	93.95	94.12	9.01	0.78	1.27	1.21	7.35	7.29	7.31	27
短期 (1-3)	3,867	99.52	99.62	2.07	0.51	0.78	0.78	2.06	2.05	2.06	23
中期 (3-7)	5,607	98.51	98.65	4.90	0.69	0.99	0.99	4.81	4.78	4.81	28
長期 (7-)	6,772	87.00	87.23	16.38	1.00	1.86	1.71	13.19	13.06	13.06	30
長期 (7-11)	2,846	98.39	98.61	8.63	1.09	1.28	1.27	8.22	8.17	8.22	31
超長期 (11-)	3,926	78.75	78.98	22.00	0.94	2.38	2.10	17.69	17.49	17.45	30
AAA~BBB 格	16,461	94.00	94.17	8.95	0.77	1.27	1.21	7.31	7.25	7.26	28
短期 (1-3)	3,927	99.51	99.60	2.07	0.51	0.78	0.78	2.06	2.05	2.06	23
中期 (3-7)	5,732	98.49	98.63	4.88	0.69	1.00	0.99	4.79	4.77	4.79	28
長期 (7-)	6,802	87.03	87.26	16.35	1.00	1.86	1.71	13.17	13.04	13.05	30
長期 (7-11)	2,866	98.39	98.61	8.62	1.09	1.29	1.28	8.22	8.17	8.22	31
超長期 (11-)	3,936	78.76	79.00	21.98	0.94	2.38	2.10	17.67	17.48	17.44	30
AAA~BB 格	16,701	94.09	94.26	8.90	0.80	1.28	1.22	7.27	7.21	7.23	29
短期 (1-3)	3,927	99.51	99.60	2.07	0.51	0.78	0.78	2.06	2.05	2.06	23
中期 (3-7)	5,947	98.58	98.74	4.86	0.74	1.03	1.03	4.76	4.74	4.76	32
長期 (7-)	6,827	87.05	87.28	16.35	1.01	1.86	1.71	13.17	13.04	13.04	31
長期 (7-11)	2,866	98.39	98.61	8.62	1.09	1.29	1.28	8.22	8.17	8.22	31
超長期 (11-)	3,961	78.85	79.09	21.94	0.95	2.38	2.11	17.64	17.44	17.40	31
AAA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA 格	851	84.18	84.33	17.37	0.98	1.91	1.71	13.28	13.14	13.14	31
短期 (1-3)	40	102.11	102.17	1.98	1.75	0.78	0.79	1.96	1.95	1.96	25
中期 (3-7)	135	97.22	97.26	5.50	0.46	1.04	1.03	5.42	5.39	5.42	28
長期 (7-)	676	80.51	80.70	20.66	1.03	2.21	1.95	16.02	15.84	15.83	33
長期 (7-11)	192	99.41	99.61	8.61	1.19	1.28	1.28	8.18	8.13	8.17	31
超長期 (11-)	484	73.02	73.19	25.44	0.98	2.71	2.31	20.25	20.01	19.97	34
A 格	15,395	94.49	94.66	8.55	0.77	1.24	1.19	7.06	7.01	7.02	27
短期 (1-3)	3,827	99.49	99.59	2.07	0.50	0.78	0.78	2.06	2.05	2.06	23
中期 (3-7)	5,472	98.54	98.68	4.89	0.69	0.99	0.99	4.79	4.77	4.79	27
長期 (7-)	6,096	87.72	87.96	15.91	1.00	1.82	1.68	12.90	12.78	12.78	30
長期 (7-11)	2,654	98.32	98.54	8.63	1.08	1.29	1.27	8.23	8.17	8.22	31
超長期 (11-)	3,442	79.55	79.80	21.52	0.94	2.33	2.07	17.36	17.17	17.12	29
BBB 格	215	97.67	97.76	4.26	0.58	1.12	1.10	4.10	4.07	4.09	42
短期 (1-3)	60	98.89	98.91	1.91	0.29	0.88	0.88	1.91	1.90	1.91	33
中期 (3-7)	125	97.97	98.05	4.02	0.60	1.10	1.09	3.96	3.94	3.96	42
長期 (7-)	30	94.03	94.26	9.96	1.08	1.69	1.63	9.28	9.20	9.27	56
長期 (7-11)	20	98.05	98.37	8.21	1.15	1.42	1.40	7.83	7.78	7.83	48
超長期 (11-)	10	85.99	86.04	13.45	0.95	2.32	2.16	12.58	12.44	12.55	74
BB 格	240	100.03	100.49	5.41	2.26	2.10	2.09	4.90	4.84	4.89	133
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	215	100.93	101.42	4.25	2.25	1.99	2.00	4.05	4.01	4.05	132
長期 (7-)	25	92.30	92.50	15.41	2.37	3.11	2.99	12.85	12.66	12.77	146
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	25	92.30	92.50	15.41	2.37	3.11	2.99	12.85	12.66	12.77	146
B 格以下	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
格付なし	53,442	95.74	95.93	6.95	0.76	1.30	1.26	6.01	5.96	5.99	42
短期 (1-3)	16,444	99.16	99.28	1.99	0.48	0.92	0.91	1.97	1.97	1.97	37
中期 (3-7)	20,804	97.89	98.07	4.67	0.69	1.14	1.13	4.57	4.55	4.57	43
長期 (7-)	16,194	89.50	89.78	14.93	1.13	1.95	1.84	12.57	12.44	12.48	47
長期 (7-11)	6,806	97.15	97.43	8.73	1.11	1.50	1.48	8.30	8.24	8.29	50
超長期 (11-)	9,389	83.95	84.24	19.43	1.14	2.34	2.14	16.15	15.97	15.99	44

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12月末、1月ポートフォリオ)

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
AAA~AA 格	851	84.18	84.33	17.37	0.98	1.91	1.71	13.28	13.14	13.14	31
短期 (1-3)	40	102.11	102.17	1.98	1.75	0.78	0.79	1.96	1.95	1.96	25
中期 (3-7)	135	97.22	97.26	5.50	0.46	1.04	1.03	5.42	5.39	5.42	28
長期 (7-)	676	80.51	80.70	20.66	1.03	2.21	1.95	16.02	15.84	15.83	33
長期 (7-11)	192	99.41	99.61	8.61	1.19	1.28	1.28	8.18	8.13	8.17	31
超長期 (11-)	484	73.02	73.19	25.44	0.98	2.71	2.31	20.25	20.01	19.97	34
AAA~A 格	16,201	93.94	94.10	9.05	0.78	1.28	1.22	7.38	7.32	7.33	27
短期 (1-3)	3,902	99.50	99.60	2.12	0.51	0.78	0.78	2.11	2.10	2.11	23
中期 (3-7)	5,597	98.44	98.58	4.97	0.69	1.00	0.99	4.87	4.85	4.87	28
長期 (7-)	6,702	86.93	87.17	16.48	1.01	1.87	1.71	13.26	13.14	13.14	30
長期 (7-11)	2,801	98.49	98.71	8.70	1.11	1.29	1.28	8.28	8.23	8.28	31
超長期 (11-)	3,901	78.64	78.87	22.07	0.94	2.38	2.11	17.74	17.55	17.50	30
AAA~BBB 格	16,416	93.98	94.15	8.98	0.78	1.27	1.21	7.34	7.28	7.29	28
短期 (1-3)	3,962	99.49	99.59	2.12	0.51	0.78	0.78	2.10	2.10	2.10	23
中期 (3-7)	5,722	98.43	98.57	4.95	0.69	1.00	0.99	4.85	4.83	4.85	28
長期 (7-)	6,732	86.97	87.20	16.45	1.01	1.87	1.71	13.24	13.12	13.12	30
長期 (7-11)	2,821	98.48	98.71	8.69	1.11	1.29	1.28	8.28	8.22	8.27	31
超長期 (11-)	3,911	78.66	78.89	22.05	0.94	2.38	2.11	17.73	17.53	17.49	30
AAA~BB 格	16,656	94.07	94.24	8.93	0.80	1.29	1.23	7.30	7.24	7.25	29
短期 (1-3)	3,962	99.49	99.59	2.12	0.51	0.78	0.78	2.10	2.10	2.10	23
中期 (3-7)	5,937	98.52	98.67	4.92	0.74	1.04	1.03	4.82	4.80	4.82	32
長期 (7-)	6,757	86.99	87.22	16.45	1.02	1.87	1.72	13.24	13.11	13.12	31
長期 (7-11)	2,821	98.48	98.71	8.69	1.11	1.29	1.28	8.28	8.22	8.27	31
超長期 (11-)	3,936	78.74	78.98	22.01	0.95	2.39	2.11	17.69	17.50	17.45	31
AAA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA 格	851	84.18	84.33	17.37	0.98	1.91	1.71	13.28	13.14	13.14	31
短期 (1-3)	40	102.11	102.17	1.98	1.75	0.78	0.79	1.96	1.95	1.96	25
中期 (3-7)	135	97.22	97.26	5.50	0.46	1.04	1.03	5.42	5.39	5.42	28
長期 (7-)	676	80.51	80.70	20.66	1.03	2.21	1.95	16.02	15.84	15.83	33
長期 (7-11)	192	99.41	99.61	8.61	1.19	1.28	1.28	8.18	8.13	8.17	31
超長期 (11-)	484	73.02	73.19	25.44	0.98	2.71	2.31	20.25	20.01	19.97	34
A 格	15,350	94.48	94.65	8.58	0.77	1.24	1.19	7.09	7.04	7.05	27
短期 (1-3)	3,862	99.47	99.57	2.12	0.50	0.78	0.78	2.11	2.10	2.11	23
中期 (3-7)	5,462	98.47	98.62	4.95	0.69	1.00	0.99	4.86	4.84	4.86	28
長期 (7-)	6,026	87.65	87.89	16.01	1.01	1.83	1.69	12.98	12.86	12.86	30
長期 (7-11)	2,609	98.42	98.64	8.70	1.11	1.29	1.28	8.29	8.23	8.28	31
超長期 (11-)	3,417	79.43	79.68	21.60	0.94	2.34	2.08	17.42	17.23	17.18	29
BBB 格	215	97.67	97.76	4.26	0.58	1.12	1.10	4.10	4.07	4.09	42
短期 (1-3)	60	98.89	98.91	1.91	0.29	0.88	0.88	1.91	1.90	1.91	33
中期 (3-7)	125	97.97	98.05	4.02	0.60	1.10	1.09	3.96	3.94	3.96	42
長期 (7-)	30	94.03	94.26	9.96	1.08	1.69	1.63	9.28	9.20	9.27	56
長期 (7-11)	20	98.05	98.37	8.21	1.15	1.42	1.40	7.83	7.78	7.83	48
超長期 (11-)	10	85.99	86.04	13.45	0.95	2.32	2.16	12.58	12.44	12.55	74
BB 格	240	100.03	100.49	5.41	2.26	2.10	2.09	4.90	4.84	4.89	133
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	215	100.93	101.42	4.25	2.25	1.99	2.00	4.05	4.01	4.05	132
長期 (7-)	25	92.30	92.50	15.41	2.37	3.11	2.99	12.85	12.66	12.77	146
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	25	92.30	92.50	15.41	2.37	3.11	2.99	12.85	12.66	12.77	146
B 格以下	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
格付なし	53,486	95.74	95.93	6.98	0.76	1.30	1.26	6.04	5.99	6.02	42
短期 (1-3)	16,389	99.15	99.27	2.02	0.48	0.92	0.91	2.01	2.00	2.01	37
中期 (3-7)	20,939	97.88	98.06	4.70	0.69	1.14	1.13	4.60	4.58	4.60	42
長期 (7-)	16,159	89.51	89.80	14.97	1.13	1.96	1.84	12.60	12.47	12.51	46
長期 (7-11)	6,771	97.22	97.50	8.77	1.13	1.50	1.48	8.33	8.27	8.32	50
超長期 (11-)	9,388	83.96	84.25	19.44	1.14	2.34	2.14	16.16	15.98	16.00	44

出所:NFRC

- 格付は、S&P の格付をもとに NFRC で分類

円建外債 最高格付別・ポートフォリオ指標 (2024年12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	1,670	98.90	99.12	3.23	0.87	1.23	1.23	3.15	3.13	3.15	61
短期(1-3)	965	99.25	99.46	2.25	0.78	1.13	1.13	2.23	2.22	2.23	56
中期(3-7)	632	98.53	98.76	4.07	0.96	1.33	1.32	3.99	3.96	3.99	65
長期(7-)	73	97.46	97.81	8.85	1.40	1.74	1.72	8.27	8.20	8.26	73
長期(7-11)	69	97.60	97.94	8.55	1.36	1.70	1.68	8.06	7.99	8.05	72
超長期(11-)	4	95.21	95.81	13.75	1.99	2.45	2.39	11.82	11.68	11.76	100
AAA~A格	3,446	98.74	99.00	3.53	1.06	1.45	1.45	3.37	3.35	3.37	80
短期(1-3)	1,974	99.25	99.48	2.20	0.96	1.31	1.31	2.17	2.16	2.17	74
中期(3-7)	1,189	98.06	98.33	4.01	1.00	1.51	1.50	3.92	3.90	3.92	83
長期(7-)	284	98.02	98.44	10.76	1.98	2.24	2.22	9.50	9.40	9.48	108
長期(7-11)	166	97.43	97.89	8.63	1.62	1.99	1.97	8.02	7.94	8.01	101
超長期(11-)	118	98.86	99.21	13.76	2.50	2.59	2.57	11.57	11.42	11.51	118
AAA~BBB格	3,446	98.74	99.00	3.53	1.06	1.45	1.45	3.37	3.35	3.37	80
短期(1-3)	1,974	99.25	99.48	2.20	0.96	1.31	1.31	2.17	2.16	2.17	74
中期(3-7)	1,189	98.06	98.33	4.01	1.00	1.51	1.50	3.92	3.90	3.92	83
長期(7-)	284	98.02	98.44	10.76	1.98	2.24	2.22	9.50	9.40	9.48	108
長期(7-11)	166	97.43	97.89	8.63	1.62	1.99	1.97	8.02	7.94	8.01	101
超長期(11-)	118	98.86	99.21	13.76	2.50	2.59	2.57	11.57	11.42	11.51	118
AAA~BB格	3,446	98.74	99.00	3.53	1.06	1.45	1.45	3.37	3.35	3.37	80
短期(1-3)	1,974	99.25	99.48	2.20	0.96	1.31	1.31	2.17	2.16	2.17	74
中期(3-7)	1,189	98.06	98.33	4.01	1.00	1.51	1.50	3.92	3.90	3.92	83
長期(7-)	284	98.02	98.44	10.76	1.98	2.24	2.22	9.50	9.40	9.48	108
長期(7-11)	166	97.43	97.89	8.63	1.62	1.99	1.97	8.02	7.94	8.01	101
超長期(11-)	118	98.86	99.21	13.76	2.50	2.59	2.57	11.57	11.42	11.51	118
AAA格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA格	1,670	98.90	99.12	3.23	0.87	1.23	1.23	3.15	3.13	3.15	61
短期(1-3)	965	99.25	99.46	2.25	0.78	1.13	1.13	2.23	2.22	2.23	56
中期(3-7)	632	98.53	98.76	4.07	0.96	1.33	1.32	3.99	3.96	3.99	65
長期(7-)	73	97.46	97.81	8.85	1.40	1.74	1.72	8.27	8.20	8.26	73
長期(7-11)	69	97.60	97.94	8.55	1.36	1.70	1.68	8.06	7.99	8.05	72
超長期(11-)	4	95.21	95.81	13.75	1.99	2.45	2.39	11.82	11.68	11.76	100
A格	1,776	98.59	98.88	3.81	1.23	1.66	1.65	3.58	3.55	3.58	99
短期(1-3)	1,009	99.25	99.49	2.15	1.13	1.48	1.48	2.12	2.11	2.12	92
中期(3-7)	556	97.53	97.85	3.95	1.04	1.71	1.69	3.85	3.82	3.85	103
長期(7-)	211	98.22	98.65	11.41	2.18	2.42	2.39	9.93	9.81	9.89	120
長期(7-11)	98	97.31	97.85	8.68	1.80	2.20	2.18	7.99	7.91	7.99	121
超長期(11-)	113	98.99	99.34	13.76	2.52	2.59	2.58	11.56	11.42	11.51	119
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12月末、1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	794	99.22	99.47	3.20	0.91	1.16	1.15	3.12	3.10	3.12	53
短期 (1-3)	511	99.51	99.76	2.31	0.86	1.09	1.09	2.29	2.28	2.29	52
中期 (3-7)	261	98.88	99.10	4.42	0.96	1.25	1.24	4.32	4.30	4.32	55
長期 (7-)	22	96.74	97.05	9.10	1.29	1.73	1.70	8.44	8.36	8.43	70
長期 (7-11)	18	97.10	97.33	8.02	1.12	1.57	1.54	7.67	7.61	7.66	63
超長期 (11-)	4	95.21	95.81	13.75	1.99	2.45	2.39	11.82	11.68	11.76	100
AAA~A 格	3,675	98.81	99.06	3.61	1.10	1.47	1.46	3.43	3.41	3.43	81
短期 (1-3)	2,152	99.27	99.50	2.24	1.01	1.34	1.34	2.21	2.20	2.21	78
中期 (3-7)	1,221	98.15	98.42	4.10	1.02	1.50	1.49	4.01	3.98	4.01	82
長期 (7-)	301	98.12	98.51	11.41	2.04	2.29	2.26	9.90	9.79	9.86	108
長期 (7-11)	169	97.54	97.97	8.76	1.66	2.02	1.99	8.12	8.04	8.12	102
超長期 (11-)	132	98.86	99.20	14.81	2.54	2.63	2.61	12.16	12.00	12.07	116
AAA~BBB 格	3,675	98.81	99.06	3.61	1.10	1.47	1.46	3.43	3.41	3.43	81
短期 (1-3)	2,152	99.27	99.50	2.24	1.01	1.34	1.34	2.21	2.20	2.21	78
中期 (3-7)	1,221	98.15	98.42	4.10	1.02	1.50	1.49	4.01	3.98	4.01	82
長期 (7-)	301	98.12	98.51	11.41	2.04	2.29	2.26	9.90	9.79	9.86	108
長期 (7-11)	169	97.54	97.97	8.76	1.66	2.02	1.99	8.12	8.04	8.12	102
超長期 (11-)	132	98.86	99.20	14.81	2.54	2.63	2.61	12.16	12.00	12.07	116
AAA~BB 格	3,675	98.81	99.06	3.61	1.10	1.47	1.46	3.43	3.41	3.43	81
短期 (1-3)	2,152	99.27	99.50	2.24	1.01	1.34	1.34	2.21	2.20	2.21	78
中期 (3-7)	1,221	98.15	98.42	4.10	1.02	1.50	1.49	4.01	3.98	4.01	82
長期 (7-)	301	98.12	98.51	11.41	2.04	2.29	2.26	9.90	9.79	9.86	108
長期 (7-11)	169	97.54	97.97	8.76	1.66	2.02	1.99	8.12	8.04	8.12	102
超長期 (11-)	132	98.86	99.20	14.81	2.54	2.63	2.61	12.16	12.00	12.07	116
AAA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA 格	794	99.22	99.47	3.20	0.91	1.16	1.15	3.12	3.10	3.12	53
短期 (1-3)	511	99.51	99.76	2.31	0.86	1.09	1.09	2.29	2.28	2.29	52
中期 (3-7)	261	98.88	99.10	4.42	0.96	1.25	1.24	4.32	4.30	4.32	55
長期 (7-)	22	96.74	97.05	9.10	1.29	1.73	1.70	8.44	8.36	8.43	70
長期 (7-11)	18	97.10	97.33	8.02	1.12	1.57	1.54	7.67	7.61	7.66	63
超長期 (11-)	4	95.21	95.81	13.75	1.99	2.45	2.39	11.82	11.68	11.76	100
A 格	2,881	98.69	98.95	3.72	1.15	1.56	1.55	3.52	3.49	3.51	89
短期 (1-3)	1,642	99.20	99.42	2.22	1.05	1.42	1.42	2.19	2.17	2.19	86
中期 (3-7)	961	97.96	98.23	4.02	1.04	1.57	1.56	3.92	3.89	3.92	89
長期 (7-)	279	98.23	98.63	11.60	2.10	2.33	2.31	10.02	9.90	9.97	111
長期 (7-11)	151	97.59	98.05	8.85	1.72	2.07	2.05	8.18	8.09	8.17	106
超長期 (11-)	128	98.98	99.31	14.85	2.56	2.63	2.61	12.17	12.01	12.08	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 最低格付別・ポートフォリオ指標 (2024年12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	467	99.09	99.29	3.03	0.79	1.10	1.09	2.98	2.97	2.98	49
短期(1-3)	304	99.40	99.59	2.25	0.77	1.05	1.05	2.23	2.22	2.23	49
中期(3-7)	149	98.65	98.89	4.19	0.81	1.17	1.16	4.12	4.10	4.12	48
長期(7-)	14	96.95	97.26	7.87	0.94	1.42	1.39	7.58	7.53	7.58	49
長期(7-11)	14	96.95	97.26	7.87	0.94	1.42	1.39	7.58	7.53	7.58	49
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AAA~A格	2,280	99.08	99.28	3.34	0.97	1.30	1.30	3.22	3.20	3.22	66
短期(1-3)	1,383	99.36	99.54	2.16	0.89	1.20	1.19	2.14	2.13	2.14	64
中期(3-7)	751	98.33	98.55	4.07	0.94	1.36	1.35	3.99	3.96	3.99	68
長期(7-)	145	100.24	100.57	10.74	1.92	1.96	1.97	9.57	9.47	9.54	82
長期(7-11)	87	97.45	97.79	8.68	1.36	1.72	1.70	8.17	8.10	8.16	73
超長期(11-)	59	104.36	104.68	13.77	2.75	2.30	2.34	11.50	11.37	11.44	96
AAA~BBB格	3,446	98.74	99.00	3.53	1.06	1.45	1.45	3.37	3.35	3.37	80
短期(1-3)	1,974	99.25	99.48	2.20	0.96	1.31	1.31	2.17	2.16	2.17	74
中期(3-7)	1,189	98.06	98.33	4.01	1.00	1.51	1.50	3.92	3.90	3.92	83
長期(7-)	284	98.02	98.44	10.76	1.98	2.24	2.22	9.50	9.40	9.48	108
長期(7-11)	166	97.43	97.89	8.63	1.62	1.99	1.97	8.02	7.94	8.01	101
超長期(11-)	118	98.86	99.21	13.76	2.50	2.59	2.57	11.57	11.42	11.51	118
AAA~BB格	3,446	98.74	99.00	3.53	1.06	1.45	1.45	3.37	3.35	3.37	80
短期(1-3)	1,974	99.25	99.48	2.20	0.96	1.31	1.31	2.17	2.16	2.17	74
中期(3-7)	1,189	98.06	98.33	4.01	1.00	1.51	1.50	3.92	3.90	3.92	83
長期(7-)	284	98.02	98.44	10.76	1.98	2.24	2.22	9.50	9.40	9.48	108
長期(7-11)	166	97.43	97.89	8.63	1.62	1.99	1.97	8.02	7.94	8.01	101
超長期(11-)	118	98.86	99.21	13.76	2.50	2.59	2.57	11.57	11.42	11.51	118
AAA格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA格	467	99.09	99.29	3.03	0.79	1.10	1.09	2.98	2.97	2.98	49
短期(1-3)	304	99.40	99.59	2.25	0.77	1.05	1.05	2.23	2.22	2.23	49
中期(3-7)	149	98.65	98.89	4.19	0.81	1.17	1.16	4.12	4.10	4.12	48
長期(7-)	14	96.95	97.26	7.87	0.94	1.42	1.39	7.58	7.53	7.58	49
長期(7-11)	14	96.95	97.26	7.87	0.94	1.42	1.39	7.58	7.53	7.58	49
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
A格	1,813	99.07	99.28	3.42	1.02	1.35	1.35	3.29	3.26	3.28	71
短期(1-3)	1,079	99.35	99.53	2.14	0.92	1.24	1.24	2.11	2.10	2.11	68
中期(3-7)	602	98.25	98.47	4.04	0.97	1.41	1.40	3.96	3.93	3.95	73
長期(7-)	132	100.58	100.92	11.04	2.03	2.02	2.03	9.77	9.67	9.74	86
長期(7-11)	73	97.55	97.89	8.84	1.44	1.78	1.76	8.28	8.21	8.27	77
超長期(11-)	59	104.36	104.68	13.77	2.75	2.30	2.34	11.50	11.37	11.44	96
BBB格	1,166	98.08	98.44	3.90	1.22	1.76	1.74	3.67	3.63	3.67	108
短期(1-3)	591	99.00	99.32	2.29	1.11	1.57	1.57	2.26	2.24	2.26	100
中期(3-7)	437	97.61	97.96	3.91	1.10	1.77	1.75	3.82	3.78	3.82	109
長期(7-)	138	95.69	96.19	10.77	2.05	2.55	2.50	9.43	9.31	9.40	136
長期(7-11)	79	97.40	98.00	8.57	1.89	2.29	2.27	7.86	7.77	7.85	131
超長期(11-)	59	93.38	93.76	13.75	2.25	2.92	2.83	11.65	11.49	11.60	144
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12月末、1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	532	99.18	99.38	3.19	0.81	1.09	1.09	3.14	3.12	3.14	47
短期 (1-3)	329	99.44	99.62	2.30	0.77	1.04	1.04	2.28	2.27	2.28	47
中期 (3-7)	189	98.91	99.11	4.41	0.87	1.16	1.15	4.33	4.30	4.33	46
長期 (7-)	14	96.95	97.26	7.87	0.94	1.42	1.39	7.58	7.53	7.58	49
長期 (7-11)	14	96.95	97.26	7.87	0.94	1.42	1.39	7.58	7.53	7.58	49
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AAA~A 格	2,509	99.14	99.34	3.47	1.04	1.34	1.34	3.32	3.30	3.32	69
短期 (1-3)	1,538	99.41	99.59	2.21	0.97	1.25	1.25	2.18	2.17	2.18	69
中期 (3-7)	802	98.43	98.65	4.15	0.97	1.36	1.35	4.06	4.04	4.06	67
長期 (7-)	169	100.10	100.41	11.77	2.02	2.06	2.07	10.15	10.04	10.10	86
長期 (7-11)	96	97.67	98.00	8.80	1.45	1.78	1.76	8.24	8.17	8.24	78
超長期 (11-)	73	103.27	103.59	15.67	2.77	2.41	2.45	12.52	12.37	12.41	96
AAA~BBB 格	3,675	98.81	99.06	3.61	1.10	1.47	1.46	3.43	3.41	3.43	81
短期 (1-3)	2,152	99.27	99.50	2.24	1.01	1.34	1.34	2.21	2.20	2.21	78
中期 (3-7)	1,221	98.15	98.42	4.10	1.02	1.50	1.49	4.01	3.98	4.01	82
長期 (7-)	301	98.12	98.51	11.41	2.04	2.29	2.26	9.90	9.79	9.86	108
長期 (7-11)	169	97.54	97.97	8.76	1.66	2.02	1.99	8.12	8.04	8.12	102
超長期 (11-)	132	98.86	99.20	14.81	2.54	2.63	2.61	12.16	12.00	12.07	116
AAA~BB 格	3,675	98.81	99.06	3.61	1.10	1.47	1.46	3.43	3.41	3.43	81
短期 (1-3)	2,152	99.27	99.50	2.24	1.01	1.34	1.34	2.21	2.20	2.21	78
中期 (3-7)	1,221	98.15	98.42	4.10	1.02	1.50	1.49	4.01	3.98	4.01	82
長期 (7-)	301	98.12	98.51	11.41	2.04	2.29	2.26	9.90	9.79	9.86	108
長期 (7-11)	169	97.54	97.97	8.76	1.66	2.02	1.99	8.12	8.04	8.12	102
超長期 (11-)	132	98.86	99.20	14.81	2.54	2.63	2.61	12.16	12.00	12.07	116
AAA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA 格	532	99.18	99.38	3.19	0.81	1.09	1.09	3.14	3.12	3.14	47
短期 (1-3)	329	99.44	99.62	2.30	0.77	1.04	1.04	2.28	2.27	2.28	47
中期 (3-7)	189	98.91	99.11	4.41	0.87	1.16	1.15	4.33	4.30	4.33	46
長期 (7-)	14	96.95	97.26	7.87	0.94	1.42	1.39	7.58	7.53	7.58	49
長期 (7-11)	14	96.95	97.26	7.87	0.94	1.42	1.39	7.58	7.53	7.58	49
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
A 格	1,977	99.13	99.34	3.55	1.10	1.41	1.40	3.37	3.35	3.37	76
短期 (1-3)	1,209	99.40	99.58	2.18	1.02	1.31	1.31	2.16	2.14	2.16	75
中期 (3-7)	612	98.29	98.51	4.07	1.00	1.42	1.41	3.98	3.95	3.98	74
長期 (7-)	156	100.37	100.69	12.12	2.12	2.12	2.12	10.37	10.26	10.31	89
長期 (7-11)	82	97.79	98.12	8.96	1.54	1.84	1.82	8.35	8.28	8.35	83
超長期 (11-)	73	103.27	103.59	15.67	2.77	2.41	2.45	12.52	12.37	12.41	96
BBB 格	1,166	98.08	98.44	3.90	1.22	1.76	1.74	3.67	3.63	3.67	108
短期 (1-3)	614	98.94	99.26	2.32	1.10	1.57	1.57	2.29	2.27	2.29	100
中期 (3-7)	420	97.62	97.98	4.01	1.13	1.78	1.76	3.90	3.87	3.90	110
長期 (7-)	132	95.58	96.07	10.95	2.07	2.58	2.53	9.57	9.45	9.54	138
長期 (7-11)	73	97.35	97.94	8.70	1.92	2.33	2.30	7.96	7.87	7.95	133
超長期 (11-)	59	93.38	93.76	13.75	2.25	2.92	2.83	11.65	11.49	11.60	144
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12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	236	99.40	99.77	2.99	1.20	1.37	1.37	2.88	2.86	2.88	76
短期 (1-3)	166	99.72	100.13	2.10	1.15	1.29	1.28	2.07	2.06	2.07	73
中期 (3-7)	55	99.05	99.29	3.96	1.20	1.45	1.45	3.87	3.84	3.87	79
長期 (7-)	15	97.08	97.53	9.36	1.72	2.09	2.06	8.46	8.37	8.44	104
長期 (7-11)	11	97.80	98.20	7.65	1.62	1.95	1.93	7.18	7.12	7.18	105
超長期 (11-)	4	95.21	95.81	13.75	1.99	2.45	2.39	11.82	11.68	11.76	100
AAA~A 格	891	98.60	98.86	3.04	1.00	1.45	1.44	2.96	2.94	2.96	83
短期 (1-3)	505	99.24	99.48	2.09	0.93	1.31	1.31	2.07	2.05	2.07	75
中期 (3-7)	351	97.95	98.23	3.84	1.04	1.60	1.59	3.76	3.73	3.76	93
長期 (7-)	35	95.87	96.28	8.71	1.41	1.97	1.93	8.09	8.01	8.08	97
長期 (7-11)	31	95.95	96.34	8.03	1.33	1.91	1.87	7.59	7.52	7.59	96
超長期 (11-)	4	95.21	95.81	13.75	1.99	2.45	2.39	11.82	11.68	11.76	100
AAA~BBB 格	891	98.60	98.86	3.04	1.00	1.45	1.44	2.96	2.94	2.96	83
短期 (1-3)	505	99.24	99.48	2.09	0.93	1.31	1.31	2.07	2.05	2.07	75
中期 (3-7)	351	97.95	98.23	3.84	1.04	1.60	1.59	3.76	3.73	3.76	93
長期 (7-)	35	95.87	96.28	8.71	1.41	1.97	1.93	8.09	8.01	8.08	97
長期 (7-11)	31	95.95	96.34	8.03	1.33	1.91	1.87	7.59	7.52	7.59	96
超長期 (11-)	4	95.21	95.81	13.75	1.99	2.45	2.39	11.82	11.68	11.76	100
AAA~BB 格	891	98.60	98.86	3.04	1.00	1.45	1.44	2.96	2.94	2.96	83
短期 (1-3)	505	99.24	99.48	2.09	0.93	1.31	1.31	2.07	2.05	2.07	75
中期 (3-7)	351	97.95	98.23	3.84	1.04	1.60	1.59	3.76	3.73	3.76	93
長期 (7-)	35	95.87	96.28	8.71	1.41	1.97	1.93	8.09	8.01	8.08	97
長期 (7-11)	31	95.95	96.34	8.03	1.33	1.91	1.87	7.59	7.52	7.59	96
超長期 (11-)	4	95.21	95.81	13.75	1.99	2.45	2.39	11.82	11.68	11.76	100
AAA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA 格	236	99.40	99.77	2.99	1.20	1.37	1.37	2.88	2.86	2.88	76
短期 (1-3)	166	99.72	100.13	2.10	1.15	1.29	1.28	2.07	2.06	2.07	73
中期 (3-7)	55	99.05	99.29	3.96	1.20	1.45	1.45	3.87	3.84	3.87	79
長期 (7-)	15	97.08	97.53	9.36	1.72	2.09	2.06	8.46	8.37	8.44	104
長期 (7-11)	11	97.80	98.20	7.65	1.62	1.95	1.93	7.18	7.12	7.18	105
超長期 (11-)	4	95.21	95.81	13.75	1.99	2.45	2.39	11.82	11.68	11.76	100
A 格	655	98.31	98.53	3.06	0.92	1.48	1.47	2.99	2.97	2.99	85
短期 (1-3)	339	99.00	99.16	2.08	0.83	1.32	1.32	2.06	2.05	2.06	76
中期 (3-7)	296	97.75	98.03	3.82	1.01	1.63	1.61	3.74	3.71	3.74	96
長期 (7-)	20	94.98	95.36	8.22	1.18	1.89	1.84	7.82	7.74	7.81	91
長期 (7-11)	20	94.98	95.36	8.22	1.18	1.89	1.84	7.82	7.74	7.81	91
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	2,555	98.79	99.04	3.70	1.08	1.46	1.45	3.52	3.49	3.52	79
短期 (1-3)	1,469	99.26	99.48	2.24	0.97	1.31	1.30	2.21	2.20	2.21	74
中期 (3-7)	838	98.11	98.38	4.08	0.98	1.47	1.46	3.99	3.97	3.99	79
長期 (7-)	248	98.33	98.74	11.05	2.06	2.28	2.26	9.70	9.59	9.67	110
長期 (7-11)	135	97.77	98.25	8.77	1.68	2.01	1.99	8.12	8.04	8.11	102
超長期 (11-)	113	98.99	99.34	13.76	2.52	2.59	2.58	11.56	11.42	11.51	119

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12月末、1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	301	99.50	99.81	3.28	1.16	1.30	1.29	3.18	3.16	3.18	67
短期 (1-3)	191	99.74	100.11	2.20	1.11	1.23	1.23	2.18	2.16	2.18	67
中期 (3-7)	101	99.30	99.51	4.67	1.18	1.35	1.34	4.53	4.50	4.53	64
長期 (7-)	9	96.41	96.71	11.06	1.84	2.23	2.20	9.81	9.70	9.78	103
長期 (7-11)	4	97.56	97.57	8.49	1.70	2.03	2.01	7.94	7.86	7.93	106
超長期 (11-)	4	95.21	95.81	13.75	1.99	2.45	2.39	11.82	11.68	11.76	100
AAA~A 格	956	98.68	98.93	3.13	0.99	1.42	1.41	3.05	3.03	3.05	80
短期 (1-3)	556	99.18	99.42	2.17	0.92	1.30	1.30	2.15	2.13	2.15	74
中期 (3-7)	371	98.20	98.46	4.10	1.08	1.55	1.54	4.01	3.97	4.01	87
長期 (7-)	29	95.40	95.76	9.07	1.37	1.99	1.95	8.41	8.33	8.40	95
長期 (7-11)	25	95.43	95.75	8.27	1.27	1.91	1.87	7.84	7.76	7.83	94
超長期 (11-)	4	95.21	95.81	13.75	1.99	2.45	2.39	11.82	11.68	11.76	100
AAA~BBB 格	956	98.68	98.93	3.13	0.99	1.42	1.41	3.05	3.03	3.05	80
短期 (1-3)	556	99.18	99.42	2.17	0.92	1.30	1.30	2.15	2.13	2.15	74
中期 (3-7)	371	98.20	98.46	4.10	1.08	1.55	1.54	4.01	3.97	4.01	87
長期 (7-)	29	95.40	95.76	9.07	1.37	1.99	1.95	8.41	8.33	8.40	95
長期 (7-11)	25	95.43	95.75	8.27	1.27	1.91	1.87	7.84	7.76	7.83	94
超長期 (11-)	4	95.21	95.81	13.75	1.99	2.45	2.39	11.82	11.68	11.76	100
AAA~BB 格	956	98.68	98.93	3.13	0.99	1.42	1.41	3.05	3.03	3.05	80
短期 (1-3)	556	99.18	99.42	2.17	0.92	1.30	1.30	2.15	2.13	2.15	74
中期 (3-7)	371	98.20	98.46	4.10	1.08	1.55	1.54	4.01	3.97	4.01	87
長期 (7-)	29	95.40	95.76	9.07	1.37	1.99	1.95	8.41	8.33	8.40	95
長期 (7-11)	25	95.43	95.75	8.27	1.27	1.91	1.87	7.84	7.76	7.83	94
超長期 (11-)	4	95.21	95.81	13.75	1.99	2.45	2.39	11.82	11.68	11.76	100
AAA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA 格	301	99.50	99.81	3.28	1.16	1.30	1.29	3.18	3.16	3.18	67
短期 (1-3)	191	99.74	100.11	2.20	1.11	1.23	1.23	2.18	2.16	2.18	67
中期 (3-7)	101	99.30	99.51	4.67	1.18	1.35	1.34	4.53	4.50	4.53	64
長期 (7-)	9	96.41	96.71	11.06	1.84	2.23	2.20	9.81	9.70	9.78	103
長期 (7-11)	4	97.56	97.57	8.49	1.70	2.03	2.01	7.94	7.86	7.93	106
超長期 (11-)	4	95.21	95.81	13.75	1.99	2.45	2.39	11.82	11.68	11.76	100
A 格	655	98.31	98.53	3.06	0.92	1.48	1.47	2.99	2.97	2.99	85
短期 (1-3)	365	98.89	99.06	2.15	0.82	1.34	1.34	2.13	2.12	2.13	78
中期 (3-7)	270	97.78	98.06	3.89	1.04	1.63	1.62	3.80	3.77	3.80	96
長期 (7-)	20	94.98	95.36	8.22	1.18	1.89	1.84	7.82	7.74	7.81	91
長期 (7-11)	20	94.98	95.36	8.22	1.18	1.89	1.84	7.82	7.74	7.81	91
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	2,719	98.85	99.10	3.78	1.13	1.49	1.48	3.57	3.54	3.56	82
短期 (1-3)	1,597	99.31	99.52	2.26	1.04	1.36	1.35	2.24	2.22	2.24	79
中期 (3-7)	851	98.14	98.40	4.10	1.00	1.48	1.47	4.01	3.98	4.01	79
長期 (7-)	272	98.41	98.81	11.66	2.11	2.32	2.30	10.06	9.94	10.01	109
長期 (7-11)	144	97.90	98.36	8.84	1.72	2.03	2.02	8.17	8.09	8.16	103
超長期 (11-)	128	98.98	99.31	14.85	2.56	2.63	2.61	12.17	12.01	12.08	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 12 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	325	99.17	99.48	3.09	1.02	1.28	1.27	3.00	2.98	3.00	66
短期 (1-3)	224	99.55	99.90	2.23	0.95	1.17	1.17	2.20	2.19	2.20	61
中期 (3-7)	79	98.98	99.17	3.99	1.11	1.39	1.38	3.90	3.87	3.90	72
長期 (7-)	22	95.98	96.37	8.63	1.36	1.93	1.89	7.98	7.90	7.97	93
長期 (7-11)	18	96.16	96.50	7.44	1.21	1.81	1.78	7.09	7.03	7.09	92
超長期 (11-)	4	95.21	95.81	13.75	1.99	2.45	2.39	11.82	11.68	11.76	100
AAA ~ A 格	1,206	98.88	99.22	4.19	1.37	1.68	1.67	3.89	3.85	3.88	98
短期 (1-3)	732	99.47	99.79	2.22	1.24	1.48	1.47	2.18	2.17	2.18	91
中期 (3-7)	274	97.84	98.17	4.17	1.15	1.71	1.70	4.06	4.03	4.06	102
長期 (7-)	200	98.16	98.58	11.47	2.17	2.41	2.38	9.96	9.84	9.92	118
長期 (7-11)	82	97.16	97.68	8.20	1.70	2.14	2.11	7.62	7.53	7.61	119
超長期 (11-)	118	98.86	99.21	13.76	2.50	2.59	2.57	11.57	11.42	11.51	118
AAA ~ BBB 格	1,206	98.88	99.22	4.19	1.37	1.68	1.67	3.89	3.85	3.88	98
短期 (1-3)	732	99.47	99.79	2.22	1.24	1.48	1.47	2.18	2.17	2.18	91
中期 (3-7)	274	97.84	98.17	4.17	1.15	1.71	1.70	4.06	4.03	4.06	102
長期 (7-)	200	98.16	98.58	11.47	2.17	2.41	2.38	9.96	9.84	9.92	118
長期 (7-11)	82	97.16	97.68	8.20	1.70	2.14	2.11	7.62	7.53	7.61	119
超長期 (11-)	118	98.86	99.21	13.76	2.50	2.59	2.57	11.57	11.42	11.51	118
AAA ~ BB 格	1,206	98.88	99.22	4.19	1.37	1.68	1.67	3.89	3.85	3.88	98
短期 (1-3)	732	99.47	99.79	2.22	1.24	1.48	1.47	2.18	2.17	2.18	91
中期 (3-7)	274	97.84	98.17	4.17	1.15	1.71	1.70	4.06	4.03	4.06	102
長期 (7-)	200	98.16	98.58	11.47	2.17	2.41	2.38	9.96	9.84	9.92	118
長期 (7-11)	82	97.16	97.68	8.20	1.70	2.14	2.11	7.62	7.53	7.61	119
超長期 (11-)	118	98.86	99.21	13.76	2.50	2.59	2.57	11.57	11.42	11.51	118
AAA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA 格	325	99.17	99.48	3.09	1.02	1.28	1.27	3.00	2.98	3.00	66
短期 (1-3)	224	99.55	99.90	2.23	0.95	1.17	1.17	2.20	2.19	2.20	61
中期 (3-7)	79	98.98	99.17	3.99	1.11	1.39	1.38	3.90	3.87	3.90	72
長期 (7-)	22	95.98	96.37	8.63	1.36	1.93	1.89	7.98	7.90	7.97	93
長期 (7-11)	18	96.16	96.50	7.44	1.21	1.81	1.78	7.09	7.03	7.09	92
超長期 (11-)	4	95.21	95.81	13.75	1.99	2.45	2.39	11.82	11.68	11.76	100
A 格	881	98.78	99.12	4.60	1.50	1.83	1.82	4.22	4.17	4.21	110
短期 (1-3)	508	99.43	99.74	2.21	1.36	1.61	1.61	2.18	2.16	2.18	105
中期 (3-7)	196	97.38	97.77	4.25	1.16	1.85	1.83	4.13	4.09	4.13	115
長期 (7-)	178	98.43	98.86	11.83	2.27	2.46	2.44	10.20	10.08	10.16	121
長期 (7-11)	64	97.44	98.01	8.41	1.83	2.23	2.21	7.76	7.67	7.75	126
超長期 (11-)	113	98.99	99.34	13.76	2.52	2.59	2.58	11.56	11.42	11.51	119
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	2,240	98.67	98.88	3.17	0.89	1.33	1.32	3.10	3.08	3.10	70
短期 (1-3)	1,242	99.12	99.29	2.19	0.79	1.21	1.21	2.17	2.16	2.17	65
中期 (3-7)	914	98.13	98.38	3.96	0.96	1.45	1.44	3.88	3.86	3.88	77
長期 (7-)	84	97.69	98.10	9.05	1.54	1.85	1.83	8.41	8.34	8.41	83
長期 (7-11)	84	97.69	98.10	9.05	1.54	1.85	1.83	8.41	8.34	8.41	83
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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12月末、1月ポートフォリオ)

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
AAA~AA 格	325	99.17	99.48	3.09	1.02	1.28	1.27	3.00	2.98	3.00	66
短期 (1-3)	224	99.55	99.90	2.23	0.95	1.17	1.17	2.20	2.19	2.20	61
中期 (3-7)	85	98.90	99.13	4.22	1.15	1.43	1.42	4.11	4.08	4.11	74
長期 (7-)	16	95.18	95.45	9.26	1.27	1.94	1.90	8.53	8.45	8.51	88
長期 (7-11)	12	95.16	95.31	7.64	1.02	1.76	1.72	7.33	7.27	7.33	84
超長期 (11-)	4	95.21	95.81	13.75	1.99	2.45	2.39	11.82	11.68	11.76	100
AAA~A 格	1,370	98.99	99.31	4.30	1.44	1.72	1.71	3.94	3.90	3.93	102
短期 (1-3)	860	99.53	99.83	2.27	1.33	1.54	1.54	2.23	2.22	2.23	97
中期 (3-7)	293	97.92	98.26	4.29	1.19	1.73	1.71	4.17	4.13	4.17	103
長期 (7-)	217	98.28	98.67	12.33	2.24	2.45	2.43	10.48	10.35	10.42	118
長期 (7-11)	85	97.38	97.85	8.47	1.77	2.18	2.15	7.83	7.75	7.83	120
超長期 (11-)	132	98.86	99.20	14.81	2.54	2.63	2.61	12.16	12.00	12.07	116
AAA~BBB 格	1,370	98.99	99.31	4.30	1.44	1.72	1.71	3.94	3.90	3.93	102
短期 (1-3)	860	99.53	99.83	2.27	1.33	1.54	1.54	2.23	2.22	2.23	97
中期 (3-7)	293	97.92	98.26	4.29	1.19	1.73	1.71	4.17	4.13	4.17	103
長期 (7-)	217	98.28	98.67	12.33	2.24	2.45	2.43	10.48	10.35	10.42	118
長期 (7-11)	85	97.38	97.85	8.47	1.77	2.18	2.15	7.83	7.75	7.83	120
超長期 (11-)	132	98.86	99.20	14.81	2.54	2.63	2.61	12.16	12.00	12.07	116
AAA~BB 格	1,370	98.99	99.31	4.30	1.44	1.72	1.71	3.94	3.90	3.93	102
短期 (1-3)	860	99.53	99.83	2.27	1.33	1.54	1.54	2.23	2.22	2.23	97
中期 (3-7)	293	97.92	98.26	4.29	1.19	1.73	1.71	4.17	4.13	4.17	103
長期 (7-)	217	98.28	98.67	12.33	2.24	2.45	2.43	10.48	10.35	10.42	118
長期 (7-11)	85	97.38	97.85	8.47	1.77	2.18	2.15	7.83	7.75	7.83	120
超長期 (11-)	132	98.86	99.20	14.81	2.54	2.63	2.61	12.16	12.00	12.07	116
AAA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA 格	325	99.17	99.48	3.09	1.02	1.28	1.27	3.00	2.98	3.00	66
短期 (1-3)	224	99.55	99.90	2.23	0.95	1.17	1.17	2.20	2.19	2.20	61
中期 (3-7)	85	98.90	99.13	4.22	1.15	1.43	1.42	4.11	4.08	4.11	74
長期 (7-)	16	95.18	95.45	9.26	1.27	1.94	1.90	8.53	8.45	8.51	88
長期 (7-11)	12	95.16	95.31	7.64	1.02	1.76	1.72	7.33	7.27	7.33	84
超長期 (11-)	4	95.21	95.81	13.75	1.99	2.45	2.39	11.82	11.68	11.76	100
A 格	1,045	98.93	99.26	4.67	1.57	1.86	1.85	4.23	4.19	4.22	113
短期 (1-3)	636	99.53	99.81	2.28	1.46	1.67	1.67	2.24	2.22	2.24	110
中期 (3-7)	208	97.52	97.90	4.32	1.21	1.85	1.83	4.19	4.15	4.19	115
長期 (7-)	201	98.53	98.93	12.57	2.31	2.49	2.47	10.62	10.49	10.56	120
長期 (7-11)	74	97.73	98.26	8.60	1.89	2.24	2.22	7.91	7.82	7.90	126
超長期 (11-)	128	98.98	99.31	14.85	2.56	2.63	2.61	12.17	12.01	12.08	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	2,305	98.70	98.91	3.20	0.89	1.32	1.31	3.13	3.11	3.13	69
短期 (1-3)	1,293	99.10	99.27	2.22	0.79	1.21	1.21	2.20	2.19	2.20	64
中期 (3-7)	928	98.23	98.47	4.04	0.97	1.43	1.42	3.96	3.93	3.96	75
長期 (7-)	84	97.69	98.10	9.05	1.54	1.85	1.83	8.41	8.34	8.41	83
長期 (7-11)	84	97.69	98.10	9.05	1.54	1.85	1.83	8.41	8.34	8.41	83
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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12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	1,414	98.82	99.02	3.24	0.83	1.22	1.22	3.17	3.15	3.17	59
短期 (1-3)	784	99.16	99.33	2.23	0.72	1.12	1.12	2.21	2.20	2.21	55
中期 (3-7)	573	98.48	98.71	4.08	0.94	1.32	1.31	3.99	3.97	3.99	64
長期 (7-)	58	97.56	97.89	8.72	1.31	1.65	1.63	8.22	8.15	8.22	65
長期 (7-11)	58	97.56	97.89	8.72	1.31	1.65	1.63	8.22	8.15	8.22	65
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AAA~A 格	2,335	99.05	99.25	3.38	0.97	1.30	1.30	3.27	3.24	3.26	66
短期 (1-3)	1,392	99.35	99.53	2.17	0.87	1.18	1.17	2.15	2.14	2.15	61
中期 (3-7)	783	98.30	98.52	4.05	0.94	1.38	1.36	3.96	3.94	3.96	70
長期 (7-)	161	100.00	100.35	10.65	1.94	2.01	2.01	9.50	9.40	9.48	87
長期 (7-11)	103	97.51	97.88	8.87	1.48	1.83	1.81	8.28	8.20	8.27	82
超長期 (11-)	59	104.36	104.68	13.77	2.75	2.30	2.34	11.50	11.37	11.44	96
AAA~BBB 格	3,340	98.76	99.02	3.56	1.05	1.43	1.42	3.40	3.38	3.40	78
短期 (1-3)	1,898	99.28	99.51	2.21	0.94	1.27	1.27	2.18	2.17	2.18	71
中期 (3-7)	1,158	98.10	98.37	4.02	1.00	1.50	1.48	3.93	3.90	3.93	82
長期 (7-)	284	98.02	98.44	10.76	1.98	2.24	2.22	9.50	9.40	9.48	108
長期 (7-11)	166	97.43	97.89	8.63	1.62	1.99	1.97	8.02	7.94	8.01	101
超長期 (11-)	118	98.86	99.21	13.76	2.50	2.59	2.57	11.57	11.42	11.51	118
AAA~BB 格	3,340	98.76	99.02	3.56	1.05	1.43	1.42	3.40	3.38	3.40	78
短期 (1-3)	1,898	99.28	99.51	2.21	0.94	1.27	1.27	2.18	2.17	2.18	71
中期 (3-7)	1,158	98.10	98.37	4.02	1.00	1.50	1.48	3.93	3.90	3.93	82
長期 (7-)	284	98.02	98.44	10.76	1.98	2.24	2.22	9.50	9.40	9.48	108
長期 (7-11)	166	97.43	97.89	8.63	1.62	1.99	1.97	8.02	7.94	8.01	101
超長期 (11-)	118	98.86	99.21	13.76	2.50	2.59	2.57	11.57	11.42	11.51	118
AAA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA 格	1,414	98.82	99.02	3.24	0.83	1.22	1.22	3.17	3.15	3.17	59
短期 (1-3)	784	99.16	99.33	2.23	0.72	1.12	1.12	2.21	2.20	2.21	55
中期 (3-7)	573	98.48	98.71	4.08	0.94	1.32	1.31	3.99	3.97	3.99	64
長期 (7-)	58	97.56	97.89	8.72	1.31	1.65	1.63	8.22	8.15	8.22	65
長期 (7-11)	58	97.56	97.89	8.72	1.31	1.65	1.63	8.22	8.15	8.22	65
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
A 格	921	99.39	99.60	3.60	1.17	1.42	1.41	3.41	3.38	3.40	76
短期 (1-3)	608	99.60	99.79	2.09	1.06	1.25	1.25	2.07	2.06	2.07	69
中期 (3-7)	210	97.81	97.99	3.96	0.95	1.52	1.50	3.88	3.85	3.88	84
長期 (7-)	103	101.37	101.73	11.73	2.29	2.20	2.22	10.19	10.08	10.15	99
長期 (7-11)	45	97.45	97.86	9.06	1.69	2.07	2.05	8.35	8.26	8.34	104
超長期 (11-)	59	104.36	104.68	13.77	2.75	2.30	2.34	11.50	11.37	11.44	96
BBB 格	1,005	98.11	98.50	3.97	1.23	1.74	1.73	3.72	3.69	3.72	105
短期 (1-3)	506	99.09	99.45	2.31	1.12	1.54	1.54	2.27	2.26	2.27	97
中期 (3-7)	376	97.68	98.06	3.96	1.11	1.75	1.73	3.86	3.83	3.86	107
長期 (7-)	123	95.41	95.91	10.89	2.04	2.57	2.51	9.51	9.39	9.48	136
長期 (7-11)	64	97.30	97.91	8.24	1.84	2.26	2.23	7.61	7.52	7.60	130
超長期 (11-)	59	93.38	93.76	13.75	2.25	2.92	2.83	11.65	11.49	11.60	144
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	106	97.99	98.13	2.51	1.37	2.16	2.15	2.47	2.44	2.47	157
短期 (1-3)	76	98.46	98.56	2.01	1.47	2.22	2.21	1.98	1.96	1.98	166
中期 (3-7)	30	96.81	97.05	3.78	1.12	2.02	1.99	3.71	3.67	3.71	134
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

出所:NFRC

- 格付は、Moody's の格付をもとに NFRC で分類

円建外債 Moody's 格付別・ポートフォリオ指標 (2024年12月末、1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	538	99.16	99.35	3.22	0.82	1.10	1.09	3.16	3.15	3.16	47
短期 (1-3)	329	99.44	99.62	2.30	0.77	1.04	1.04	2.28	2.27	2.28	47
中期 (3-7)	195	98.86	99.06	4.46	0.88	1.17	1.17	4.37	4.34	4.37	48
長期 (7-)	14	96.95	97.26	7.87	0.94	1.42	1.39	7.58	7.53	7.58	49
長期 (7-11)	14	96.95	97.26	7.87	0.94	1.42	1.39	7.58	7.53	7.58	49
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AAA~A 格	2,498	99.09	99.29	3.54	0.99	1.31	1.30	3.38	3.36	3.38	66
短期 (1-3)	1,485	99.39	99.56	2.22	0.89	1.18	1.17	2.19	2.18	2.19	61
中期 (3-7)	830	98.39	98.60	4.12	0.96	1.36	1.35	4.03	4.00	4.03	68
長期 (7-)	183	99.91	100.24	11.63	2.01	2.08	2.08	10.06	9.95	10.01	88
長期 (7-11)	110	97.66	98.01	8.93	1.51	1.84	1.82	8.33	8.25	8.32	83
超長期 (11-)	73	103.27	103.59	15.67	2.77	2.41	2.45	12.52	12.37	12.41	96
AAA~BBB 格	3,502	98.81	99.07	3.66	1.06	1.43	1.42	3.48	3.45	3.48	77
短期 (1-3)	2,015	99.29	99.51	2.25	0.94	1.27	1.27	2.22	2.21	2.22	71
中期 (3-7)	1,188	98.18	98.45	4.10	1.01	1.48	1.47	4.01	3.98	4.01	80
長期 (7-)	299	98.11	98.50	11.43	2.03	2.28	2.26	9.91	9.80	9.87	107
長期 (7-11)	167	97.51	97.95	8.74	1.63	2.00	1.98	8.12	8.04	8.11	100
超長期 (11-)	132	98.86	99.20	14.81	2.54	2.63	2.61	12.16	12.00	12.07	116
AAA~BB 格	3,502	98.81	99.07	3.66	1.06	1.43	1.42	3.48	3.45	3.48	77
短期 (1-3)	2,015	99.29	99.51	2.25	0.94	1.27	1.27	2.22	2.21	2.22	71
中期 (3-7)	1,188	98.18	98.45	4.10	1.01	1.48	1.47	4.01	3.98	4.01	80
長期 (7-)	299	98.11	98.50	11.43	2.03	2.28	2.26	9.91	9.80	9.87	107
長期 (7-11)	167	97.51	97.95	8.74	1.63	2.00	1.98	8.12	8.04	8.11	100
超長期 (11-)	132	98.86	99.20	14.81	2.54	2.63	2.61	12.16	12.00	12.07	116
AAA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA 格	538	99.16	99.35	3.22	0.82	1.10	1.09	3.16	3.15	3.16	47
短期 (1-3)	329	99.44	99.62	2.30	0.77	1.04	1.04	2.28	2.27	2.28	47
中期 (3-7)	195	98.86	99.06	4.46	0.88	1.17	1.17	4.37	4.34	4.37	48
長期 (7-)	14	96.95	97.26	7.87	0.94	1.42	1.39	7.58	7.53	7.58	49
長期 (7-11)	14	96.95	97.26	7.87	0.94	1.42	1.39	7.58	7.53	7.58	49
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
A 格	1,960	99.08	99.28	3.62	1.04	1.36	1.36	3.44	3.41	3.44	71
短期 (1-3)	1,156	99.37	99.54	2.19	0.92	1.22	1.21	2.17	2.16	2.17	65
中期 (3-7)	635	98.25	98.47	4.01	0.98	1.42	1.41	3.93	3.90	3.93	75
長期 (7-)	169	100.15	100.49	11.94	2.10	2.13	2.13	10.26	10.14	10.20	91
長期 (7-11)	96	97.76	98.12	9.09	1.59	1.90	1.88	8.43	8.35	8.43	87
超長期 (11-)	73	103.27	103.59	15.67	2.77	2.41	2.45	12.52	12.37	12.41	96
BBB 格	1,005	98.11	98.50	3.97	1.23	1.74	1.73	3.72	3.69	3.72	105
短期 (1-3)	530	99.01	99.38	2.34	1.11	1.54	1.54	2.31	2.29	2.31	97
中期 (3-7)	358	97.70	98.09	4.08	1.14	1.76	1.75	3.97	3.93	3.97	108
長期 (7-)	116	95.27	95.76	11.10	2.06	2.61	2.55	9.67	9.54	9.64	138
長期 (7-11)	57	97.22	97.83	8.37	1.87	2.30	2.27	7.71	7.62	7.71	133
超長期 (11-)	59	93.38	93.76	13.75	2.25	2.92	2.83	11.65	11.49	11.60	144
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	173	98.70	98.89	2.58	1.81	2.32	2.31	2.50	2.47	2.50	173
短期 (1-3)	137	99.08	99.26	2.09	1.91	2.35	2.35	2.05	2.02	2.05	180
中期 (3-7)	33	97.09	97.34	4.09	1.30	2.13	2.10	3.96	3.92	3.96	143
長期 (7-)	2	99.48	99.84	9.89	3.29	3.36	3.35	8.49	8.35	8.47	229
長期 (7-11)	2	99.48	99.84	9.89	3.29	3.36	3.35	8.49	8.35	8.47	229
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12月末)

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
AAA~AA 格	491	99.13	99.35	3.08	0.78	1.07	1.06	3.03	3.02	3.03	45
短期 (1-3)	323	99.44	99.65	2.34	0.76	1.01	1.01	2.32	2.31	2.32	44
中期 (3-7)	154	98.67	98.90	4.21	0.81	1.16	1.16	4.13	4.11	4.13	48
長期 (7-)	14	96.95	97.26	7.87	0.94	1.42	1.39	7.58	7.53	7.58	49
長期 (7-11)	14	96.95	97.26	7.87	0.94	1.42	1.39	7.58	7.53	7.58	49
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AAA~A 格	2,281	99.06	99.26	3.35	0.96	1.29	1.29	3.24	3.21	3.24	66
短期 (1-3)	1,367	99.34	99.53	2.18	0.87	1.18	1.18	2.16	2.15	2.16	62
中期 (3-7)	770	98.31	98.53	4.04	0.94	1.37	1.36	3.96	3.93	3.96	69
長期 (7-)	143	100.35	100.69	10.79	1.94	1.97	1.97	9.61	9.51	9.58	82
長期 (7-11)	85	97.57	97.91	8.72	1.39	1.72	1.70	8.20	8.13	8.19	73
超長期 (11-)	59	104.36	104.68	13.77	2.75	2.30	2.34	11.50	11.37	11.44	96
AAA~BBB 格	3,387	98.74	99.00	3.55	1.05	1.44	1.44	3.40	3.37	3.39	79
短期 (1-3)	1,923	99.25	99.48	2.21	0.94	1.29	1.28	2.19	2.17	2.19	72
中期 (3-7)	1,183	98.07	98.34	4.01	1.00	1.51	1.50	3.92	3.89	3.92	83
長期 (7-)	282	98.06	98.48	10.78	1.99	2.25	2.23	9.52	9.42	9.50	108
長期 (7-11)	164	97.49	97.95	8.65	1.63	2.00	1.98	8.03	7.95	8.03	101
超長期 (11-)	118	98.86	99.21	13.76	2.50	2.59	2.57	11.57	11.42	11.51	118
AAA~BB 格	3,387	98.74	99.00	3.55	1.05	1.44	1.44	3.40	3.37	3.39	79
短期 (1-3)	1,923	99.25	99.48	2.21	0.94	1.29	1.28	2.19	2.17	2.19	72
中期 (3-7)	1,183	98.07	98.34	4.01	1.00	1.51	1.50	3.92	3.89	3.92	83
長期 (7-)	282	98.06	98.48	10.78	1.99	2.25	2.23	9.52	9.42	9.50	108
長期 (7-11)	164	97.49	97.95	8.65	1.63	2.00	1.98	8.03	7.95	8.03	101
超長期 (11-)	118	98.86	99.21	13.76	2.50	2.59	2.57	11.57	11.42	11.51	118
AAA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA 格	491	99.13	99.35	3.08	0.78	1.07	1.06	3.03	3.02	3.03	45
短期 (1-3)	323	99.44	99.65	2.34	0.76	1.01	1.01	2.32	2.31	2.32	44
中期 (3-7)	154	98.67	98.90	4.21	0.81	1.16	1.16	4.13	4.11	4.13	48
長期 (7-)	14	96.95	97.26	7.87	0.94	1.42	1.39	7.58	7.53	7.58	49
長期 (7-11)	14	96.95	97.26	7.87	0.94	1.42	1.39	7.58	7.53	7.58	49
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
A 格	1,790	99.04	99.24	3.42	1.01	1.36	1.35	3.29	3.27	3.29	71
短期 (1-3)	1,044	99.31	99.49	2.13	0.91	1.23	1.23	2.11	2.10	2.11	67
中期 (3-7)	616	98.22	98.44	4.00	0.97	1.42	1.41	3.91	3.89	3.91	74
長期 (7-)	130	100.71	101.05	11.10	2.05	2.02	2.03	9.81	9.71	9.78	86
長期 (7-11)	71	97.69	98.04	8.89	1.47	1.78	1.76	8.32	8.25	8.31	77
超長期 (11-)	59	104.36	104.68	13.77	2.75	2.30	2.34	11.50	11.37	11.44	96
BBB 格	1,106	98.09	98.45	3.97	1.23	1.76	1.74	3.73	3.69	3.72	107
短期 (1-3)	555	99.02	99.34	2.29	1.10	1.56	1.55	2.25	2.24	2.25	99
中期 (3-7)	412	97.64	98.00	3.96	1.12	1.77	1.76	3.86	3.82	3.86	109
長期 (7-)	138	95.69	96.19	10.77	2.05	2.55	2.50	9.43	9.31	9.40	136
長期 (7-11)	79	97.40	98.00	8.57	1.89	2.29	2.27	7.86	7.77	7.85	131
超長期 (11-)	59	93.38	93.76	13.75	2.25	2.92	2.83	11.65	11.49	11.60	144
BB 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
B 格以下	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
格付なし	59	98.76	98.94	2.17	1.52	2.02	2.01	2.12	2.10	2.12	146
短期 (1-3)	51	99.31	99.50	1.70	1.68	2.10	2.09	1.67	1.66	1.67	156
中期 (3-7)	6	96.31	96.37	4.39	0.58	1.48	1.45	4.34	4.31	4.34	76
長期 (7-)	2	92.76	92.97	7.10	0.51	1.65	1.59	6.96	6.90	6.96	76
長期 (7-11)	2	92.76	92.97	7.10	0.51	1.65	1.59	6.96	6.90	6.96	76
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12月末、1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	556	99.21	99.42	3.23	0.80	1.06	1.06	3.17	3.16	3.17	44
短期 (1-3)	348	99.47	99.67	2.38	0.76	1.00	1.00	2.36	2.35	2.36	43
中期 (3-7)	194	98.91	99.12	4.42	0.87	1.15	1.15	4.33	4.31	4.33	46
長期 (7-)	14	96.95	97.26	7.87	0.94	1.42	1.39	7.58	7.53	7.58	49
長期 (7-11)	14	96.95	97.26	7.87	0.94	1.42	1.39	7.58	7.53	7.58	49
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AAA~A 格	2,443	99.11	99.31	3.51	0.99	1.30	1.29	3.36	3.33	3.35	65
短期 (1-3)	1,461	99.38	99.56	2.23	0.89	1.18	1.18	2.21	2.19	2.21	62
中期 (3-7)	817	98.40	98.62	4.11	0.95	1.36	1.35	4.03	4.00	4.03	68
長期 (7-)	165	100.20	100.52	11.86	2.02	2.05	2.06	10.21	10.10	10.16	84
長期 (7-11)	92	97.75	98.07	8.82	1.43	1.74	1.73	8.27	8.19	8.26	74
超長期 (11-)	73	103.27	103.59	15.67	2.77	2.41	2.45	12.52	12.37	12.41	96
AAA~BBB 格	3,549	98.79	99.04	3.65	1.06	1.44	1.43	3.47	3.44	3.47	78
短期 (1-3)	2,040	99.26	99.48	2.25	0.95	1.29	1.28	2.23	2.21	2.23	72
中期 (3-7)	1,212	98.16	98.42	4.09	1.02	1.50	1.48	4.00	3.97	4.00	81
長期 (7-)	297	98.15	98.54	11.46	2.04	2.28	2.26	9.93	9.82	9.89	107
長期 (7-11)	165	97.57	98.01	8.76	1.65	2.00	1.98	8.13	8.05	8.12	100
超長期 (11-)	132	98.86	99.20	14.81	2.54	2.63	2.61	12.16	12.00	12.07	116
AAA~BB 格	3,549	98.79	99.04	3.65	1.06	1.44	1.43	3.47	3.44	3.47	78
短期 (1-3)	2,040	99.26	99.48	2.25	0.95	1.29	1.28	2.23	2.21	2.23	72
中期 (3-7)	1,212	98.16	98.42	4.09	1.02	1.50	1.48	4.00	3.97	4.00	81
長期 (7-)	297	98.15	98.54	11.46	2.04	2.28	2.26	9.93	9.82	9.89	107
長期 (7-11)	165	97.57	98.01	8.76	1.65	2.00	1.98	8.13	8.05	8.12	100
超長期 (11-)	132	98.86	99.20	14.81	2.54	2.63	2.61	12.16	12.00	12.07	116
AAA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA 格	556	99.21	99.42	3.23	0.80	1.06	1.06	3.17	3.16	3.17	44
短期 (1-3)	348	99.47	99.67	2.38	0.76	1.00	1.00	2.36	2.35	2.36	43
中期 (3-7)	194	98.91	99.12	4.42	0.87	1.15	1.15	4.33	4.31	4.33	46
長期 (7-)	14	96.95	97.26	7.87	0.94	1.42	1.39	7.58	7.53	7.58	49
長期 (7-11)	14	96.95	97.26	7.87	0.94	1.42	1.39	7.58	7.53	7.58	49
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
A 格	1,887	99.07	99.28	3.59	1.04	1.37	1.36	3.41	3.39	3.41	71
短期 (1-3)	1,113	99.35	99.52	2.18	0.93	1.24	1.24	2.16	2.14	2.16	68
中期 (3-7)	623	98.24	98.46	4.01	0.98	1.42	1.41	3.93	3.90	3.93	75
長期 (7-)	151	100.50	100.82	12.22	2.12	2.11	2.11	10.44	10.33	10.39	87
長期 (7-11)	78	97.89	98.22	8.98	1.52	1.80	1.78	8.39	8.31	8.38	79
超長期 (11-)	73	103.27	103.59	15.67	2.77	2.41	2.45	12.52	12.37	12.41	96
BBB 格	1,106	98.09	98.45	3.97	1.23	1.76	1.74	3.73	3.69	3.72	107
短期 (1-3)	579	98.96	99.28	2.32	1.09	1.56	1.55	2.29	2.27	2.29	99
中期 (3-7)	395	97.66	98.02	4.06	1.15	1.79	1.77	3.95	3.92	3.95	110
長期 (7-)	132	95.58	96.07	10.95	2.07	2.58	2.53	9.57	9.45	9.54	138
長期 (7-11)	73	97.35	97.94	8.70	1.92	2.33	2.30	7.96	7.87	7.95	133
超長期 (11-)	59	93.38	93.76	13.75	2.25	2.92	2.83	11.65	11.49	11.60	144
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	126	99.33	99.56	2.44	2.04	2.31	2.31	2.35	2.32	2.35	174
短期 (1-3)	112	99.61	99.84	1.96	2.10	2.33	2.32	1.92	1.90	1.92	178
中期 (3-7)	9	97.47	97.63	5.28	1.44	2.06	2.04	5.03	4.98	5.03	131
長期 (7-)	5	96.20	96.48	8.53	1.93	2.55	2.52	7.77	7.67	7.76	157
長期 (7-11)	5	96.20	96.48	8.53	1.93	2.55	2.52	7.77	7.67	7.76	157
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12月末
銘柄数	13,875	14,702	15,303	15,524	16,009	16,111
額面(10億円)	970,751	1,016,799	1,055,162	1,084,026	1,123,852	1,143,272
時価単価(円)	108.41	106.49	104.20	101.51	98.40	95.32
利含単価(円)	108.53	106.60	104.31	101.62	98.50	95.47
残存年数(年)	9.85	9.89	10.02	10.17	10.21	10.26
利率(%)	0.89	0.83	0.79	0.77	0.78	0.83
単利(%)	0.08	0.14	0.27	0.43	0.73	1.14
複利(%)	0.08	0.14	0.27	0.43	0.72	1.10
Dur(年)	9.47	9.36	9.32	9.19	8.93	8.71
M-Dur	9.46	9.35	9.30	9.16	8.88	8.64
E-Dur	9.46	9.34	9.29	9.16	8.90	8.66
Tspd(bp)	5	4	3	5	4	5

出所:NFRFC

NOMURA-BPI の定義

NOMURA-BPI の銘柄組入基準

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

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

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

累積投資収益指数の計算方法

ある時点における投資収益指数は以下の計算式から算出される。

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

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

各ポートフォリオの累積投資収益指数は以下の基準日を 100 としている。

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

ただし、

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

投資収益率の計算方法

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

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

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

レポートの表記等について

投資収益率 投資収益指数

- 「前月末からの投資収益率」は、「2024 年 11 月の月末営業日から 2024 年 12 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 12 月の月末営業日までの投資収益率（年率換算、%）」を指す。
- 「前年未からの投資収益率」は、「2023 年 12 月の月末営業日から 2024 年 12 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 11 月の月末営業日から 2024 年 12 月の月末営業日までの投資収益率（年率換算、%）。
- 2024 年 11 月の月末営業日において、12 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 12 月ポートフォリオの、右ページには 1 月ポートフォリオの、2024 年 12 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 12 月末（暦上）における残存年数（至最終償還日）で区分。ただし 1 月ポートフォリオでは、2025 年 1 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