

NOMURA-BPI

月間投資収益率 (2023年10月末)

累積投資 収益指数	前月末からの投資収益率			過去からの期間投資収益率	
	トータル	キャピタル	インカム	前年度末	前年末
総合 359.551	-18.17	-18.95	0.78	-7.02	-2.37

出所: 野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング(NFRC)

(注) 投資収益率は年率換算(%)

ポートフォリオ指標 (2023年10月末)

	翌月ポート (2023年11月)	当月ポート (2023年10月)	差
額面[兆円]	1123.34	1112.62	10.72
デュレーション[年]	8.82	8.78	0.04
修正デュレーション	8.76	8.73	0.04
時価単価[円]	96.81	96.80	0.00
利含単価[円]	96.98	96.97	0.00
残存年数[年]	10.19	10.14	0.04
利率[%]	0.77	0.77	0.00
単利[%]	0.86	0.86	0.00
複利[%]	0.84	0.83	0.00
Tスプレッド[bp]	5	5	0

出所: NFRC

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

Global Markets Research

2023年11月2日

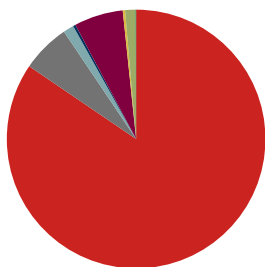
リサーチアナリスト

インデックスプロダクト

インデックス事業部 - NFRC

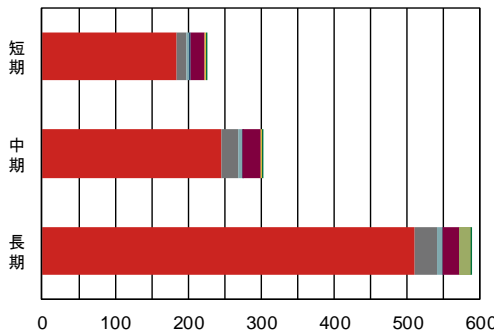
bpi@nfrc.co.jp

銘柄別額面構成 (2023年10月末)



出所: NFRC

残存別額面構成 (2023年10月末)



出所: NFRC

(兆円)

	国債	地方債	政保債	金融債	事業債	円建外債	MBS	ABS
構成比	84.5%	6.1%	1.3%	0.3%	6.1%	0.3%	1.3%	0.1%
全体	940.24	67.53	14.80	3.44	68.17	3.23	14.49	0.73
短期	184.23	13.11	4.07	1.89	19.67	1.47	-	0.21
中期	245.16	23.80	4.42	1.32	24.97	1.46	-	0.28
長期	510.84	30.62	6.32	0.22	23.53	0.29	14.49	0.24

出所: NFRC

(兆円)

目次

銘柄別・投資収益率 投資収益指数	2
総合 残存別・投資収益率 投資収益指数	3
国債 残存別・投資収益率 投資収益指数	4
「除く MBS」残存別・投資収益率 投資収益指数	6
「除く ABS」残存別・投資収益率 投資収益指数	7
「除く国債」残存別・投資収益率 投資収益指数	8
銘柄 残存別・月間投資収益率	9
「除く(銘柄)」残存別・月間投資収益率	9
事業債 業種別・月間投資収益率	10
事業債 円建外債 格付別・月間投資収益率	10
事業債 円建外債 格付会社別・月間投資収益率	11
銘柄 残存別・ポートフォリオ指標	15
「除く」銘柄 残存別・ポートフォリオ指標	16
事業債 業種別・ポートフォリオ指標	19
事業債 円建外債 格付別・ポートフォリオ指標	27
事業債 格付会社別・ポートフォリオ指標	29
円建外債 格付会社別・ポートフォリオ指標	41
NOMURA-BPI/Extended 総合・ポートフォリオ指標の推移	53
NOMURA-BPI/Extended の定義	54
レポートの表記等について	55
NOMURA-BPI/Extended のデータ提供について	56
ディスクレイマー	57

銘柄別・投資収益率(2023年10月末)

	累積投資 収益指数	前月末からの投資収益率			過去からの投資収益率	
		トータル	キャピタル	インカム	前年度末	前年末
総合	359.551	-18.17	-18.95	0.78	-7.02	-2.37
国債	369.972	-19.11	-19.91	0.80	-7.53	-2.56
地方債	384.497	-12.73	-13.32	0.58	-4.33	-1.42
政保債	360.606	-15.62	-16.30	0.68	-5.87	-2.19
金融債	272.197	-3.53	-3.71	0.19	-1.14	-0.33
事業債	380.155	-13.50	-14.19	0.69	-4.01	-1.18
円建外債	385.826	-3.97	-5.06	1.09	0.27	1.62
MBS	123.591	-13.69	-14.35	0.65	-4.11	-1.86
ABS	112.264	-8.27	-8.98	0.71	-2.99	-0.84

出所:NFRC

投資収益率は年率換算(%)

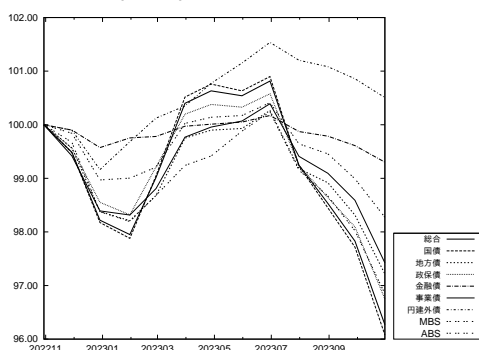
銘柄別・累積投資収益指数の推移

年/月/日	総合	国債	地方債	政保債	金融債	事業債	円建外債	MBS	ABS
2022/10/31	373.485	385.073	395.507	372.720	274.111	390.213	383.880	127.615	114.237
2022/11/30	371.562	383.056	393.790	371.079	273.836	387.935	383.489	127.195	114.055
2022/12/30	366.831	378.048	389.098	367.323	272.941	383.938	380.664	125.543	113.060
2023/01/31	365.832	376.912	388.427	366.456	273.435	383.641	382.663	125.310	113.098
2023/02/28	369.809	381.409	390.292	369.789	273.512	385.565	384.356	125.933	113.332
2023/03/31	374.979	387.058	394.518	373.453	274.033	389.309	385.220	126.646	114.264
2023/04/28	375.844	387.993	395.109	374.132	274.139	390.041	386.847	126.871	114.395
2023/05/31	375.504	387.508	395.233	373.940	274.244	390.482	388.297	127.463	114.432
2023/06/30	376.529	388.532	396.555	374.873	274.584	391.739	389.779	127.918	114.706
2023/07/31	370.665	382.115	392.260	369.886	273.762	387.914	388.498	126.534	113.829
2023/08/31	368.001	379.098	391.224	367.657	273.527	386.676	388.035	125.918	113.616
2023/09/29	365.371	376.276	388.838	365.613	273.040	384.709	387.175	125.093	113.084
2023/10/02	364.786	375.631	388.471	365.116	272.985	384.329	386.988	124.962	113.020
2023/10/03	364.901	375.742	388.679	365.230	273.061	384.470	387.042	124.999	113.077
2023/10/04	363.555	374.292	387.540	364.088	272.874	383.450	386.529	124.634	112.835
2023/10/05	363.552	374.267	387.728	364.077	272.962	383.535	386.704	124.686	112.899
2023/10/06	363.554	374.260	387.827	364.099	272.956	383.521	386.966	124.725	112.927
2023/10/10	364.238	374.985	388.518	364.689	273.129	384.083	387.265	124.931	113.093
2023/10/11	364.605	375.393	388.738	364.979	273.157	384.276	387.583	124.993	113.138
2023/10/12	365.514	376.379	389.421	365.766	273.312	384.953	387.826	125.228	113.285
2023/10/13	365.174	376.005	389.216	365.497	273.302	384.704	387.663	125.180	113.247
2023/10/16	365.110	375.925	389.308	365.468	273.340	384.637	387.671	125.196	113.283
2023/10/17	364.115	374.835	388.618	364.606	273.208	383.954	387.480	124.985	113.146
2023/10/18	363.384	374.058	387.926	363.944	273.042	383.377	386.952	124.742	112.996
2023/10/19	362.404	373.001	387.091	363.115	272.868	382.656	386.614	124.479	112.820
2023/10/20	362.299	372.872	387.141	363.066	272.917	382.625	386.722	124.483	112.840
2023/10/23	361.257	371.731	386.448	362.188	272.836	381.879	386.500	124.234	112.717
2023/10/24	361.903	372.433	386.990	362.748	272.946	382.290	386.877	124.364	112.837
2023/10/25	362.032	372.592	386.938	362.828	272.930	382.320	386.781	124.341	112.821
2023/10/26	361.097	371.597	386.031	362.017	272.722	381.579	386.473	124.092	112.614
2023/10/27	361.327	371.848	386.234	362.223	272.760	381.713	386.446	124.119	112.665
2023/10/30	360.779	371.265	385.747	361.743	272.599	381.213	386.280	123.973	112.557
2023/10/31	359.551	369.972	384.497	360.606	272.197	380.155	385.826	123.591	112.264

出所:NFRC

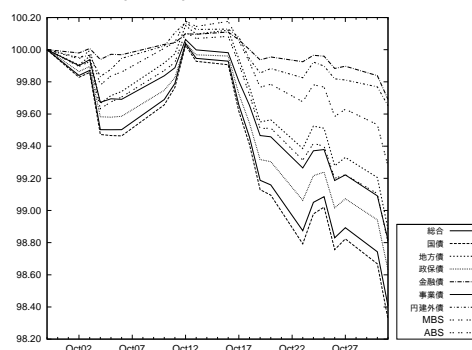
1983年12月末=100。MBSセクターは2003年3月末=100。ABSセクターは2008年3月末=100

指数の推移(月次) 2022年10月末=100に補正。



出所:NFRC

指数の推移(日次) 2023年9月末=100に補正。



出所:NFRC

総合 残存別・投資収益率(2023年10月末)

	累積投資 収益指数	前月末からの投資収益率			過去からの投資収益率	
		トータル	キャピタル	インカム	前年度末	前年末
総合	359.551	-18.17	-18.95	0.78	-7.02	-2.37
短期 (1-3)	234.523	-1.67	-2.05	0.39	-0.57	-0.08
中期 (3-7)	334.930	-5.96	-6.54	0.58	-2.30	-0.49
長期 (7-)	525.707	-31.36	-32.40	1.04	-11.93	-4.30
長期 (7-11)	189.819	-15.13	-16.03	0.90	-6.20	-2.52
超長期 (11-)	233.407	-40.74	-41.86	1.12	-15.13	-5.33
(11-15)	220.021	-25.73	-26.83	1.10	-9.48	-3.59
(15-)	240.245	-46.31	-47.43	1.12	-17.15	-5.94

出所:NFRC

投資収益率は年率換算(%)

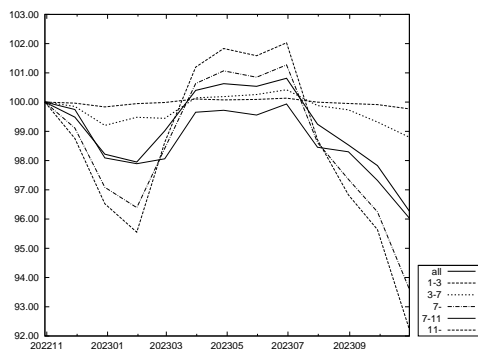
総合 残存別・投資収益指数の推移

総合 年/月/日	全体	短期 (1-3)	中期 (3-7)	長期 (7-)	長期*			
					(7-11)	超長期*	(11-15)*	(15-)*
2022/10/31	373.485	235.065	339.002	561.668	197.669	253.093	233.580	262.534
2022/11/30	371.562	234.981	338.499	556.678	197.167	249.947	231.870	258.744
2022/12/30	366.831	234.680	336.298	545.294	193.897	244.291	226.835	252.799
2023/01/31	365.832	234.942	337.243	541.391	193.503	241.830	224.450	250.294
2023/02/28	369.809	235.033	337.121	552.766	193.836	249.607	228.285	259.770
2023/03/31	374.979	235.316	339.500	565.245	196.983	256.120	232.970	267.099
2023/04/28	375.844	235.239	339.635	567.673	197.116	257.735	233.998	268.974
2023/05/31	375.504	235.282	339.878	566.454	196.793	257.109	233.662	268.221
2023/06/30	376.529	235.383	340.435	568.815	197.545	258.230	234.627	269.413
2023/07/31	370.665	235.064	338.602	553.897	194.618	249.831	229.215	259.732
2023/08/31	368.001	234.953	338.102	546.820	194.308	245.058	227.707	253.597
2023/09/29	365.371	234.867	336.689	540.570	192.370	242.053	225.098	250.412
2023/10/02	364.786	234.845	336.545	539.036	192.191	241.099	224.676	249.234
2023/10/03	364.901	234.871	336.704	539.204	192.418	241.053	224.891	249.079
2023/10/04	363.555	234.829	336.282	535.743	191.606	239.198	223.616	246.975
2023/10/05	363.552	234.847	336.520	535.514	191.811	238.888	223.633	246.528
2023/10/06	363.554	234.842	336.507	535.533	191.921	238.821	223.821	246.355
2023/10/10	364.238	234.897	336.895	537.112	192.422	239.572	224.581	247.107
2023/10/11	364.605	234.898	336.972	538.096	192.539	240.183	224.883	247.848
2023/10/12	365.514	234.955	337.300	540.368	192.913	241.516	225.622	249.434
2023/10/13	365.174	234.966	337.217	539.455	192.797	240.954	225.354	248.748
2023/10/16	365.110	234.968	337.333	539.170	192.911	240.670	225.446	248.308
2023/10/17	364.115	234.906	337.113	536.561	192.517	239.114	224.515	246.484
2023/10/18	363.384	234.853	336.727	534.847	192.062	238.234	223.800	245.531
2023/10/19	362.404	234.791	336.355	532.412	191.496	236.925	222.961	244.021
2023/10/20	362.299	234.815	336.442	532.014	191.553	236.602	222.996	243.549
2023/10/23	361.257	234.789	336.242	529.222	191.190	234.894	222.057	241.513
2023/10/24	361.903	234.819	336.508	530.815	191.546	235.760	222.645	242.500
2023/10/25	362.032	234.821	336.504	531.187	191.390	236.137	222.526	243.083
2023/10/26	361.097	234.754	335.981	529.021	190.745	235.075	221.521	241.992
2023/10/27	361.327	234.752	336.123	529.558	190.900	235.342	221.642	242.320
2023/10/30	360.779	234.670	335.772	528.364	190.628	234.696	221.163	241.602
2023/10/31	359.551	234.523	334.930	525.707	189.819	233.407	220.021	240.245

出所:NFRC

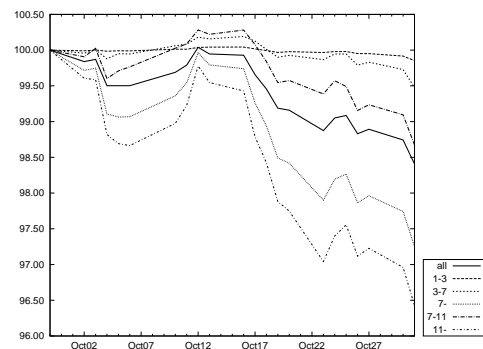
* は 1995年12月末=100。それ以外は、1983年12月末=100。

指数の推移(月次) 2022年10月末=100に補正。



出所:NFRC

指数の推移(日次) 2023年9月末=100に補正。



出所:NFRC

国債 残存別・投資収益率(2023年10月末)

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

出所:NFRC

投資収益率は年率換算(%)

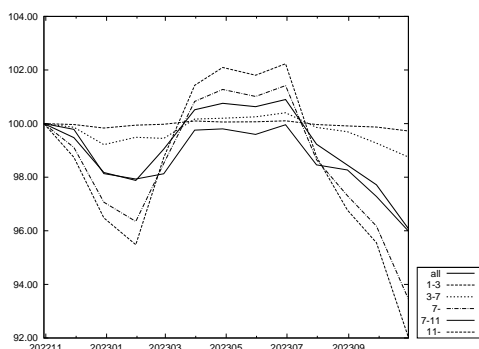
国債 残存別・投資収益指数の推移

国債 年/月/日	全体	短期 (1-3)	中期 (3-7)	長期 (7-)	長期*	超長期*		
					(7-11)	(11-)	(11-15)*	(15-)*
2022/10/31	385.073	221.832	337.907	573.331	196.192	252.275	231.389	262.467
2022/11/30	383.056	221.755	337.448	568.232	195.771	249.099	229.786	258.562
2022/12/30	378.048	221.465	335.254	556.512	192.531	243.401	224.804	252.526
2023/01/31	376.912	221.701	336.181	552.400	192.135	240.876	222.443	249.919
2023/02/28	381.409	221.778	336.044	564.797	192.519	249.082	226.298	260.054
2023/03/31	387.058	222.051	338.477	578.073	195.711	255.876	231.011	267.806
2023/04/28	387.993	221.963	338.580	580.635	195.804	257.564	232.036	269.795
2023/05/31	387.508	221.983	338.758	579.142	195.401	256.830	231.673	268.894
2023/06/30	388.532	222.065	339.276	581.457	196.110	257.907	232.618	270.034
2023/07/31	382.115	221.754	337.431	565.612	193.170	249.154	227.207	259.815
2023/08/31	379.098	221.638	336.877	557.899	192.799	244.125	225.661	253.299
2023/09/29	376.276	221.548	335.443	551.388	190.852	241.059	223.053	250.022
2023/10/02	375.631	221.527	335.299	549.751	190.672	240.063	222.633	248.778
2023/10/03	375.742	221.551	335.457	549.903	190.899	240.004	222.846	248.603
2023/10/04	374.292	221.513	335.042	546.286	190.095	238.098	221.588	246.414
2023/10/05	374.267	221.528	335.279	546.006	190.298	237.759	221.602	245.924
2023/10/06	374.260	221.523	335.261	546.004	190.406	237.679	221.790	245.731
2023/10/10	374.985	221.573	335.646	547.637	190.905	238.441	222.544	246.501
2023/10/11	375.393	221.573	335.725	548.697	191.025	239.084	222.847	247.290
2023/10/12	376.379	221.626	336.049	551.097	191.396	240.465	223.580	248.952
2023/10/13	376.005	221.636	335.966	550.123	191.283	239.878	223.318	248.224
2023/10/16	375.925	221.637	336.081	549.807	191.396	239.578	223.409	247.759
2023/10/17	374.835	221.579	335.861	547.039	191.001	237.960	222.484	245.840
2023/10/18	374.058	221.530	335.478	545.262	190.550	237.065	221.777	244.860
2023/10/19	373.001	221.472	335.109	542.708	189.988	235.716	220.946	243.285
2023/10/20	372.872	221.494	335.195	542.261	190.045	235.367	220.979	242.773
2023/10/23	371.731	221.468	334.994	539.308	189.682	233.599	220.061	240.637
2023/10/24	372.433	221.496	335.259	540.998	190.040	234.502	220.653	241.676
2023/10/25	372.592	221.497	335.257	541.436	189.885	234.915	220.535	242.315
2023/10/26	371.597	221.435	334.735	539.183	189.242	233.832	219.536	241.190
2023/10/27	371.848	221.432	334.878	539.758	189.397	234.115	219.660	241.542
2023/10/30	371.265	221.356	334.528	538.516	189.126	233.456	219.189	240.801
2023/10/31	369.972	221.219	333.693	535.772	188.324	232.150	218.060	239.413

出所:NFRC

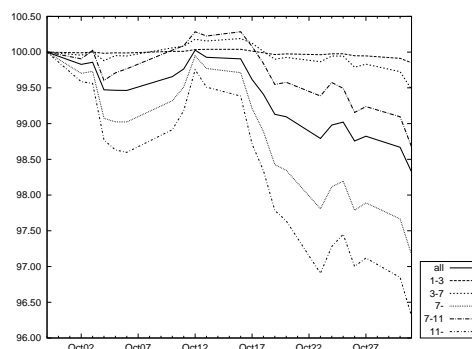
* は1995年12月末=100。それ以外は、1983年12月末=100。

指数の推移(月次) 2022年10月末=100に補正。



出所:NFRC

指数の推移(日次) 2023年9月末=100に補正。



出所:NFRC

このページは空白です。

「除くMBS」残存別・投資収益率(2023年10月末)

	累積投資 収益指数	前月末からの投資収益率			過去からの投資収益率	
		トータル	キャピタル	インカム	前年度末	前年末
除くMBS	359.425	-18.23	-19.01	0.78	-7.06	-2.38
短期(1-3)	234.523	-1.67	-2.05	0.39	-0.57	-0.08
中期(3-7)	334.930	-5.96	-6.54	0.58	-2.30	-0.49
長期(7-)	527.497	-31.81	-32.86	1.05	-12.13	-4.36
長期(7-11)	189.811	-15.14	-16.04	0.90	-6.21	-2.52
超長期(11-)	235.137	-41.83	-42.96	1.13	-15.55	-5.47
(11-15)	220.008	-25.73	-26.83	1.10	-9.48	-3.59
(15-)	242.330	-48.13	-49.28	1.14	-17.84	-6.16

出所:NFRC

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

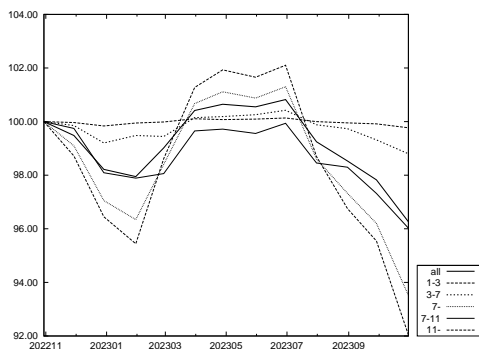
「除くMBS」残存別・投資収益指数の推移

除くMBS 年/月/日	全体	短期 (1-3)	中期 (3-7)	長期 (7-)	長期*			
					(7-11)	超長期* (11-)	(11-15)*	(15-)*
2022/10/31	373.382	235.065	339.002	564.074	197.668	255.470	233.580	265.646
2022/11/30	371.450	234.981	338.499	558.981	197.166	252.199	231.867	261.644
2022/12/30	366.722	234.680	336.298	547.438	193.894	246.392	226.822	255.485
2023/01/31	365.719	234.942	337.243	543.443	193.499	243.825	224.430	252.836
2023/02/28	369.723	235.033	337.121	555.092	193.832	251.944	228.271	262.887
2023/03/31	374.934	235.316	339.500	567.868	196.982	258.727	232.962	270.639
2023/04/28	375.802	235.239	339.635	570.344	197.114	260.404	233.990	272.616
2023/05/31	375.434	235.282	339.878	569.022	196.791	259.699	233.653	271.742
2023/06/30	376.454	235.383	340.435	571.403	197.544	260.839	234.619	272.962
2023/07/31	370.569	235.064	338.602	556.194	194.614	252.134	229.203	262.786
2023/08/31	367.894	234.953	338.102	548.975	194.304	247.175	227.695	256.311
2023/09/29	365.262	234.867	336.689	542.631	192.364	244.088	225.085	253.007
2023/10/02	364.674	234.845	336.545	541.066	192.185	243.098	224.663	251.764
2023/10/03	364.789	234.871	336.704	541.235	192.412	243.046	224.877	251.595
2023/10/04	363.439	234.829	336.282	537.713	191.600	241.129	223.603	249.391
2023/10/05	363.435	234.847	336.520	537.472	191.804	240.800	223.620	248.908
2023/10/06	363.435	234.842	336.507	537.486	191.914	240.726	223.808	248.720
2023/10/10	364.121	234.897	336.895	539.089	192.416	241.498	224.568	249.498
2023/10/11	364.489	234.898	336.972	540.095	192.533	242.133	224.869	250.282
2023/10/12	365.401	234.955	337.300	542.408	192.907	243.513	225.609	251.947
2023/10/13	365.059	234.966	337.217	541.473	192.792	242.928	225.341	251.221
2023/10/16	364.993	234.968	337.333	541.178	192.905	242.629	225.432	250.749
2023/10/17	363.994	234.906	337.113	538.516	192.511	241.013	224.502	248.828
2023/10/18	363.263	234.853	336.727	536.778	192.056	240.109	223.787	247.838
2023/10/19	362.280	234.791	336.355	534.300	191.489	238.757	222.949	246.257
2023/10/20	362.174	234.815	336.442	533.890	191.546	238.418	222.983	245.753
2023/10/23	361.128	234.789	336.242	531.043	191.183	236.645	222.044	243.609
2023/10/24	361.777	234.819	336.508	532.670	191.539	237.545	222.632	244.647
2023/10/25	361.908	234.821	336.504	533.055	191.383	237.941	222.513	245.272
2023/10/26	360.972	234.754	335.981	530.852	190.737	236.847	221.508	244.137
2023/10/27	361.203	234.752	336.123	531.402	190.892	237.125	221.629	244.484
2023/10/30	360.653	234.670	335.772	530.190	190.621	236.459	221.150	243.734
2023/10/31	359.425	234.523	334.930	527.497	189.811	235.137	220.008	242.330

出所:NFRC

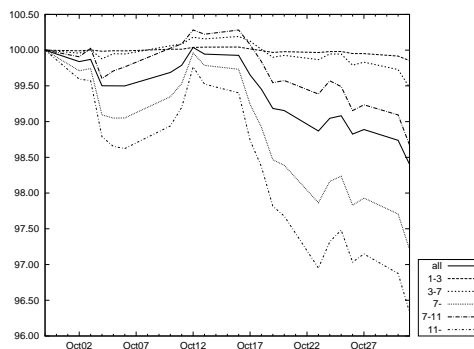
* は1995年12月末=100。それ以外は、1983年12月末=100。

指数の推移(月次) 2022年10月末=100に補正。



出所:NFRC

指数の推移(日次) 2023年9月末=100に補正。



出所:NFRC

「除くABS」残存別・投資収益率(2023年10月末)

	累積投資 収益指数	前月末からの投資収益率			過去からの投資収益率	
		トータル	キャピタル	インカム	前年度末	前年末
除くABS	359.577	-18.18	-18.95	0.78	-7.02	-2.38
短期(1-3)	234.483	-1.67	-2.05	0.39	-0.58	-0.08
中期(3-7)	334.927	-5.96	-6.54	0.58	-2.30	-0.49
長期(7-)	525.707	-31.37	-32.40	1.04	-11.93	-4.30
長期(7-11)	189.813	-15.13	-16.03	0.90	-6.20	-2.52
超長期(11-)	233.406	-40.74	-41.86	1.12	-15.13	-5.33
(11-15)	220.013	-25.73	-26.83	1.10	-9.48	-3.59
(15-)	240.247	-46.31	-47.43	1.12	-17.15	-5.94

出所:NFRC

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

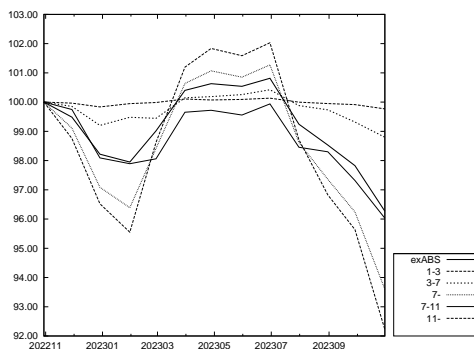
「除くABS」残存別 投資収益指数の推移

除くABS 年/月/日	全体	短期 (1-3)	中期 (3-7)	長期 (7-)	長期*			
					長期* (7-11)	超長期* (11-)	(11-15)*	(15-)*
2022/10/31	373.517	235.026	339.000	561.672	197.663	253.092	233.571	262.536
2022/11/30	371.593	234.943	338.497	556.681	197.162	249.945	231.862	258.746
2022/12/30	366.860	234.642	336.296	545.296	193.892	244.290	226.827	252.801
2023/01/31	365.861	234.903	337.242	541.393	193.497	241.829	224.442	250.296
2023/02/28	369.840	234.994	337.119	552.772	193.831	249.607	228.277	259.772
2023/03/31	375.012	235.277	339.498	565.252	196.978	256.120	232.963	267.102
2023/04/28	375.878	235.200	339.633	567.680	197.110	257.735	233.990	268.977
2023/05/31	375.537	235.243	339.876	566.461	196.788	257.109	233.654	268.224
2023/06/30	376.562	235.344	340.433	568.822	197.540	258.230	234.619	269.415
2023/07/31	370.696	235.024	338.600	553.902	194.612	249.830	229.207	259.735
2023/08/31	368.030	234.913	338.099	546.823	194.303	245.056	227.699	253.600
2023/09/29	365.400	234.827	336.686	540.572	192.364	242.052	225.090	250.414
2023/10/02	364.814	234.805	336.543	539.038	192.185	241.098	224.668	249.236
2023/10/03	364.929	234.831	336.701	539.206	192.412	241.052	224.883	249.081
2023/10/04	363.582	234.790	336.279	535.745	191.601	239.197	223.609	246.977
2023/10/05	363.580	234.807	336.518	535.516	191.805	238.886	223.625	246.530
2023/10/06	363.581	234.803	336.505	535.534	191.915	238.819	223.813	246.357
2023/10/10	364.266	234.857	336.892	537.113	192.416	239.570	224.573	247.109
2023/10/11	364.633	234.858	336.970	538.098	192.533	240.181	224.875	247.850
2023/10/12	365.542	234.916	337.297	540.370	192.907	241.514	225.614	249.436
2023/10/13	365.202	234.927	337.214	539.456	192.792	240.953	225.346	248.750
2023/10/16	365.138	234.928	337.330	539.171	192.905	240.669	225.438	248.310
2023/10/17	364.142	234.866	337.111	536.562	192.511	239.112	224.507	246.486
2023/10/18	363.411	234.813	336.724	534.848	192.056	238.232	223.792	245.533
2023/10/19	362.430	234.752	336.352	532.412	191.490	236.923	222.954	244.023
2023/10/20	362.326	234.776	336.440	532.014	191.547	236.601	222.988	243.551
2023/10/23	361.283	234.749	336.239	529.222	191.184	234.892	222.049	241.515
2023/10/24	361.929	234.779	336.505	530.816	191.540	235.759	222.637	242.502
2023/10/25	362.058	234.781	336.502	531.188	191.384	236.135	222.518	243.085
2023/10/26	361.124	234.714	335.978	529.021	190.739	235.074	221.513	241.994
2023/10/27	361.353	234.712	336.120	529.558	190.894	235.340	221.634	242.322
2023/10/30	360.805	234.631	335.769	528.364	190.622	234.695	221.155	241.604
2023/10/31	359.577	234.483	334.927	525.707	189.813	233.406	220.013	240.247

出所:NFRC

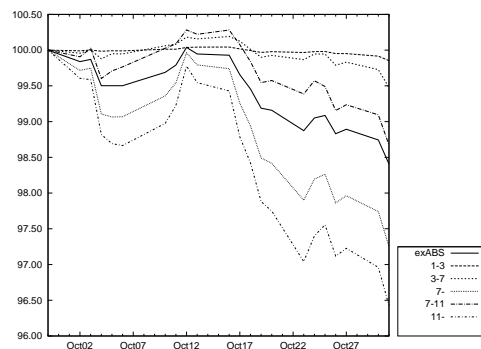
* は1995年12月末=100。それ以外は、1983年12月末=100。

指数の推移(月次) 2022年10月末=100に補正。



出所:NFRC

指数の推移(日次) 2023年9月末=100に補正。



出所:NFRC

「除く国債」残存別・投資収益率(2023年10月末)

	累積投資 収益指数	前月末からの投資収益率			過去からの投資収益率	
		トータル	キャピタル	インカム	前年度末	前年末
除く国債	168.674	-12.99	-13.64	0.64	-4.17	-1.35
短期(1-3)	134.006	-1.55	-1.94	0.39	-0.29	0.16
中期(3-7)	165.537	-6.00	-6.55	0.56	-1.79	-0.17
長期(7-)	228.783	-24.90	-25.75	0.84	-8.10	-3.12
長期(7-11)	194.698	-15.25	-16.02	0.76	-4.69	-1.87
超長期(11-)	233.783	-30.81	-31.71	0.90	-10.16	-3.86

出所:NFRC

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

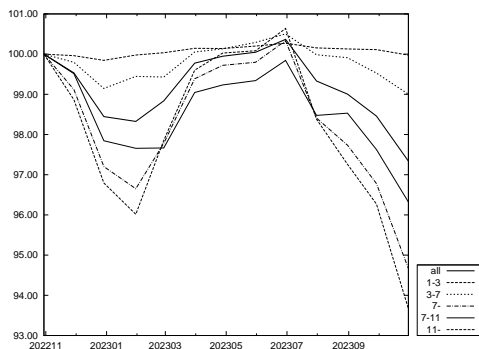
「除く国債」残存別・投資収益指数の推移

除く国債 年/月/日	全体	短期 (1-3)	中期 (3-7)	長期 (7-)	長期*	
					(7-11)	超長期* (11-)
2022/10/31	173.288	134.039	167.202	241.674	202.137	249.582
2022/11/30	172.478	133.987	166.861	239.542	201.156	246.751
2022/12/30	170.594	133.832	165.776	234.912	197.783	241.579
2023/01/31	170.388	134.010	166.275	233.583	197.402	239.635
2023/02/28	171.271	134.086	166.249	236.308	197.417	244.221
2023/03/31	172.898	134.232	167.289	240.192	200.206	248.586
2023/04/28	173.197	134.226	167.424	241.001	200.588	249.648
2023/05/31	173.369	134.307	167.687	241.188	200.808	249.792
2023/06/30	173.924	134.404	168.043	242.477	201.820	251.173
2023/07/31	172.129	134.246	167.177	237.832	199.054	245.540
2023/08/31	171.566	134.213	167.053	236.203	199.169	242.740
2023/09/29	170.617	134.189	166.412	233.890	197.337	240.274
2023/10/02	170.450	134.180	166.344	233.435	197.169	239.647
2023/10/03	170.522	134.196	166.422	233.563	197.388	239.695
2023/10/04	170.051	134.169	166.200	232.321	196.546	238.265
2023/10/05	170.107	134.182	166.320	232.356	196.759	238.164
2023/10/06	170.129	134.181	166.323	232.426	196.873	238.196
2023/10/10	170.400	134.218	166.519	233.043	197.378	238.841
2023/10/11	170.493	134.220	166.553	233.305	197.473	239.204
2023/10/12	170.793	134.256	166.719	234.049	197.857	240.150
2023/10/13	170.696	134.263	166.679	233.775	197.729	239.792
2023/10/16	170.702	134.266	166.738	233.726	197.842	239.626
2023/10/17	170.400	134.230	166.632	232.909	197.463	238.556
2023/10/18	170.118	134.196	166.437	232.250	196.995	237.813
2023/10/19	169.779	134.160	166.250	231.401	196.417	236.837
2023/10/20	169.782	134.175	166.294	231.348	196.469	236.711
2023/10/23	169.465	134.163	166.198	230.446	196.120	235.477
2023/10/24	169.673	134.183	166.331	230.948	196.453	236.061
2023/10/25	169.669	134.184	166.325	230.941	196.292	236.170
2023/10/26	169.315	134.144	166.068	230.126	195.654	235.295
2023/10/27	169.386	134.144	166.136	230.279	195.803	235.437
2023/10/30	169.174	134.097	165.963	229.835	195.529	234.905
2023/10/31	168.674	134.006	165.537	228.783	194.698	233.783

出所:NFRC

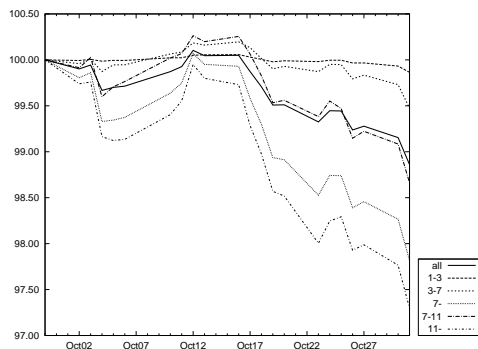
* は 1995年12月末=100。それ以外は、1993年12月末=100。

指数の推移(月次) 2022年10月末=100に補正。



出所:NFRC

指数の推移(日次) 2023年9月末=100に補正。



出所:NFRC

銘柄 残存別・月間投資収益率(2023年10月末)

	全体	短期 (1-3)	中期 (3-7)	長期 (7-)		
					(7-11)	(11-)
総合	-18.17	-1.67	-5.96	-31.36	-15.13	-40.74
国債	-19.11	-1.69	-5.95	-32.30	-15.11	-42.15
30年国債	-43.02	-	-7.67	-43.29	-16.29	-45.51
20年国債	-20.09	-1.84	-6.39	-26.74	-15.43	-33.75
10年国債	-7.90	-1.82	-6.38	-14.67	-14.67	-
5年国債	-3.11	-1.89	-4.43	-	-	-
中期国債	-0.97	-0.97	-	-	-	-
地方債	-12.73	-1.69	-6.21	-22.98	-14.58	-32.00
東京都債	-11.91	-1.65	-6.23	-23.47	-14.26	-38.82
五大都市債	-14.49	-1.76	-5.94	-25.75	-14.29	-31.70
その他地方債	-12.00	-1.69	-6.20	-21.64	-14.59	-29.78
政保債	-15.62	-1.46	-5.63	-32.64	-15.66	-39.12
公営企業債券	-3.39	-1.50	-5.14	-	-	-
その他政保債	-17.60	-1.45	-5.79	-32.64	-15.66	-39.12
金融債	-3.53	-1.69	-4.57	-13.59	-13.59	-
特定金融債	-	-	-	-	-	-
事業債	-13.50	-1.56	-6.04	-32.87	-16.60	-46.07
円建外債	-3.97	-0.39	-4.20	-21.82	-15.51	-28.95
MBS	-13.69	-	-	-13.69	-3.11	-13.87
ABS	-8.27	-1.07	-5.50	-18.70	-12.91	-29.92

出所:NFRG

「除く(銘柄)」残存別・月間投資収益率(2023年10月末)

	全体	短期 (1-3)	中期 (3-7)	長期 (7-)		
					(7-11)	(11-)
除く国債	-12.99	-1.55	-6.00	-24.90	-15.25	-30.81
除く30年国債	-13.72	-1.67	-5.95	-26.43	-15.05	-37.20
除く20年国債	-17.47	-1.65	-5.84	-33.93	-14.95	-44.48
除く10年国債	-21.77	-1.60	-5.66	-34.52	-15.48	-40.74
除く5年国債	-19.94	-1.59	-6.30	-31.36	-15.13	-40.74
除く中期国債	-18.70	-1.79	-5.96	-31.36	-15.13	-40.74
除く地方債	-18.52	-1.67	-5.94	-31.82	-15.17	-41.10
除く東京都債	-18.20	-1.67	-5.96	-31.39	-15.13	-40.75
除く五大都市債	-18.19	-1.67	-5.96	-31.39	-15.13	-40.79
除くその他地方債	-18.44	-1.67	-5.95	-31.71	-15.16	-41.03
除く政保債	-18.20	-1.67	-5.96	-31.35	-15.12	-40.76
除く公営企業債券	-18.20	-1.67	-5.96	-31.36	-15.13	-40.74
除くその他政保債	-18.18	-1.67	-5.96	-31.35	-15.12	-40.76
除く金融債	-18.21	-1.67	-5.97	-31.37	-15.13	-40.74
除く特定金融債	-18.17	-1.67	-5.96	-31.36	-15.13	-40.74
除く事業債	-18.47	-1.68	-5.95	-31.30	-15.06	-40.56
除く円建外債	-18.21	-1.68	-5.97	-31.37	-15.13	-40.75
除くMBS	-18.23	-1.67	-5.96	-31.81	-15.14	-41.83
除くABS	-18.18	-1.67	-5.96	-31.37	-15.13	-40.74
除くMBS・ABS	-18.23	-1.67	-5.96	-31.82	-15.14	-41.83

出所:NFRG

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

事業債 業種別・月間投資収益率 (2023年10月末)

	全体	短期 (1-3)	中期 (3-7)	長期 (7-)	月間投資収益率	
					(7-11)	(11-)
事業債 全体	-13.50	-1.56	-6.04	-32.87	-16.60	-46.07
水産・農林業	-6.79	-	-6.79	-	-	-
鉱業	-8.39	-2.16	-	-11.66	-11.66	-
建設業	-6.16	-1.49	-5.38	-21.67	-14.32	-31.82
食料品	-7.79	-1.89	-5.38	-24.76	-15.68	-36.15
繊維製品	-5.81	-1.19	-4.73	-30.65	-	-30.65
パルプ・紙	-7.38	-1.61	-5.57	-21.53	-11.73	-34.77
化学	-8.48	-1.31	-5.34	-22.38	-13.76	-34.64
医薬品	-10.92	-2.49	-5.91	-17.56	-12.98	-30.31
石油・石炭製品	-10.25	-1.53	-6.53	-17.60	-14.37	-34.72
ゴム製品	-5.82	-2.35	-5.86	-13.97	-13.97	-
ガラス・土石製品	-9.49	-1.81	-5.16	-20.17	-14.74	-35.02
鉄鋼	-4.32	-1.44	-5.79	-15.34	-15.34	-
非鉄金属	-6.12	-1.68	-5.11	-15.57	-15.57	-
金属製品	-4.56	-1.59	-5.14	-15.65	-15.65	-
機械	-6.01	-1.61	-5.20	-14.31	-14.31	-
電気機器	-4.54	-1.58	-5.80	-13.71	-13.71	-
輸送用機器	-6.15	-1.61	-4.89	-18.71	-13.87	-28.18
精密機器	-6.00	-1.11	-6.94	-13.98	-13.98	-
その他製品	-11.73	-1.16	-7.00	-27.69	-12.15	-33.43
電気・ガス業	-18.41	-1.47	-7.72	-37.46	-21.69	-53.56
陸運業	-24.31	-1.64	-6.66	-39.00	-16.35	-49.97
海運業	-6.59	-2.01	-6.00	-13.63	-13.63	-
空運業	-12.49	-1.78	-5.24	-26.67	-15.80	-29.67
倉庫・運輸関連業	-8.43	-0.75	-7.01	-25.48	-11.39	-33.10
情報・通信業	-7.44	-1.72	-5.70	-24.39	-18.33	-41.32
卸売業	-11.11	-1.30	-6.47	-24.19	-16.09	-38.11
小売業	-5.04	-1.61	-5.15	-21.64	-15.69	-31.58
銀行業	-3.52	-1.22	-5.19	-10.97	-10.97	-
証券・商品先物取引業	-1.85	-1.23	-3.73	-14.74	-14.74	-
保険業	-5.41	-0.97	-3.69	-15.87	-15.87	-
その他金融業	-5.46	-1.60	-6.41	-17.78	-16.11	-31.19
不動産業	-11.72	-1.25	-5.54	-23.87	-14.80	-36.95
サービス業	-4.09	-0.07	-4.71	-12.56	-9.89	-22.11
財投機関債	-17.01	-1.73	-5.57	-35.62	-14.51	-44.63

出所:NFRC

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

事業債 円建外債 格付別・月間投資収益率 (2023年10月末)

	全体	短期 (1-3)	中期 (3-7)	長期 (7-)	月間投資収益率	
					(7-11)	(11-)
事業債・円建外債 全体	-13.06	-1.48	-5.94	-32.73	-16.58	-45.89
AAA～A 格	-13.20	-1.49	-5.95	-32.79	-16.60	-45.92
AAA～AA 格	-15.01	-1.66	-6.10	-34.64	-16.07	-47.47
AAA 格	-8.65	-1.77	-5.98	-28.87	-15.13	-53.34
AA 格	-16.72	-1.61	-6.14	-35.36	-16.26	-47.04
A 格	-9.13	-1.19	-5.67	-26.60	-17.88	-38.61
BBB 格	-4.43	-0.87	-5.35	-20.81	-13.20	-35.62
事業債 全体	-13.50	-1.56	-6.04	-32.87	-16.60	-46.07
AAA～A 格	-13.58	-1.56	-6.06	-32.90	-16.61	-46.08
AAA～AA 格	-15.23	-1.67	-6.15	-34.68	-16.06	-47.47
AAA 格	-8.65	-1.77	-5.98	-28.87	-15.13	-53.34
AA 格	-17.04	-1.63	-6.20	-35.41	-16.26	-47.05
A 格	-9.60	-1.34	-5.86	-26.73	-17.94	-39.15
BBB 格	-4.80	-1.31	-5.14	-20.78	-12.17	-40.69
円建外債 全体	-3.97	-0.39	-4.20	-21.82	-15.51	-28.95
AAA～A 格	-3.98	-0.37	-4.07	-22.04	-15.81	-28.52
AAA～AA 格	-3.43	-1.18	-4.12	-17.72	-16.34	-31.88
AAA 格	-	-	-	-	-	-
AA 格	-3.43	-1.18	-4.12	-17.72	-16.34	-31.88
A 格	-4.24	0.07	-4.05	-23.10	-15.52	-28.40
BBB 格	-3.93	-0.47	-5.94	-20.85	-14.45	-31.28

出所:NFRC

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

事業債 円建外債 最高格付別・月間投資収益率(2023年10月末)

	全体	短期 (1-3)	中期 (3-7)	長期 (7-)	月間投資収益率	
					(7-11)	(11-)
事業債						
AAA~AA格	-15.23	-1.67	-6.15	-34.68	-16.06	-47.47
AAA~A格	-13.58	-1.56	-6.06	-32.90	-16.61	-46.08
AAA~BBB格	-13.50	-1.56	-6.04	-32.87	-16.60	-46.07
AAA~BB格	-13.50	-1.56	-6.04	-32.87	-16.60	-46.07
AAA格	-8.65	-1.77	-5.98	-28.87	-15.13	-53.34
AA格	-17.04	-1.63	-6.20	-35.41	-16.26	-47.05
A格	-9.60	-1.34	-5.86	-26.73	-17.94	-39.15
BBB格	-4.80	-1.31	-5.14	-20.78	-12.17	-40.69
BB格	-	-	-	-	-	-
B格以下	-	-	-	-	-	-
格付なし	-	-	-	-	-	-
円建外債						
AAA~AA格	-3.43	-1.18	-4.12	-17.72	-16.34	-31.88
AAA~A格	-3.98	-0.37	-4.07	-22.04	-15.81	-28.52
AAA~BBB格	-3.97	-0.39	-4.20	-21.82	-15.51	-28.95
AAA~BB格	-3.97	-0.39	-4.20	-21.82	-15.51	-28.95
AAA格	-	-	-	-	-	-
AA格	-3.43	-1.18	-4.12	-17.72	-16.34	-31.88
A格	-4.24	0.07	-4.05	-23.10	-15.52	-28.40
BBB格	-3.93	-0.47	-5.94	-20.85	-14.45	-31.28
BB格	-	-	-	-	-	-
B格以下	-	-	-	-	-	-
格付なし	-	-	-	-	-	-

出所:NFRFC

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

事業債 円建外債 最低格付別・月間投資収益率(2023年10月末)

	全体	短期 (1-3)	中期 (3-7)	長期 (7-)	月間投資収益率	
					(7-11)	(11-)
事業債						
AAA~AA格	-12.92	-1.58	-5.57	-35.41	-15.61	-48.95
AAA~A格	-13.72	-1.57	-6.01	-32.80	-16.56	-45.87
AAA~BBB格	-13.51	-1.56	-6.03	-32.87	-16.60	-46.09
AAA~BB格	-13.50	-1.56	-6.04	-32.87	-16.60	-46.07
AAA格	-	-	-	-	-	-
AA格	-12.92	-1.58	-5.57	-35.41	-15.61	-48.95
A格	-13.85	-1.57	-6.09	-32.45	-16.67	-45.42
BBB格	-9.99	-1.43	-6.53	-34.76	-17.52	-53.80
BB格	-10.05	-	-7.18	-36.75	-	-36.75
B格以下	-	-	-	-	-	-
格付なし	-	-	-	-	-	-
円建外債						
AAA~AA格	-2.69	-0.80	-4.52	-14.46	-14.46	-
AAA~A格	-3.48	-0.52	-4.15	-21.02	-15.01	-27.65
AAA~BBB格	-3.97	-0.39	-4.20	-21.82	-15.51	-28.95
AAA~BB格	-3.97	-0.39	-4.20	-21.82	-15.51	-28.95
AAA格	-	-	-	-	-	-
AA格	-2.69	-0.80	-4.52	-14.46	-14.46	-
A格	-3.60	-0.47	-4.09	-21.44	-15.08	-27.65
BBB格	-4.43	-0.24	-4.24	-22.34	-15.83	-29.82
BB格	-	-	-	-	-	-
B格以下	-	-	-	-	-	-
格付なし	-	-	-	-	-	-

出所:NFRFC

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

事業債 円建外債 R&I 格付別・月間投資収益率(2023年10月末)

	全体	短期 (1-3)	中期 (3-7)	長期 (7-)	月間投資収益率	
					(7-11)	(11-)
事業債						
AAA~AA 格	-16.15	-1.69	-5.75	-35.53	-15.56	-46.93
AAA~A 格	-14.16	-1.60	-6.05	-33.70	-16.87	-46.75
AAA~BBB 格	-14.07	-1.59	-6.03	-33.62	-16.83	-46.66
AAA~BB 格	-14.07	-1.59	-6.03	-33.62	-16.83	-46.66
AAA 格	-5.81	-1.88	-4.63	-16.20	-14.06	-26.15
AA 格	-16.37	-1.68	-5.77	-35.75	-15.60	-47.00
A 格	-11.36	-1.50	-6.43	-30.09	-18.48	-46.21
BBB 格	-6.19	-0.88	-4.58	-22.30	-11.54	-31.44
BB 格	-	-	-	-	-	-
B 格以下	-	-	-	-	-	-
格付なし	-7.69	-1.28	-6.13	-20.86	-13.98	-32.18
円建外債						
AAA~AA 格	-0.76	-0.76	-	-	-	-
AAA~A 格	-2.66	-0.08	-4.32	-17.45	-17.45	-
AAA~BBB 格	-2.82	-0.05	-4.32	-20.33	-17.45	-28.22
AAA~BB 格	-2.82	-0.05	-4.32	-20.33	-17.45	-28.22
AAA 格	-	-	-	-	-	-
AA 格	-0.76	-0.76	-	-	-	-
A 格	-2.80	0.03	-4.32	-17.45	-17.45	-
BBB 格	-5.70	0.30	-	-28.22	-	-28.22
BB 格	-	-	-	-	-	-
B 格以下	-	-	-	-	-	-
格付なし	-4.43	-0.55	-4.15	-22.05	-15.07	-29.01

出所:NFRFC

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

事業債 円建外債 JCR 格付別・月間投資収益率(2023年10月末)

	全体	短期 (1-3)	中期 (3-7)	長期 (7-)	月間投資収益率	
					(7-11)	(11-)
事業債						
AAA~AA 格	-10.88	-1.64	-6.27	-30.04	-16.37	-49.22
AAA~A 格	-10.58	-1.55	-6.13	-28.48	-16.87	-45.08
AAA~BBB 格	-10.52	-1.55	-6.12	-28.46	-16.86	-45.06
AAA~BB 格	-10.52	-1.55	-6.12	-28.46	-16.86	-45.06
AAA 格	-8.86	-1.78	-6.03	-28.87	-15.13	-53.34
AA 格	-12.06	-1.54	-6.43	-30.49	-16.91	-47.93
A 格	-9.93	-1.34	-5.81	-25.35	-17.86	-36.48
BBB 格	-5.21	-1.18	-5.18	-23.82	-12.55	-40.69
BB 格	-	-	-	-	-	-
B 格以下	-	-	-	-	-	-
格付なし	-17.65	-1.58	-5.93	-36.79	-16.17	-46.62
円建外債						
AAA~AA 格	-4.04	-0.94	-2.96	-18.02	-14.86	-31.88
AAA~A 格	-5.50	-0.22	-3.60	-24.13	-15.67	-29.12
AAA~BBB 格	-5.50	-0.22	-3.60	-24.13	-15.67	-29.12
AAA~BB 格	-5.50	-0.22	-3.60	-24.13	-15.67	-29.12
AAA 格	-	-	-	-	-	-
AA 格	-4.04	-0.94	-2.96	-18.02	-14.86	-31.88
A 格	-5.88	-0.14	-3.88	-25.06	-16.00	-29.01
BBB 格	-6.78	-	-6.78	-	-	-
BB 格	-	-	-	-	-	-
B 格以下	-	-	-	-	-	-
格付なし	-3.21	-0.45	-4.55	-18.70	-15.39	-28.38

出所:NFRFC

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

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

	全体	短期 (1-3)	中期 (3-7)	長期 (7-)	月間投資収益率	
					(7-11)	(11-)
事業債						
AAA~AA格	-	-	-	-	-	-
AAA~A格	-15.90	-1.68	-5.87	-35.57	-16.50	-46.23
AAA~BBB格	-15.61	-1.67	-6.08	-35.81	-16.72	-46.86
AAA~BB格	-15.61	-1.67	-6.08	-35.81	-16.72	-46.86
AAA格	-	-	-	-	-	-
AA格	-	-	-	-	-	-
A格	-15.90	-1.68	-5.87	-35.57	-16.50	-46.23
BBB格	-12.93	-1.60	-7.55	-39.45	-19.13	-58.91
BB格	-	-	-	-	-	-
B格以下	-	-	-	-	-	-
格付なし	-12.27	-1.49	-6.02	-30.84	-16.54	-45.38
円建外債						
AAA~AA格	-3.23	-1.19	-4.81	-16.77	-16.77	-
AAA~A格	-3.87	-0.65	-4.22	-21.25	-15.73	-26.83
AAA~BBB格	-4.42	-0.61	-4.29	-22.03	-15.58	-28.95
AAA~BB格	-4.42	-0.61	-4.29	-22.03	-15.58	-28.95
AAA格	-	-	-	-	-	-
AA格	-3.23	-1.19	-4.81	-16.77	-16.77	-
A格	-4.40	-0.02	-3.84	-22.64	-14.81	-26.83
BBB格	-5.12	-0.55	-4.36	-22.70	-15.46	-30.89
BB格	-	-	-	-	-	-
B格以下	-	-	-	-	-	-
格付なし	-1.00	0.61	-3.40	-13.97	-13.97	-

出所:NFRFC

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

事業債 円建外債 S&P 格付別・月間投資収益率(2023年10月末)

	全体	短期 (1-3)	中期 (3-7)	長期 (7-)	月間投資収益率	
					(7-11)	(11-)
事業債						
AAA~AA格	-36.97	-2.08	-7.21	-43.35	-17.50	-59.24
AAA~A格	-16.82	-1.75	-6.61	-34.11	-15.94	-48.87
AAA~BBB格	-16.28	-1.73	-6.55	-33.89	-15.93	-48.82
AAA~BB格	-16.19	-1.73	-6.58	-33.90	-15.93	-48.74
AAA格	-	-	-	-	-	-
AA格	-36.97	-2.08	-7.21	-43.35	-17.50	-59.24
A格	-15.84	-1.75	-6.60	-33.17	-15.81	-47.67
BBB格	-4.56	-1.58	-5.18	-17.01	-15.59	-28.36
BB格	-10.05	-	-7.18	-36.75	-	-36.75
B格以下	-	-	-	-	-	-
格付なし	-12.63	-1.51	-5.89	-32.44	-16.88	-44.96
円建外債						
AAA~AA格	-3.73	-1.02	-4.62	-14.46	-14.46	-
AAA~A格	-3.94	-0.70	-4.07	-21.14	-15.03	-27.65
AAA~BBB格	-4.24	-0.46	-4.19	-21.87	-15.52	-28.95
AAA~BB格	-4.24	-0.46	-4.19	-21.87	-15.52	-28.95
AAA格	-	-	-	-	-	-
AA格	-3.73	-1.02	-4.62	-14.46	-14.46	-
A格	-3.96	-0.67	-4.00	-21.58	-15.11	-27.65
BBB格	-4.50	-0.25	-4.30	-22.34	-15.83	-29.82
BB格	-	-	-	-	-	-
B格以下	-	-	-	-	-	-
格付なし	-0.38	0.04	-5.03	-14.50	-14.50	-

出所:NFRFC

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

このページは空白です。

銘柄 残存別・ポートフォリオ指標 (2023年10月末)

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
総合	1,112,623	96.80	96.97	10.14	0.77	0.86	0.83	8.78	8.73	8.75	5
短期 (1-3)	224,662	100.42	100.51	1.94	0.39	0.16	0.16	1.93	1.93	1.93	6
中期 (3-7)	301,411	100.56	100.70	4.77	0.59	0.47	0.48	4.69	4.68	4.69	6
長期 (7-)	586,550	93.49	93.70	16.05	1.00	1.36	1.31	13.86	13.75	13.78	4
長期 (7-11)	202,990	100.39	100.62	8.69	0.92	0.89	0.89	8.35	8.31	8.34	5
超長期 (11-)	383,561	89.83	90.04	19.94	1.04	1.63	1.56	17.11	16.98	17.00	4
(11-15)	96,233	98.21	98.45	12.93	1.11	1.25	1.24	12.01	11.94	11.99	4
(15-)	287,328	87.03	87.22	22.29	1.02	1.78	1.68	19.04	18.88	18.90	4
国債	940,238	96.87	97.05	10.63	0.79	0.85	0.82	9.16	9.10	9.12	1
短期 (1-3)	184,235	100.53	100.62	1.93	0.39	0.10	0.10	1.92	1.92	1.92	1
中期 (3-7)	245,159	100.89	101.03	4.76	0.60	0.42	0.42	4.68	4.67	4.68	0
長期 (7-)	510,843	93.62	93.84	16.58	1.03	1.36	1.30	14.28	14.17	14.20	1
長期 (7-11)	175,277	100.93	101.16	8.72	0.95	0.85	0.85	8.36	8.33	8.36	1
超長期 (11-)	335,567	89.81	90.02	20.69	1.07	1.66	1.57	17.74	17.60	17.63	1
(11-15)	84,475	98.91	99.16	12.97	1.14	1.22	1.21	12.03	11.96	12.01	1
(15-)	251,091	86.75	86.95	23.29	1.05	1.83	1.71	19.94	19.76	19.78	1
地方債	67,529	97.06	97.18	7.46	0.57	0.78	0.79	6.89	6.85	6.86	14
短期 (1-3)	13,111	100.24	100.32	2.01	0.39	0.24	0.24	2.00	2.00	2.00	13
中期 (3-7)	23,800	99.49	99.59	4.95	0.50	0.58	0.58	4.87	4.86	4.87	14
長期 (7-)	30,617	93.81	93.96	11.74	0.71	1.20	1.23	10.78	10.71	10.73	15
政保債	14,801	96.59	96.79	8.97	0.67	0.82	0.79	7.75	7.70	7.72	11
短期 (1-3)	4,069	100.02	100.08	1.82	0.24	0.18	0.18	1.82	1.81	1.82	10
中期 (3-7)	4,416	100.06	100.18	4.57	0.48	0.50	0.50	4.52	4.50	4.51	11
長期 (7-)	6,316	91.96	92.30	16.65	1.07	1.50	1.43	14.35	14.24	14.29	11
金融債	3,436	98.76	98.80	3.22	0.18	0.50	0.49	3.17	3.16	3.17	25
短期 (1-3)	1,894	99.49	99.52	2.06	0.12	0.35	0.35	2.06	2.05	2.06	23
中期 (3-7)	1,322	98.52	98.58	4.05	0.24	0.60	0.60	4.02	4.01	4.02	26
長期 (7-)	220	93.92	94.02	8.18	0.40	1.22	1.19	8.03	7.99	8.03	39
事業債	68,174	95.78	95.94	7.71	0.67	1.06	1.02	6.64	6.59	6.61	44
短期 (1-3)	19,673	99.77	99.87	2.07	0.40	0.50	0.50	2.06	2.06	2.06	39
中期 (3-7)	24,966	98.79	98.93	4.76	0.62	0.87	0.86	4.68	4.66	4.68	44
長期 (7-)	23,535	89.25	89.49	15.55	0.95	1.80	1.69	13.21	13.09	13.13	48
長期 (7-11)	10,004	95.46	95.67	8.59	0.83	1.43	1.39	8.27	8.21	8.26	56
超長期 (11-)	13,530	84.66	84.92	20.69	1.04	2.11	1.94	17.33	17.15	17.19	41
円建外債	3,228	98.16	98.48	3.85	1.08	1.45	1.43	3.63	3.60	3.63	113
短期 (1-3)	1,473	99.62	99.93	1.99	1.04	1.18	1.18	1.96	1.95	1.96	108
中期 (3-7)	1,462	97.82	98.12	4.25	0.99	1.49	1.47	4.15	4.12	4.15	111
長期 (7-)	293	92.44	92.99	11.26	1.76	2.66	2.56	9.93	9.80	9.90	153
長期 (7-11)	156	92.98	93.33	8.78	1.25	2.23	2.15	8.26	8.18	8.26	131
超長期 (11-)	137	91.83	92.61	14.07	2.33	3.16	3.03	11.83	11.66	11.77	178
MBS	14,490	95.57	95.61	7.18	0.63	0.80	1.16	6.73	6.69	6.76	17
ABS	727	95.90	96.06	5.92	0.69	1.18	1.15	5.48	5.44	5.47	65
短期 (1-3)	206	99.97	100.13	1.90	0.69	0.68	0.68	1.89	1.88	1.89	59
中期 (3-7)	285	97.87	98.03	4.88	0.68	1.09	1.08	4.78	4.76	4.78	65
長期 (7-)	237	89.98	90.15	10.66	0.71	1.78	1.68	9.85	9.76	9.83	71

出所:NFRC

「除く」銘柄 残存別・ポートフォリオ指標 (2023年10月末)

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
除く MBS	1,098,134	96.82	96.99	10.18	0.77	0.86	0.83	8.81	8.75	8.77	5
短期 (1-3)	224,662	100.42	100.51	1.94	0.39	0.16	0.16	1.93	1.93	1.93	6
中期 (3-7)	301,411	100.56	100.70	4.77	0.59	0.47	0.48	4.69	4.68	4.69	6
長期 (7-)	572,061	93.43	93.65	16.28	1.01	1.37	1.32	14.04	13.94	13.97	4
長期 (7-11)	202,766	100.39	100.62	8.70	0.92	0.89	0.89	8.35	8.31	8.35	5
超長期 (11-)	369,295	89.61	89.82	20.44	1.06	1.67	1.58	17.54	17.40	17.42	3
(11-15)	96,233	98.21	98.45	12.93	1.11	1.25	1.24	12.01	11.94	11.99	4
(15-)	273,062	86.58	86.78	23.08	1.04	1.83	1.71	19.75	19.58	19.60	3
除く ABS	1,111,896	96.80	96.97	10.15	0.77	0.86	0.83	8.78	8.73	8.75	5
短期 (1-3)	224,456	100.42	100.51	1.94	0.39	0.16	0.16	1.93	1.93	1.93	6
中期 (3-7)	301,126	100.56	100.71	4.77	0.59	0.47	0.47	4.69	4.68	4.69	6
長期 (7-)	586,314	93.49	93.70	16.05	1.00	1.36	1.31	13.86	13.76	13.79	4
長期 (7-11)	202,839	100.40	100.63	8.69	0.92	0.89	0.89	8.35	8.31	8.34	5
超長期 (11-)	383,475	89.83	90.04	19.95	1.04	1.63	1.56	17.12	16.98	17.01	4
(11-15)	96,175	98.21	98.46	12.93	1.11	1.25	1.24	12.01	11.94	11.99	4
(15-)	287,300	87.03	87.22	22.29	1.02	1.78	1.68	19.04	18.88	18.90	4
除く MBS・ABS	1,097,407	96.82	96.99	10.19	0.77	0.86	0.83	8.81	8.76	8.77	5
短期 (1-3)	224,456	100.42	100.51	1.94	0.39	0.16	0.16	1.93	1.93	1.93	6
中期 (3-7)	301,126	100.56	100.71	4.77	0.59	0.47	0.47	4.69	4.68	4.69	6
長期 (7-)	571,824	93.44	93.65	16.28	1.01	1.37	1.32	14.04	13.94	13.97	4
長期 (7-11)	202,615	100.40	100.63	8.70	0.92	0.89	0.89	8.35	8.31	8.35	5
超長期 (11-)	369,209	89.61	89.83	20.44	1.06	1.67	1.58	17.54	17.40	17.42	3
(11-15)	96,175	98.21	98.46	12.93	1.11	1.25	1.24	12.01	11.94	11.99	4
(15-)	273,034	86.58	86.78	23.08	1.04	1.83	1.71	19.75	19.58	19.60	3
除く 国債	172,386	96.44	96.58	7.51	0.63	0.90	0.92	6.71	6.67	6.69	28
短期 (1-3)	40,427	99.93	100.03	2.02	0.40	0.40	0.40	2.01	2.01	2.01	29
中期 (3-7)	56,252	99.15	99.28	4.80	0.56	0.73	0.72	4.72	4.70	4.72	30
長期 (7-)	75,707	92.56	92.73	12.45	0.80	1.34	1.38	10.99	10.91	10.95	26
長期 (7-11)	27,713	97.02	97.19	8.51	0.75	1.15	1.13	8.22	8.18	8.22	31
超長期 (11-)	47,994	89.99	90.16	14.72	0.83	1.45	1.53	12.72	12.61	12.64	22

出所:NFRG

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

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

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
総合	1,123,343	96.81	96.98	10.19	0.77	0.86	0.84	8.82	8.76	8.78	5
短期 (1-3)	224,839	100.41	100.51	1.97	0.39	0.16	0.16	1.96	1.96	1.96	6
中期 (3-7)	305,742	100.58	100.73	4.79	0.60	0.48	0.48	4.71	4.70	4.71	6
長期 (7-)	592,762	93.49	93.71	16.10	1.00	1.36	1.32	13.89	13.79	13.82	4
長期 (7-11)	205,473	100.32	100.54	8.73	0.91	0.89	0.89	8.38	8.34	8.37	5
超長期 (11-)	387,289	89.87	90.08	20.01	1.05	1.63	1.57	17.15	17.01	17.04	4
(11-15)	96,452	98.20	98.44	12.93	1.11	1.25	1.24	12.01	11.94	11.99	4
(15-)	290,836	87.12	87.31	22.35	1.02	1.78	1.69	19.07	18.91	18.93	4
国債	949,624	96.88	97.05	10.67	0.79	0.85	0.82	9.19	9.14	9.15	1
短期 (1-3)	184,239	100.53	100.62	1.94	0.39	0.10	0.11	1.93	1.93	1.93	1
中期 (3-7)	248,744	100.92	101.06	4.77	0.60	0.42	0.42	4.69	4.68	4.69	0
長期 (7-)	516,641	93.63	93.85	16.63	1.03	1.36	1.31	14.30	14.20	14.23	1
長期 (7-11)	177,658	100.84	101.07	8.75	0.94	0.85	0.85	8.39	8.36	8.39	1
超長期 (11-)	338,984	89.86	90.07	20.75	1.08	1.66	1.57	17.78	17.64	17.66	1
(11-15)	84,559	98.91	99.16	12.97	1.14	1.22	1.21	12.03	11.96	12.01	1
(15-)	254,425	86.85	87.04	23.34	1.05	1.83	1.71	19.96	19.79	19.80	1
地方債	67,630	97.04	97.16	7.54	0.58	0.79	0.80	6.97	6.93	6.94	14
短期 (1-3)	13,008	100.21	100.29	2.09	0.39	0.25	0.25	2.08	2.07	2.08	13
中期 (3-7)	23,957	99.44	99.55	5.02	0.50	0.59	0.59	4.95	4.94	4.95	14
長期 (7-)	30,664	93.81	93.95	11.82	0.72	1.21	1.23	10.85	10.78	10.79	15
政保債	14,651	96.52	96.72	9.16	0.68	0.84	0.81	7.92	7.87	7.90	11
短期 (1-3)	3,759	100.00	100.07	1.90	0.24	0.19	0.19	1.89	1.89	1.89	10
中期 (3-7)	4,531	100.07	100.19	4.62	0.49	0.51	0.51	4.56	4.55	4.56	11
長期 (7-)	6,361	91.93	92.27	16.68	1.07	1.50	1.43	14.39	14.28	14.33	11
金融債	3,431	98.74	98.79	3.28	0.19	0.51	0.50	3.23	3.22	3.23	25
短期 (1-3)	1,889	99.46	99.49	2.12	0.12	0.36	0.35	2.12	2.11	2.12	23
中期 (3-7)	1,322	98.52	98.58	4.11	0.25	0.61	0.61	4.08	4.07	4.08	26
長期 (7-)	220	93.92	94.02	8.18	0.40	1.22	1.19	8.03	7.99	8.03	39
事業債	69,317	95.81	95.97	7.72	0.68	1.06	1.02	6.66	6.61	6.63	44
短期 (1-3)	20,196	99.75	99.85	2.11	0.40	0.51	0.51	2.10	2.10	2.10	39
中期 (3-7)	25,333	98.77	98.92	4.82	0.63	0.88	0.87	4.73	4.71	4.73	44
長期 (7-)	23,787	89.32	89.55	15.56	0.96	1.80	1.69	13.23	13.11	13.15	48
長期 (7-11)	10,138	95.49	95.69	8.66	0.84	1.44	1.39	8.33	8.27	8.33	56
超長期 (11-)	13,649	84.73	85.00	20.69	1.04	2.11	1.94	17.33	17.15	17.19	41
円建外債	3,421	98.21	98.52	3.92	1.07	1.43	1.41	3.70	3.67	3.70	111
短期 (1-3)	1,560	99.79	100.13	2.05	1.09	1.18	1.17	2.02	2.01	2.02	107
中期 (3-7)	1,558	97.71	97.95	4.37	0.92	1.47	1.45	4.27	4.24	4.27	108
長期 (7-)	304	92.64	93.18	11.21	1.74	2.62	2.52	9.90	9.77	9.87	149
長期 (7-11)	167	93.32	93.66	8.85	1.26	2.18	2.11	8.33	8.24	8.32	126
超長期 (11-)	137	91.83	92.61	14.07	2.33	3.16	3.03	11.83	11.66	11.77	178
MBS	14,554	95.58	95.62	7.21	0.63	0.81	1.16	6.76	6.72	6.78	17
ABS	714	95.80	95.96	6.06	0.69	1.20	1.16	5.61	5.57	5.61	65
短期 (1-3)	187	99.90	100.05	2.01	0.69	0.71	0.71	2.00	1.99	2.00	60
中期 (3-7)	297	97.82	97.98	4.95	0.68	1.09	1.08	4.85	4.82	4.85	64
長期 (7-)	230	89.87	90.04	10.77	0.72	1.79	1.69	9.95	9.86	9.93	71

出所:NFRIC

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

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
除く MBS	1,108,788	96.82	97.00	10.23	0.77	0.86	0.83	8.85	8.79	8.81	5
短期(1-3)	224,839	100.41	100.51	1.97	0.39	0.16	0.16	1.96	1.96	1.96	6
中期(3-7)	305,742	100.58	100.73	4.79	0.60	0.48	0.48	4.71	4.70	4.71	6
長期(7-)	578,207	93.44	93.66	16.32	1.01	1.37	1.32	14.07	13.97	14.00	4
長期(7-11)	205,249	100.32	100.54	8.73	0.91	0.89	0.89	8.39	8.35	8.38	5
超長期(11-)	372,958	89.66	89.87	20.49	1.06	1.67	1.58	17.57	17.43	17.46	3
(11-15)	96,427	98.20	98.44	12.93	1.11	1.25	1.24	12.01	11.94	11.99	4
(15-)	276,531	86.68	86.88	23.13	1.04	1.83	1.72	19.77	19.60	19.62	3
除く ABS	1,122,628	96.81	96.98	10.19	0.77	0.86	0.84	8.82	8.77	8.78	5
短期(1-3)	224,652	100.42	100.51	1.97	0.39	0.16	0.16	1.96	1.96	1.96	6
中期(3-7)	305,445	100.58	100.73	4.79	0.60	0.48	0.48	4.71	4.70	4.71	6
長期(7-)	592,531	93.50	93.71	16.10	1.00	1.36	1.32	13.89	13.79	13.82	4
長期(7-11)	205,328	100.32	100.55	8.73	0.91	0.89	0.89	8.38	8.34	8.37	5
超長期(11-)	387,203	89.88	90.08	20.01	1.05	1.63	1.57	17.15	17.01	17.04	4
(11-15)	96,395	98.20	98.45	12.93	1.11	1.25	1.24	12.01	11.94	11.99	4
(15-)	290,808	87.12	87.31	22.35	1.02	1.78	1.69	19.08	18.91	18.93	4
除く MBS・ABS	1,108,074	96.83	97.00	10.23	0.77	0.86	0.83	8.85	8.79	8.81	5
短期(1-3)	224,652	100.42	100.51	1.97	0.39	0.16	0.16	1.96	1.96	1.96	6
中期(3-7)	305,445	100.58	100.73	4.79	0.60	0.48	0.48	4.71	4.70	4.71	6
長期(7-)	577,977	93.44	93.66	16.32	1.01	1.37	1.32	14.07	13.97	14.00	4
長期(7-11)	205,105	100.32	100.55	8.73	0.91	0.89	0.89	8.39	8.35	8.38	5
超長期(11-)	372,873	89.66	89.87	20.50	1.06	1.67	1.58	17.58	17.43	17.46	3
(11-15)	96,370	98.20	98.44	12.93	1.11	1.25	1.24	12.01	11.94	11.99	4
(15-)	276,503	86.68	86.88	23.13	1.04	1.83	1.72	19.77	19.60	19.62	3
除く国債	173,718	96.43	96.57	7.56	0.63	0.91	0.93	6.76	6.72	6.74	28
短期(1-3)	40,599	99.91	100.01	2.08	0.40	0.41	0.41	2.07	2.07	2.07	30
中期(3-7)	56,999	99.12	99.24	4.86	0.56	0.74	0.73	4.78	4.77	4.78	30
長期(7-)	76,120	92.57	92.74	12.50	0.81	1.34	1.38	11.04	10.96	10.99	26
長期(7-11)	27,815	97.02	97.19	8.59	0.76	1.16	1.14	8.30	8.25	8.29	31
超長期(11-)	48,305	90.01	90.18	14.75	0.83	1.45	1.53	12.74	12.64	12.67	22

出所:NFRC

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

事業債 業種別・ポートフォリオ指標 (1/4) (2023年10月末)

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
事業債 全体	68,174	95.78	95.94	7.71	0.67	1.06	1.02	6.64	6.59	6.61	44
短期 (1-3)	19,673	99.77	99.87	2.07	0.40	0.50	0.50	2.06	2.06	2.06	39
中期 (3-7)	24,966	98.79	98.93	4.76	0.62	0.87	0.86	4.68	4.66	4.68	44
長期 (7-)	23,535	89.25	89.49	15.55	0.95	1.80	1.69	13.21	13.09	13.13	48
長期 (7-11)	10,004	95.46	95.67	8.59	0.83	1.43	1.39	8.27	8.21	8.26	56
超長期 (11-)	13,530	84.66	84.92	20.69	1.04	2.11	1.94	17.33	17.15	17.19	41
水産・農林業	18	98.89	99.07	4.60	0.78	1.04	1.03	4.52	4.50	4.52	63
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	18	98.89	99.07	4.60	0.78	1.04	1.03	4.52	4.50	4.52	63
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
鉱業	30	95.41	95.42	5.90	0.21	0.94	0.92	5.78	5.75	5.78	38
短期 (1-3)	10	99.06	99.07	2.37	0.08	0.48	0.48	2.37	2.37	2.37	32
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	20	93.58	93.60	7.66	0.28	1.19	1.15	7.58	7.54	7.58	41
長期 (7-11)	20	93.58	93.60	7.66	0.28	1.19	1.15	7.58	7.54	7.58	41
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
建設業	1,147	97.53	97.64	4.70	0.39	0.78	0.77	4.51	4.48	4.50	38
短期 (1-3)	360	99.58	99.64	2.02	0.23	0.42	0.42	2.01	2.01	2.01	31
中期 (3-7)	636	98.02	98.14	4.66	0.41	0.82	0.81	4.60	4.58	4.60	40
長期 (7-)	151	90.60	90.82	11.24	0.64	1.59	1.51	10.60	10.52	10.58	47
長期 (7-11)	85	93.98	94.18	8.48	0.59	1.38	1.34	8.25	8.20	8.25	52
超長期 (11-)	66	86.24	86.51	14.80	0.71	1.88	1.75	13.89	13.76	13.86	40
食料品	1,342	97.41	97.50	5.18	0.41	0.81	0.79	4.92	4.89	4.92	35
短期 (1-3)	471	99.53	99.59	2.26	0.26	0.45	0.45	2.25	2.25	2.25	31
中期 (3-7)	608	98.03	98.12	4.60	0.36	0.78	0.77	4.55	4.53	4.55	37
長期 (7-)	263	92.19	92.35	11.74	0.79	1.56	1.50	10.97	10.88	10.95	41
長期 (7-11)	143	95.08	95.28	9.02	0.68	1.30	1.27	8.73	8.67	8.72	39
超長期 (11-)	120	88.74	88.86	14.99	0.92	1.89	1.79	13.83	13.71	13.79	43
繊維製品	235	97.56	97.67	4.57	0.38	0.79	0.78	4.35	4.33	4.35	41
短期 (1-3)	60	99.62	99.68	1.90	0.23	0.41	0.41	1.89	1.89	1.89	31
中期 (3-7)	155	98.20	98.31	4.29	0.39	0.80	0.80	4.25	4.23	4.25	43
長期 (7-)	20	86.41	86.65	14.71	0.83	2.03	1.89	13.76	13.63	13.73	55
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	20	86.41	86.65	14.71	0.83	2.03	1.89	13.76	13.63	13.73	55
パルプ・紙	359	96.60	96.72	5.18	0.42	0.90	0.88	4.87	4.85	4.87	45
短期 (1-3)	135	99.53	99.63	2.12	0.36	0.53	0.53	2.11	2.10	2.11	41
中期 (3-7)	144	97.79	97.91	4.68	0.39	0.85	0.84	4.62	4.60	4.62	43
長期 (7-)	80	89.52	89.68	11.26	0.58	1.70	1.61	10.56	10.47	10.54	58
長期 (7-11)	45	92.35	92.41	7.71	0.35	1.44	1.39	7.60	7.55	7.60	64
超長期 (11-)	35	85.87	86.16	15.82	0.88	2.06	1.91	14.63	14.50	14.59	48
化学	2,288	95.71	95.81	5.78	0.41	0.99	0.95	5.35	5.32	5.35	48
短期 (1-3)	674	99.54	99.59	1.91	0.21	0.45	0.44	1.91	1.90	1.91	35
中期 (3-7)	991	97.54	97.62	4.66	0.37	0.89	0.88	4.60	4.58	4.60	47
長期 (7-)	623	88.65	88.83	11.73	0.69	1.82	1.71	10.83	10.73	10.81	64
長期 (7-11)	350	93.37	93.54	8.36	0.57	1.48	1.43	8.14	8.08	8.14	62
超長期 (11-)	273	82.59	82.80	16.05	0.83	2.31	2.10	14.74	14.58	14.69	67
医薬品	708	95.33	95.42	6.97	0.48	1.06	1.03	6.55	6.51	6.54	42
短期 (1-3)	163	99.61	99.67	2.61	0.30	0.45	0.45	2.60	2.59	2.60	27
中期 (3-7)	180	98.66	98.76	4.82	0.49	0.78	0.78	4.76	4.74	4.76	35
長期 (7-)	365	91.78	91.87	9.98	0.56	1.51	1.44	9.41	9.34	9.39	52
長期 (7-11)	265	93.36	93.39	8.00	0.43	1.35	1.31	7.87	7.82	7.87	53
超長期 (11-)	100	87.60	87.85	15.23	0.91	1.95	1.83	13.75	13.62	13.69	50

出所:NFRC

● 東証 33 業種分類を参考に NFRC で分類

事業債 業種別・ポートフォリオ指標 (1/4) (2023年10月末、11月ポートフォリオ)

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
事業債 全体	69,317	95.81	95.97	7.72	0.68	1.06	1.02	6.66	6.61	6.63	44
短期 (1-3)	20,196	99.75	99.85	2.11	0.40	0.51	0.51	2.10	2.10	2.10	39
中期 (3-7)	25,333	98.77	98.92	4.82	0.63	0.88	0.87	4.73	4.71	4.73	44
長期 (7-)	23,787	89.32	89.55	15.56	0.96	1.80	1.69	13.23	13.11	13.15	48
長期 (7-11)	10,138	95.49	95.69	8.66	0.84	1.44	1.39	8.33	8.27	8.33	56
超長期 (11-)	13,649	84.73	85.00	20.69	1.04	2.11	1.94	17.33	17.15	17.19	41
水産・農林業	18	98.89	99.07	4.60	0.78	1.04	1.03	4.52	4.50	4.52	63
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	18	98.89	99.07	4.60	0.78	1.04	1.03	4.52	4.50	4.52	63
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
鉱業	30	95.41	95.42	5.90	0.21	0.94	0.92	5.78	5.75	5.78	38
短期 (1-3)	10	99.06	99.07	2.37	0.08	0.48	0.48	2.37	2.37	2.37	32
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	20	93.58	93.60	7.66	0.28	1.19	1.15	7.58	7.54	7.58	41
長期 (7-11)	20	93.58	93.60	7.66	0.28	1.19	1.15	7.58	7.54	7.58	41
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
建設業	1,257	97.65	97.76	4.73	0.40	0.78	0.76	4.54	4.52	4.54	37
短期 (1-3)	400	99.58	99.64	2.10	0.24	0.42	0.42	2.10	2.09	2.10	30
中期 (3-7)	692	98.07	98.18	4.70	0.42	0.81	0.80	4.63	4.61	4.63	39
長期 (7-)	165	91.22	91.44	11.21	0.68	1.57	1.49	10.57	10.48	10.55	45
長期 (7-11)	99	94.54	94.73	8.82	0.67	1.38	1.34	8.54	8.49	8.54	48
超長期 (11-)	66	86.24	86.51	14.80	0.71	1.88	1.75	13.89	13.76	13.86	40
食料品	1,392	97.42	97.52	5.28	0.43	0.82	0.80	5.01	4.99	5.01	36
短期 (1-3)	476	99.52	99.58	2.27	0.26	0.45	0.45	2.26	2.26	2.26	31
中期 (3-7)	623	98.05	98.14	4.62	0.37	0.78	0.77	4.57	4.55	4.57	37
長期 (7-)	293	92.69	92.84	11.55	0.82	1.54	1.48	10.80	10.71	10.78	41
長期 (7-11)	173	95.42	95.61	9.16	0.74	1.31	1.28	8.84	8.78	8.83	39
超長期 (11-)	120	88.74	88.86	14.99	0.92	1.89	1.79	13.83	13.71	13.79	43
繊維製品	235	97.56	97.67	4.57	0.38	0.79	0.78	4.35	4.33	4.35	41
短期 (1-3)	60	99.62	99.68	1.90	0.23	0.41	0.41	1.89	1.89	1.89	31
中期 (3-7)	155	98.20	98.31	4.29	0.39	0.80	0.80	4.25	4.23	4.25	43
長期 (7-)	20	86.41	86.65	14.71	0.83	2.03	1.89	13.76	13.63	13.73	55
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	20	86.41	86.65	14.71	0.83	2.03	1.89	13.76	13.63	13.73	55
パルプ・紙	374	96.72	96.84	5.09	0.42	0.89	0.86	4.79	4.76	4.79	45
短期 (1-3)	150	99.54	99.64	2.20	0.36	0.53	0.52	2.19	2.18	2.19	40
中期 (3-7)	144	97.79	97.91	4.68	0.39	0.85	0.84	4.62	4.60	4.62	43
長期 (7-)	80	89.52	89.68	11.26	0.58	1.70	1.61	10.56	10.47	10.54	58
長期 (7-11)	45	92.35	92.41	7.71	0.35	1.44	1.39	7.60	7.55	7.60	64
超長期 (11-)	35	85.87	86.16	15.82	0.88	2.06	1.91	14.63	14.50	14.59	48
化学	2,288	95.71	95.81	5.78	0.41	0.99	0.95	5.35	5.32	5.35	48
短期 (1-3)	679	99.52	99.58	1.92	0.21	0.45	0.45	1.91	1.91	1.91	35
中期 (3-7)	996	97.50	97.58	4.69	0.37	0.89	0.88	4.64	4.61	4.64	47
長期 (7-)	613	88.56	88.74	11.80	0.69	1.83	1.71	10.90	10.80	10.88	64
長期 (7-11)	340	93.35	93.51	8.39	0.58	1.48	1.44	8.17	8.11	8.17	62
超長期 (11-)	273	82.59	82.80	16.05	0.83	2.31	2.10	14.74	14.58	14.69	67
医薬品	708	95.33	95.42	6.97	0.48	1.06	1.03	6.55	6.51	6.54	42
短期 (1-3)	163	99.61	99.67	2.61	0.30	0.45	0.45	2.60	2.59	2.60	27
中期 (3-7)	180	98.66	98.76	4.82	0.49	0.78	0.78	4.76	4.74	4.76	35
長期 (7-)	365	91.78	91.87	9.98	0.56	1.51	1.44	9.41	9.34	9.39	52
長期 (7-11)	265	93.36	93.39	8.00	0.43	1.35	1.31	7.87	7.82	7.87	53
超長期 (11-)	100	87.60	87.85	15.23	0.91	1.95	1.83	13.75	13.62	13.69	50

出所:NFRG

- 東証 33 業種分類を参考に NFRG で分類

事業債 業種別・ポートフォリオ指標 (2/4) (2023年10月末)

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
石油・石炭製品	320	95.92	96.10	6.52	0.56	1.10	1.07	6.14	6.10	6.13	50
短期 (1-3)	85	99.53	99.61	2.04	0.29	0.45	0.45	2.03	2.03	2.03	34
中期 (3-7)	85	97.13	97.24	5.35	0.42	0.94	0.93	5.27	5.24	5.27	45
長期 (7-)	150	93.19	93.47	9.72	0.79	1.59	1.54	9.14	9.07	9.12	62
長期 (7-11)	125	94.38	94.64	8.41	0.72	1.48	1.44	8.14	8.08	8.14	62
超長期 (11-)	25	87.26	87.65	16.27	1.13	2.21	2.07	14.54	14.38	14.46	63
ゴム製品	315	97.83	97.88	4.60	0.37	0.80	0.79	4.53	4.51	4.53	39
短期 (1-3)	70	99.40	99.42	2.54	0.26	0.50	0.50	2.53	2.52	2.53	33
中期 (3-7)	215	97.86	97.90	4.76	0.37	0.81	0.80	4.71	4.69	4.71	38
長期 (7-)	30	93.98	94.14	8.32	0.62	1.43	1.39	8.09	8.04	8.09	58
長期 (7-11)	30	93.98	94.14	8.32	0.62	1.43	1.39	8.09	8.04	8.09	58
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
ガラス・土石製品	235	95.60	95.73	6.25	0.45	1.04	1.01	5.84	5.80	5.83	47
短期 (1-3)	60	99.34	99.40	2.26	0.21	0.49	0.49	2.25	2.25	2.25	35
中期 (3-7)	90	97.62	97.72	4.53	0.36	0.88	0.87	4.48	4.46	4.48	48
長期 (7-)	85	90.81	91.04	10.88	0.71	1.64	1.56	10.15	10.07	10.13	55
長期 (7-11)	60	94.62	94.88	8.75	0.68	1.39	1.35	8.47	8.41	8.47	50
超長期 (11-)	25	81.67	81.83	16.00	0.80	2.35	2.13	14.82	14.66	14.77	69
鉄鋼	543	98.74	98.87	3.77	0.45	0.71	0.70	3.68	3.67	3.68	40
短期 (1-3)	275	99.67	99.78	2.04	0.34	0.46	0.46	2.03	2.03	2.03	35
中期 (3-7)	225	98.10	98.26	4.88	0.51	0.88	0.88	4.81	4.78	4.81	45
長期 (7-)	43	96.12	96.29	8.98	0.94	1.43	1.41	8.60	8.54	8.60	54
長期 (7-11)	43	96.12	96.29	8.98	0.94	1.43	1.41	8.60	8.54	8.60	54
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
非鉄金属	365	97.81	97.92	4.71	0.37	0.80	0.79	4.59	4.57	4.59	38
短期 (1-3)	100	99.31	99.35	2.07	0.16	0.46	0.46	2.06	2.05	2.06	35
中期 (3-7)	195	98.14	98.24	4.48	0.37	0.78	0.78	4.43	4.41	4.43	39
長期 (7-)	70	94.78	94.98	9.14	0.67	1.33	1.30	8.84	8.79	8.84	41
長期 (7-11)	70	94.78	94.98	9.14	0.67	1.33	1.30	8.84	8.79	8.84	41
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
金属製品	155	98.24	98.32	4.03	0.36	0.74	0.73	3.96	3.94	3.96	40
短期 (1-3)	50	99.45	99.50	2.13	0.19	0.44	0.44	2.13	2.12	2.13	31
中期 (3-7)	96	98.01	98.10	4.57	0.41	0.83	0.82	4.51	4.50	4.51	42
長期 (7-)	9	93.87	93.99	8.82	0.70	1.49	1.45	8.55	8.49	8.54	59
長期 (7-11)	9	93.87	93.99	8.82	0.70	1.49	1.45	8.55	8.49	8.54	59
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
機械	1,293	97.56	97.64	4.68	0.38	0.84	0.83	4.57	4.55	4.57	43
短期 (1-3)	380	99.41	99.46	2.15	0.26	0.52	0.52	2.14	2.14	2.14	39
中期 (3-7)	640	97.76	97.84	4.56	0.37	0.84	0.83	4.51	4.49	4.51	43
長期 (7-)	273	94.55	94.66	8.48	0.59	1.32	1.28	8.26	8.21	8.25	46
長期 (7-11)	273	94.55	94.66	8.48	0.59	1.32	1.28	8.26	8.21	8.25	46
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
電気機器	1,725	98.04	98.14	3.98	0.40	0.77	0.76	3.89	3.88	3.89	43
短期 (1-3)	740	99.71	99.77	2.11	0.38	0.48	0.48	2.10	2.09	2.10	36
中期 (3-7)	855	97.33	97.44	4.94	0.39	0.92	0.91	4.87	4.85	4.87	47
長期 (7-)	130	93.25	93.43	8.35	0.56	1.48	1.44	8.14	8.08	8.13	63
長期 (7-11)	130	93.25	93.43	8.35	0.56	1.48	1.44	8.14	8.08	8.13	63
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
輸送用機器	1,223	97.36	97.46	4.60	0.36	0.79	0.78	4.40	4.37	4.39	40
短期 (1-3)	540	99.39	99.46	2.13	0.30	0.56	0.56	2.12	2.12	2.12	43
中期 (3-7)	429	98.13	98.22	4.34	0.33	0.75	0.74	4.30	4.28	4.30	37
長期 (7-)	254	91.75	91.92	10.27	0.52	1.41	1.35	9.80	9.73	9.79	38
長期 (7-11)	164	94.50	94.65	8.35	0.44	1.18	1.15	8.18	8.13	8.17	34
超長期 (11-)	90	86.75	86.94	13.76	0.67	1.87	1.75	13.03	12.92	13.01	47

出所:NFRC

- 東証 33 業種分類を参考に NFRC で分類

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

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
石油・石炭製品	320	95.92	96.10	6.52	0.56	1.10	1.07	6.14	6.10	6.13	50
短期 (1-3)	85	99.53	99.61	2.04	0.29	0.45	0.45	2.03	2.03	2.03	34
中期 (3-7)	85	97.13	97.24	5.35	0.42	0.94	0.93	5.27	5.24	5.27	45
長期 (7-)	150	93.19	93.47	9.72	0.79	1.59	1.54	9.14	9.07	9.12	62
長期 (7-11)	125	94.38	94.64	8.41	0.72	1.48	1.44	8.14	8.08	8.14	62
超長期 (11-)	25	87.26	87.65	16.27	1.13	2.21	2.07	14.54	14.38	14.46	63
ゴム製品	330	97.86	97.91	4.69	0.39	0.81	0.80	4.61	4.59	4.61	39
短期 (1-3)	70	99.40	99.42	2.54	0.26	0.50	0.50	2.53	2.52	2.53	33
中期 (3-7)	225	97.91	97.95	4.76	0.38	0.81	0.80	4.71	4.69	4.71	38
長期 (7-)	35	94.47	94.63	8.54	0.70	1.44	1.40	8.27	8.21	8.27	57
長期 (7-11)	35	94.47	94.63	8.54	0.70	1.44	1.40	8.27	8.21	8.27	57
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
ガラス・土石製品	255	95.85	95.98	6.18	0.46	1.02	0.99	5.79	5.75	5.78	46
短期 (1-3)	73	99.39	99.44	2.36	0.23	0.49	0.49	2.36	2.35	2.36	33
中期 (3-7)	90	97.62	97.72	4.53	0.36	0.88	0.87	4.48	4.46	4.48	48
長期 (7-)	92	91.34	91.56	10.80	0.75	1.63	1.55	10.08	9.99	10.06	55
長期 (7-11)	67	94.93	95.18	8.87	0.74	1.40	1.37	8.56	8.50	8.56	51
超長期 (11-)	25	81.67	81.83	16.00	0.80	2.35	2.13	14.82	14.66	14.77	69
鉄鋼	543	98.74	98.87	3.77	0.45	0.71	0.70	3.68	3.67	3.68	40
短期 (1-3)	275	99.67	99.78	2.04	0.34	0.46	0.46	2.03	2.03	2.03	35
中期 (3-7)	225	98.10	98.26	4.88	0.51	0.88	0.88	4.81	4.78	4.81	45
長期 (7-)	43	96.12	96.29	8.98	0.94	1.43	1.41	8.60	8.54	8.60	54
長期 (7-11)	43	96.12	96.29	8.98	0.94	1.43	1.41	8.60	8.54	8.60	54
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
非鉄金属	355	97.76	97.86	4.81	0.38	0.81	0.80	4.69	4.67	4.69	38
短期 (1-3)	90	99.25	99.29	2.18	0.15	0.48	0.47	2.17	2.16	2.17	35
中期 (3-7)	195	98.14	98.24	4.48	0.37	0.78	0.78	4.43	4.41	4.43	39
長期 (7-)	70	94.78	94.98	9.14	0.67	1.33	1.30	8.84	8.79	8.84	41
長期 (7-11)	70	94.78	94.98	9.14	0.67	1.33	1.30	8.84	8.79	8.84	41
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
金属製品	155	98.24	98.32	4.03	0.36	0.74	0.73	3.96	3.94	3.96	40
短期 (1-3)	50	99.45	99.50	2.13	0.19	0.44	0.44	2.13	2.12	2.13	31
中期 (3-7)	96	98.01	98.10	4.57	0.41	0.83	0.82	4.51	4.50	4.51	42
長期 (7-)	9	93.87	93.99	8.82	0.70	1.49	1.45	8.55	8.49	8.54	59
長期 (7-11)	9	93.87	93.99	8.82	0.70	1.49	1.45	8.55	8.49	8.54	59
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
機械	1,323	97.58	97.66	4.74	0.39	0.85	0.83	4.62	4.60	4.62	42
短期 (1-3)	390	99.37	99.42	2.20	0.26	0.52	0.52	2.19	2.18	2.19	39
中期 (3-7)	690	97.64	97.73	4.75	0.38	0.86	0.85	4.69	4.67	4.69	43
長期 (7-)	243	94.52	94.63	8.77	0.64	1.35	1.32	8.52	8.47	8.52	47
長期 (7-11)	243	94.52	94.63	8.77	0.64	1.35	1.32	8.52	8.47	8.52	47
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
電気機器	1,975	98.07	98.17	4.40	0.48	0.83	0.82	4.28	4.26	4.28	45
短期 (1-3)	730	99.67	99.74	2.17	0.38	0.49	0.49	2.16	2.16	2.16	36
中期 (3-7)	1,030	97.59	97.70	5.02	0.46	0.94	0.93	4.94	4.92	4.94	48
長期 (7-)	215	94.91	95.10	8.95	0.87	1.55	1.51	8.59	8.52	8.58	64
長期 (7-11)	215	94.91	95.10	8.95	0.87	1.55	1.51	8.59	8.52	8.58	64
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
輸送用機器	1,223	97.36	97.46	4.60	0.36	0.79	0.78	4.40	4.37	4.39	40
短期 (1-3)	540	99.39	99.46	2.13	0.30	0.56	0.56	2.12	2.12	2.12	43
中期 (3-7)	429	98.13	98.22	4.34	0.33	0.75	0.74	4.30	4.28	4.30	37
長期 (7-)	254	91.75	91.92	10.27	0.52	1.41	1.35	9.80	9.73	9.79	38
長期 (7-11)	164	94.50	94.65	8.35	0.44	1.18	1.15	8.18	8.13	8.17	34
超長期 (11-)	90	86.75	86.94	13.76	0.67	1.87	1.75	13.03	12.92	13.01	47

出所:NFRG

- 東証 33 業種分類を参考に NFRG で分類

事業債 業種別・ポートフォリオ指標 (3/4) (2023年10月末)

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
精密機器	205	97.38	97.46	4.71	0.46	0.94	0.92	4.55	4.52	4.55	52
短期 (1-3)	85	99.61	99.69	1.80	0.25	0.46	0.46	1.79	1.79	1.79	38
中期 (3-7)	75	96.31	96.41	5.67	0.47	1.14	1.12	5.57	5.54	5.57	60
長期 (7-)	45	94.94	95.00	8.61	0.86	1.54	1.50	8.28	8.22	8.27	67
長期 (7-11)	45	94.94	95.00	8.61	0.86	1.54	1.50	8.28	8.22	8.27	67
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
その他製品	200	94.95	95.06	7.26	0.46	1.03	0.99	6.77	6.73	6.77	37
短期 (1-3)	35	99.54	99.59	1.91	0.29	0.52	0.52	1.90	1.90	1.90	43
中期 (3-7)	105	97.74	97.88	5.56	0.42	0.86	0.85	5.49	5.46	5.49	34
長期 (7-)	60	87.38	87.47	13.35	0.61	1.71	1.60	12.52	12.42	12.50	38
長期 (7-11)	15	95.58	95.66	7.85	0.55	1.17	1.14	7.68	7.64	7.68	38
超長期 (11-)	45	84.64	84.74	15.18	0.63	1.92	1.77	14.34	14.22	14.32	38
電気・ガス業	12,288	94.20	94.37	8.03	0.72	1.26	1.20	7.04	6.99	7.02	56
短期 (1-3)	2,524	99.90	100.00	2.01	0.47	0.47	0.47	1.99	1.99	1.99	37
中期 (3-7)	4,520	98.55	98.71	4.86	0.70	0.99	0.99	4.76	4.73	4.76	56
長期 (7-)	5,244	87.72	87.91	13.67	0.85	1.94	1.81	12.02	11.90	11.97	67
長期 (7-11)	2,507	94.06	94.21	8.66	0.76	1.56	1.51	8.35	8.29	8.35	67
超長期 (11-)	2,738	81.92	82.14	18.26	0.92	2.34	2.12	15.87	15.70	15.78	66
陸運業	6,127	91.33	91.50	13.44	0.96	1.39	1.29	10.47	10.38	10.40	39
短期 (1-3)	850	100.42	100.53	2.00	0.58	0.41	0.41	1.99	1.99	1.99	30
中期 (3-7)	1,579	101.33	101.51	5.19	1.13	0.83	0.83	5.04	5.01	5.03	37
長期 (7-)	3,698	84.96	85.14	19.59	0.98	1.94	1.77	15.55	15.39	15.41	43
長期 (7-11)	1,067	98.11	98.31	8.75	1.03	1.28	1.27	8.35	8.30	8.35	43
超長期 (11-)	2,631	79.63	79.81	23.99	0.96	2.26	2.02	19.14	18.94	18.93	44
海運業	88	99.18	99.42	5.19	0.94	1.01	1.00	5.00	4.97	5.00	54
短期 (1-3)	25	101.69	102.12	2.50	1.26	0.62	0.62	2.45	2.45	2.45	45
中期 (3-7)	43	97.52	97.63	5.08	0.49	1.00	0.99	5.01	4.99	5.01	54
長期 (7-)	20	99.60	99.88	8.79	1.52	1.51	1.51	8.23	8.17	8.22	67
長期 (7-11)	20	99.60	99.88	8.79	1.52	1.51	1.51	8.23	8.17	8.22	67
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
空運業	245	91.63	91.85	7.82	0.70	1.62	1.52	6.96	6.89	6.95	87
短期 (1-3)	80	99.33	99.50	2.47	0.60	0.90	0.90	2.45	2.44	2.45	74
中期 (3-7)	60	96.08	96.18	4.76	0.43	1.24	1.21	4.68	4.65	4.68	80
長期 (7-)	105	83.22	83.55	13.65	0.92	2.51	2.29	12.54	12.40	12.52	105
長期 (7-11)	20	95.43	95.87	9.63	1.20	1.76	1.72	9.06	8.99	9.06	79
超長期 (11-)	85	80.35	80.65	14.59	0.86	2.73	2.45	13.52	13.35	13.49	112
倉庫・運輸関連業	159	95.12	95.22	5.93	0.47	1.12	1.08	5.56	5.52	5.56	58
短期 (1-3)	44	99.96	100.05	1.56	0.45	0.47	0.47	1.55	1.55	1.55	42
中期 (3-7)	85	95.60	95.68	5.79	0.42	1.20	1.18	5.70	5.67	5.70	65
長期 (7-)	30	86.67	86.84	12.73	0.67	1.96	1.83	11.91	11.80	11.89	67
長期 (7-11)	10	92.34	92.51	7.68	0.55	1.68	1.61	7.51	7.45	7.51	87
超長期 (11-)	20	83.84	84.00	15.25	0.72	2.12	1.95	14.33	14.19	14.29	55
情報・通信業	2,125	96.25	96.44	4.91	0.77	1.38	1.34	4.53	4.49	4.53	94
短期 (1-3)	873	99.23	99.35	2.29	0.57	0.88	0.87	2.27	2.26	2.27	73
中期 (3-7)	835	97.23	97.41	4.85	0.75	1.32	1.30	4.75	4.72	4.75	88
長期 (7-)	418	88.05	88.39	10.48	1.22	2.67	2.50	9.38	9.26	9.35	154
長期 (7-11)	300	90.83	91.09	8.59	1.02	2.31	2.20	8.15	8.06	8.15	138
超長期 (11-)	118	80.93	81.49	15.32	1.73	3.70	3.35	12.89	12.67	12.80	201
卸売業	1,186	97.48	97.69	6.50	0.85	1.06	1.03	6.07	6.03	6.07	47
短期 (1-3)	238	100.40	100.58	1.93	0.71	0.50	0.50	1.92	1.91	1.92	41
中期 (3-7)	553	99.41	99.59	5.17	0.83	0.93	0.93	5.05	5.02	5.05	47
長期 (7-)	395	93.01	93.28	11.11	0.94	1.59	1.53	10.30	10.22	10.28	51
長期 (7-11)	240	97.49	97.79	8.62	1.02	1.34	1.32	8.24	8.19	8.24	49
超長期 (11-)	155	86.08	86.29	14.96	0.83	2.04	1.90	13.91	13.78	13.87	54

出所:NFRC

- 東証 33 業種分類を参考に NFRC で分類

事業債 業種別・ポートフォリオ指標 (3/4) (2023年10月末、11月ポートフォリオ)

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
精密機器	215	97.46	97.54	4.72	0.47	0.93	0.91	4.56	4.53	4.56	51
短期 (1-3)	85	99.61	99.69	1.80	0.25	0.46	0.46	1.79	1.79	1.79	38
中期 (3-7)	85	96.65	96.74	5.57	0.48	1.10	1.08	5.48	5.45	5.48	57
長期 (7-)	45	94.94	95.00	8.61	0.86	1.54	1.50	8.28	8.22	8.27	67
長期 (7-11)	45	94.94	95.00	8.61	0.86	1.54	1.50	8.28	8.22	8.27	67
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
その他製品	205	95.06	95.17	7.15	0.47	1.03	1.00	6.67	6.63	6.66	38
短期 (1-3)	40	99.55	99.61	2.03	0.37	0.59	0.59	2.02	2.01	2.02	48
中期 (3-7)	105	97.74	97.88	5.56	0.42	0.86	0.85	5.49	5.46	5.49	34
長期 (7-)	60	87.38	87.47	13.35	0.61	1.71	1.60	12.52	12.42	12.50	38
長期 (7-11)	15	95.58	95.66	7.85	0.55	1.17	1.14	7.68	7.64	7.68	38
超長期 (11-)	45	84.64	84.74	15.18	0.63	1.92	1.77	14.34	14.22	14.32	38
電気・ガス業	12,378	94.21	94.37	8.05	0.72	1.26	1.20	7.06	7.00	7.04	56
短期 (1-3)	2,594	99.87	99.97	2.03	0.46	0.48	0.48	2.02	2.02	2.02	37
中期 (3-7)	4,490	98.54	98.70	4.90	0.71	1.00	1.00	4.80	4.77	4.80	56
長期 (7-)	5,294	87.77	87.96	13.67	0.85	1.94	1.81	12.02	11.90	11.97	67
長期 (7-11)	2,537	94.07	94.22	8.68	0.76	1.56	1.51	8.37	8.30	8.36	67
超長期 (11-)	2,758	81.98	82.20	18.26	0.93	2.34	2.12	15.87	15.70	15.78	66
陸運業	6,127	91.33	91.50	13.44	0.96	1.39	1.29	10.47	10.38	10.40	39
短期 (1-3)	850	100.42	100.53	2.00	0.58	0.41	0.41	1.99	1.99	1.99	30
中期 (3-7)	1,584	101.31	101.49	5.20	1.13	0.83	0.83	5.04	5.02	5.04	37
長期 (7-)	3,693	84.95	85.13	19.61	0.98	1.94	1.77	15.56	15.41	15.42	43
長期 (7-11)	1,082	98.15	98.34	8.80	1.04	1.29	1.28	8.40	8.34	8.39	43
超長期 (11-)	2,611	79.48	79.66	24.09	0.96	2.27	2.03	19.22	19.02	19.02	44
海運業	96	99.16	99.39	5.16	0.93	1.00	1.00	4.98	4.95	4.98	54
短期 (1-3)	25	101.69	102.12	2.50	1.26	0.62	0.62	2.45	2.45	2.45	45
中期 (3-7)	51	97.75	97.86	5.05	0.53	1.00	0.98	4.97	4.95	4.97	54
長期 (7-)	20	99.60	99.88	8.79	1.52	1.51	1.51	8.23	8.17	8.22	67
長期 (7-11)	20	99.60	99.88	8.79	1.52	1.51	1.51	8.23	8.17	8.22	67
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
空運業	245	91.63	91.85	7.82	0.70	1.62	1.52	6.96	6.89	6.95	87
短期 (1-3)	80	99.33	99.50	2.47	0.60	0.90	0.90	2.45	2.44	2.45	74
中期 (3-7)	60	96.08	96.18	4.76	0.43	1.24	1.21	4.68	4.65	4.68	80
長期 (7-)	105	83.22	83.55	13.65	0.92	2.51	2.29	12.54	12.40	12.52	105
長期 (7-11)	20	95.43	95.87	9.63	1.20	1.76	1.72	9.06	8.99	9.06	79
超長期 (11-)	85	80.35	80.65	14.59	0.86	2.73	2.45	13.52	13.35	13.49	112
倉庫・運輸関連業	166	95.21	95.32	6.08	0.51	1.14	1.11	5.71	5.67	5.71	59
短期 (1-3)	44	99.96	100.05	1.56	0.45	0.47	0.47	1.55	1.55	1.55	42
中期 (3-7)	85	95.60	95.68	5.79	0.42	1.20	1.18	5.70	5.67	5.70	65
長期 (7-)	37	88.59	88.76	12.22	0.80	1.91	1.80	11.38	11.28	11.36	68
長期 (7-11)	17	94.36	94.53	8.55	0.88	1.69	1.64	8.21	8.14	8.21	82
超長期 (11-)	20	83.84	84.00	15.25	0.72	2.12	1.95	14.33	14.19	14.29	55
情報・通信業	2,125	96.25	96.44	4.91	0.77	1.38	1.34	4.53	4.49	4.53	94
短期 (1-3)	883	99.22	99.34	2.29	0.56	0.88	0.87	2.28	2.27	2.28	73
中期 (3-7)	825	97.22	97.41	4.88	0.76	1.33	1.31	4.77	4.74	4.77	88
長期 (7-)	418	88.05	88.39	10.48	1.22	2.67	2.50	9.38	9.26	9.35	154
長期 (7-11)	300	90.83	91.09	8.59	1.02	2.31	2.20	8.15	8.06	8.15	138
超長期 (11-)	118	80.93	81.49	15.32	1.73	3.70	3.35	12.89	12.67	12.80	201
卸売業	1,211	97.48	97.69	6.50	0.85	1.06	1.04	6.08	6.04	6.08	47
短期 (1-3)	238	100.40	100.58	1.93	0.71	0.50	0.50	1.92	1.91	1.92	41
中期 (3-7)	568	99.40	99.57	5.16	0.83	0.93	0.93	5.04	5.02	5.04	47
長期 (7-)	405	93.09	93.36	11.08	0.95	1.59	1.53	10.27	10.19	10.26	51
長期 (7-11)	250	97.45	97.74	8.67	1.02	1.34	1.32	8.29	8.23	8.28	49
超長期 (11-)	155	86.08	86.29	14.96	0.83	2.04	1.90	13.91	13.78	13.87	54

出所:NFRC

- 東証 33 業種分類を参考に NFRC で分類

事業債 業種別・ポートフォリオ指標 (4/4) (2023年10月末)

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
小売業	915	98.25	98.40	3.95	0.48	0.75	0.74	3.79	3.77	3.79	43
短期 (1-3)	480	99.80	99.95	2.11	0.43	0.48	0.48	2.10	2.09	2.10	36
中期 (3-7)	331	98.14	98.27	4.44	0.45	0.88	0.87	4.39	4.37	4.39	49
長期 (7-)	104	91.44	91.64	10.87	0.77	1.71	1.64	10.25	10.17	10.24	62
長期 (7-11)	64	93.47	93.59	8.54	0.70	1.59	1.55	8.27	8.21	8.27	72
超長期 (11-)	40	88.20	88.52	14.59	0.88	1.92	1.80	13.60	13.48	13.57	47
銀行業	1,550	100.42	100.73	3.62	1.18	0.99	0.99	3.51	3.49	3.51	70
短期 (1-3)	736	100.83	101.12	2.09	1.13	0.80	0.80	2.06	2.05	2.06	69
中期 (3-7)	757	99.88	100.19	4.80	1.17	1.14	1.14	4.65	4.62	4.65	72
長期 (7-)	57	102.26	103.00	7.81	1.87	1.48	1.49	7.26	7.21	7.25	76
長期 (7-11)	57	102.26	103.00	7.81	1.87	1.48	1.49	7.26	7.21	7.25	76
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
証券、商品先物取引業	985	99.47	99.76	2.61	0.90	1.02	1.02	2.57	2.55	2.57	84
短期 (1-3)	754	99.81	100.10	2.15	0.91	0.94	0.94	2.13	2.12	2.13	82
中期 (3-7)	227	98.50	98.79	4.01	0.88	1.26	1.25	3.94	3.91	3.94	92
長期 (7-)	5	92.26	92.39	8.84	0.90	1.93	1.85	8.49	8.41	8.48	100
長期 (7-11)	5	92.26	92.39	8.84	0.90	1.93	1.85	8.49	8.41	8.48	100
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
保険業	335	98.18	98.23	4.36	0.38	0.77	0.76	4.27	4.25	4.27	39
短期 (1-3)	5	99.50	99.54	1.86	0.30	0.57	0.57	1.86	1.85	1.86	48
中期 (3-7)	280	98.85	98.91	3.59	0.31	0.65	0.65	3.56	3.55	3.56	35
長期 (7-)	50	94.26	94.29	8.95	0.75	1.48	1.44	8.66	8.60	8.66	56
長期 (7-11)	50	94.26	94.29	8.95	0.75	1.48	1.44	8.66	8.60	8.66	56
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
その他金融業	5,477	97.79	97.89	4.13	0.37	0.82	0.81	4.00	3.98	4.00	47
短期 (1-3)	2,530	99.39	99.45	2.10	0.24	0.55	0.55	2.09	2.09	2.09	43
中期 (3-7)	2,291	97.53	97.65	4.88	0.42	0.93	0.92	4.81	4.78	4.81	49
長期 (7-)	656	92.53	92.69	9.32	0.64	1.56	1.49	8.92	8.86	8.92	60
長期 (7-11)	578	93.55	93.71	8.55	0.60	1.47	1.41	8.32	8.26	8.32	58
超長期 (11-)	78	85.00	85.12	15.03	0.96	2.29	2.11	13.82	13.67	13.78	75
不動産業	2,543	95.12	95.28	7.77	0.66	1.13	1.09	6.79	6.74	6.77	48
短期 (1-3)	471	99.82	99.92	1.91	0.43	0.49	0.49	1.90	1.89	1.90	39
中期 (3-7)	1,054	98.18	98.29	4.78	0.54	0.90	0.89	4.71	4.69	4.71	47
長期 (7-)	1,018	89.78	90.03	13.57	0.89	1.73	1.63	11.66	11.55	11.60	53
長期 (7-11)	565	96.31	96.60	8.75	0.90	1.38	1.36	8.39	8.33	8.38	51
超長期 (11-)	453	81.63	81.83	19.57	0.88	2.25	2.03	16.46	16.29	16.35	57
サービス業	867	87.25	87.44	4.98	0.54	3.11	2.72	4.33	4.26	4.33	235
短期 (1-3)	347	97.73	97.81	1.86	0.28	1.73	1.69	1.85	1.84	1.85	161
中期 (3-7)	305	91.58	91.71	4.98	0.43	2.62	2.40	4.95	4.90	4.95	195
長期 (7-)	215	64.21	64.66	10.02	1.12	7.46	5.90	9.13	8.88	9.12	496
長期 (7-11)	165	65.60	66.00	8.92	1.02	7.43	5.93	8.31	8.07	8.30	508
超長期 (11-)	50	59.64	60.21	13.66	1.45	7.54	5.79	12.11	11.79	12.06	452
財投機関債	20,580	96.38	96.59	9.68	0.76	0.94	0.91	8.13	8.07	8.08	20
短期 (1-3)	5,424	99.99	100.07	2.06	0.31	0.29	0.29	2.06	2.05	2.06	18
中期 (3-7)	6,307	100.28	100.44	4.62	0.67	0.60	0.60	4.54	4.53	4.54	20
長期 (7-)	8,849	91.39	91.70	17.95	1.10	1.64	1.56	14.99	14.86	14.88	22
長期 (7-11)	2,485	99.29	99.55	8.53	0.95	1.06	1.06	8.18	8.14	8.18	23
超長期 (11-)	6,364	88.31	88.63	21.62	1.15	1.89	1.78	17.98	17.81	17.82	21

出所:NFRC

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

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

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
小売業	915	98.25	98.40	3.95	0.48	0.75	0.74	3.79	3.77	3.79	43
短期 (1-3)	480	99.80	99.95	2.11	0.43	0.48	0.48	2.10	2.09	2.10	36
中期 (3-7)	331	98.14	98.27	4.44	0.45	0.88	0.87	4.39	4.37	4.39	49
長期 (7-)	104	91.44	91.64	10.87	0.77	1.71	1.64	10.25	10.17	10.24	62
長期 (7-11)	64	93.47	93.59	8.54	0.70	1.59	1.55	8.27	8.21	8.27	72
超長期 (11-)	40	88.20	88.52	14.59	0.88	1.92	1.80	13.60	13.48	13.57	47
銀行業	1,565	100.40	100.72	3.64	1.17	0.99	0.99	3.53	3.51	3.52	70
短期 (1-3)	776	100.89	101.20	2.13	1.15	0.80	0.81	2.11	2.10	2.11	68
中期 (3-7)	755	99.90	100.20	4.97	1.17	1.16	1.16	4.80	4.78	4.80	72
長期 (7-)	34	100.54	101.06	8.34	1.60	1.44	1.45	7.81	7.75	7.80	66
長期 (7-11)	34	100.54	101.06	8.34	1.60	1.44	1.45	7.81	7.75	7.80	66
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
証券、商品先物取引業	1,035	99.47	99.75	2.66	0.90	1.02	1.01	2.62	2.60	2.62	83
短期 (1-3)	784	99.80	100.09	2.18	0.90	0.94	0.94	2.15	2.14	2.15	81
中期 (3-7)	247	98.55	98.82	4.08	0.88	1.25	1.24	4.00	3.98	4.00	90
長期 (7-)	5	92.26	92.39	8.84	0.90	1.93	1.85	8.49	8.41	8.48	100
長期 (7-11)	5	92.26	92.39	8.84	0.90	1.93	1.85	8.49	8.41	8.48	100
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
保険業	335	98.18	98.23	4.36	0.38	0.77	0.76	4.27	4.25	4.27	39
短期 (1-3)	155	98.87	98.96	3.00	0.19	0.57	0.57	2.99	2.98	2.99	35
中期 (3-7)	130	98.85	98.87	4.22	0.45	0.73	0.73	4.19	4.17	4.19	37
長期 (7-)	50	94.26	94.29	8.95	0.75	1.48	1.44	8.66	8.60	8.66	56
長期 (7-11)	50	94.26	94.29	8.95	0.75	1.48	1.44	8.66	8.60	8.66	56
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
その他金融業	5,656	97.83	97.93	4.12	0.37	0.82	0.81	4.00	3.98	4.00	47
短期 (1-3)	2,642	99.39	99.46	2.13	0.25	0.55	0.55	2.12	2.12	2.12	43
中期 (3-7)	2,359	97.54	97.66	4.89	0.43	0.94	0.92	4.82	4.80	4.82	49
長期 (7-)	655	92.55	92.70	9.37	0.65	1.56	1.49	8.96	8.89	8.95	60
長期 (7-11)	577	93.57	93.73	8.60	0.61	1.47	1.42	8.36	8.30	8.36	58
超長期 (11-)	78	85.00	85.12	15.03	0.96	2.29	2.11	13.82	13.67	13.78	75
不動産業	2,643	95.16	95.33	8.02	0.69	1.16	1.11	7.01	6.96	6.99	48
短期 (1-3)	491	99.74	99.84	1.96	0.42	0.50	0.50	1.95	1.94	1.95	40
中期 (3-7)	1,034	98.18	98.29	4.82	0.55	0.90	0.89	4.74	4.72	4.74	47
長期 (7-)	1,118	90.36	90.60	13.64	0.94	1.73	1.64	11.75	11.64	11.69	53
長期 (7-11)	615	96.40	96.68	8.84	0.91	1.38	1.36	8.47	8.41	8.46	50
超長期 (11-)	503	82.97	83.17	19.50	0.97	2.24	2.04	16.40	16.23	16.28	56
サービス業	862	87.18	87.37	5.03	0.55	3.13	2.75	4.38	4.31	4.38	237
短期 (1-3)	337	97.67	97.75	1.89	0.28	1.77	1.73	1.88	1.86	1.88	164
中期 (3-7)	310	91.71	91.83	4.98	0.44	2.61	2.39	4.95	4.90	4.95	194
長期 (7-)	215	64.21	64.66	10.02	1.12	7.46	5.90	9.13	8.88	9.12	496
長期 (7-11)	165	65.60	66.00	8.92	1.02	7.43	5.93	8.31	8.07	8.30	508
超長期 (11-)	50	59.64	60.21	13.66	1.45	7.54	5.79	12.11	11.79	12.06	452
財投機関債	20,758	96.38	96.58	9.71	0.76	0.94	0.91	8.17	8.11	8.12	20
短期 (1-3)	5,452	99.97	100.04	2.11	0.30	0.30	0.30	2.10	2.09	2.10	18
中期 (3-7)	6,444	100.21	100.37	4.70	0.67	0.61	0.61	4.61	4.60	4.61	20
長期 (7-)	8,863	91.39	91.69	18.04	1.11	1.64	1.57	15.07	14.94	14.96	22
長期 (7-11)	2,430	99.38	99.64	8.62	0.98	1.07	1.06	8.26	8.21	8.25	23
超長期 (11-)	6,433	88.37	88.69	21.60	1.16	1.89	1.78	17.96	17.80	17.81	21

出所:NFRC

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

事業債 円建外債 格付別・ポートフォリオ指標 (2023年10月末)

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
事業債・円建外債 全体	71,402	95.89	96.06	7.54	0.69	1.08	1.04	6.50	6.45	6.48	47
短期 (1-3)	21,146	99.76	99.87	2.07	0.45	0.55	0.55	2.06	2.05	2.06	44
中期 (3-7)	26,429	98.73	98.89	4.74	0.64	0.90	0.90	4.65	4.63	4.65	48
長期 (7-)	23,827	89.29	89.53	15.49	0.96	1.81	1.70	13.17	13.05	13.09	49
長期 (7-11)	10,160	95.42	95.63	8.59	0.83	1.44	1.40	8.27	8.21	8.26	57
超長期 (11-)	13,667	84.73	85.00	20.62	1.05	2.12	1.95	17.27	17.09	17.13	43
AAA ~ A 格	70,292	95.86	96.03	7.59	0.69	1.07	1.03	6.55	6.50	6.52	46
短期 (1-3)	20,542	99.76	99.87	2.07	0.44	0.54	0.54	2.06	2.05	2.06	42
中期 (3-7)	26,042	98.75	98.90	4.74	0.64	0.89	0.89	4.65	4.63	4.65	47
長期 (7-)	23,708	89.29	89.53	15.52	0.96	1.81	1.70	13.19	13.07	13.11	49
長期 (7-11)	10,084	95.44	95.64	8.60	0.83	1.44	1.40	8.27	8.21	8.27	57
超長期 (11-)	13,625	84.73	85.00	20.64	1.05	2.12	1.95	17.28	17.11	17.14	43
AAA ~ AA 格	48,688	95.69	95.85	8.51	0.68	1.00	0.96	7.19	7.14	7.15	33
短期 (1-3)	13,295	99.85	99.94	2.09	0.35	0.41	0.41	2.08	2.08	2.08	29
中期 (3-7)	17,155	99.29	99.43	4.74	0.62	0.76	0.76	4.66	4.64	4.66	34
長期 (7-)	18,238	89.27	89.51	16.74	0.96	1.72	1.62	13.99	13.86	13.89	36
長期 (7-11)	7,000	96.68	96.89	8.56	0.81	1.25	1.23	8.25	8.20	8.25	41
超長期 (11-)	11,238	84.65	84.92	21.83	1.05	2.06	1.89	18.06	17.89	17.90	33
AAA 格	10,239	96.98	97.07	5.94	0.33	0.68	0.66	5.16	5.14	5.15	23
短期 (1-3)	3,852	99.56	99.59	2.11	0.13	0.32	0.32	2.11	2.10	2.11	20
中期 (3-7)	4,340	98.46	98.54	4.67	0.33	0.65	0.64	4.61	4.60	4.61	23
長期 (7-)	2,047	89.01	89.18	15.84	0.71	1.51	1.41	12.87	12.77	12.78	29
長期 (7-11)	1,240	95.35	95.50	8.43	0.51	1.13	1.10	8.23	8.18	8.22	28
超長期 (11-)	807	79.26	79.49	27.21	1.02	2.22	1.97	21.45	21.23	21.20	30
AA 格	38,449	95.35	95.53	9.20	0.77	1.08	1.04	7.74	7.68	7.70	36
短期 (1-3)	9,443	99.97	100.08	2.08	0.45	0.44	0.44	2.07	2.07	2.07	33
中期 (3-7)	12,815	99.57	99.73	4.77	0.72	0.80	0.80	4.67	4.65	4.67	38
長期 (7-)	16,191	89.30	89.55	16.85	0.99	1.75	1.65	14.13	14.00	14.03	37
長期 (7-11)	5,760	96.97	97.19	8.59	0.88	1.28	1.26	8.26	8.20	8.25	43
超長期 (11-)	10,431	85.07	85.34	21.42	1.05	2.04	1.89	17.82	17.65	17.67	33
A 格	21,604	96.23	96.41	5.53	0.72	1.25	1.21	5.11	5.07	5.11	75
短期 (1-3)	7,247	99.60	99.75	2.04	0.59	0.78	0.78	2.02	2.02	2.02	67
中期 (3-7)	8,887	97.72	97.89	4.73	0.67	1.16	1.14	4.64	4.61	4.64	72
長期 (7-)	5,471	89.33	89.58	11.45	0.96	2.10	1.96	10.51	10.41	10.49	91
長期 (7-11)	3,084	92.60	92.82	8.68	0.88	1.89	1.78	8.31	8.24	8.31	94
超長期 (11-)	2,387	85.12	85.40	15.01	1.07	2.41	2.21	13.60	13.45	13.56	87
BBB 格	1,110	97.87	98.16	3.84	0.90	1.29	1.27	3.62	3.59	3.62	98
短期 (1-3)	604	99.59	99.87	1.96	0.80	0.97	0.97	1.94	1.93	1.94	87
中期 (3-7)	387	97.57	97.84	4.70	1.03	1.57	1.55	4.57	4.54	4.57	114
長期 (7-)	119	90.14	90.49	10.56	1.02	2.13	2.02	9.69	9.59	9.68	104
長期 (7-11)	76	93.56	93.88	8.15	0.91	1.82	1.77	7.82	7.76	7.82	98
超長期 (11-)	43	84.02	84.45	14.84	1.21	2.73	2.51	13.40	13.24	13.36	117

出所:NFRC

- 格付は、格付会社4社の最高格付をもとに NFRC で分類

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

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
事業債・円建外債 全体	72,738	95.92	96.09	7.54	0.69	1.08	1.04	6.51	6.47	6.49	47
短期 (1-3)	21,756	99.75	99.87	2.11	0.45	0.56	0.55	2.10	2.09	2.10	44
中期 (3-7)	26,891	98.71	98.86	4.80	0.65	0.91	0.90	4.71	4.69	4.71	48
長期 (7-)	24,091	89.36	89.60	15.51	0.97	1.81	1.70	13.19	13.07	13.11	49
長期 (7-11)	10,305	95.45	95.66	8.67	0.85	1.45	1.41	8.33	8.27	8.33	57
超長期 (11-)	13,786	84.80	85.07	20.62	1.06	2.12	1.95	17.27	17.10	17.13	43
AAA~A 格	71,622	95.89	96.06	7.60	0.69	1.08	1.04	6.56	6.51	6.54	46
短期 (1-3)	21,152	99.76	99.87	2.11	0.44	0.54	0.54	2.10	2.09	2.10	42
中期 (3-7)	26,499	98.72	98.87	4.80	0.64	0.90	0.89	4.71	4.69	4.71	47
長期 (7-)	23,972	89.36	89.60	15.53	0.97	1.81	1.70	13.20	13.08	13.13	49
長期 (7-11)	10,229	95.47	95.67	8.67	0.85	1.45	1.40	8.34	8.28	8.33	57
超長期 (11-)	13,743	84.81	85.07	20.64	1.06	2.12	1.95	17.28	17.11	17.14	43
AAA~AA 格	49,632	95.73	95.90	8.50	0.68	1.00	0.96	7.19	7.14	7.16	34
短期 (1-3)	13,783	99.85	99.94	2.14	0.37	0.42	0.42	2.13	2.12	2.13	30
中期 (3-7)	17,442	99.26	99.40	4.80	0.63	0.77	0.77	4.72	4.70	4.72	35
長期 (7-)	18,408	89.32	89.56	16.77	0.96	1.73	1.62	14.02	13.90	13.93	36
長期 (7-11)	7,051	96.69	96.89	8.64	0.82	1.26	1.24	8.32	8.27	8.32	41
超長期 (11-)	11,357	84.74	85.00	21.82	1.05	2.06	1.89	18.05	17.88	17.90	33
AAA 格	10,284	96.99	97.07	5.96	0.34	0.68	0.66	5.18	5.16	5.17	23
短期 (1-3)	3,897	99.54	99.57	2.16	0.13	0.32	0.32	2.15	2.15	2.15	20
中期 (3-7)	4,390	98.42	98.51	4.74	0.34	0.66	0.65	4.68	4.67	4.68	24
長期 (7-)	1,997	88.85	89.03	16.05	0.73	1.52	1.42	13.03	12.92	12.94	29
長期 (7-11)	1,190	95.36	95.51	8.48	0.53	1.13	1.11	8.28	8.23	8.27	29
超長期 (11-)	807	79.26	79.49	27.21	1.02	2.22	1.97	21.45	21.23	21.20	30
AA 格	39,348	95.41	95.59	9.17	0.77	1.09	1.04	7.72	7.66	7.68	37
短期 (1-3)	9,886	99.97	100.08	2.13	0.46	0.46	0.46	2.12	2.11	2.12	33
中期 (3-7)	13,052	99.54	99.70	4.82	0.73	0.81	0.81	4.73	4.71	4.73	38
長期 (7-)	16,411	89.37	89.62	16.86	0.99	1.75	1.65	14.14	14.01	14.05	37
長期 (7-11)	5,862	96.96	97.17	8.67	0.88	1.29	1.27	8.33	8.28	8.33	43
超長期 (11-)	10,550	85.16	85.43	21.41	1.05	2.04	1.89	17.81	17.64	17.66	33
A 格	21,991	96.25	96.43	5.56	0.71	1.24	1.20	5.15	5.11	5.14	74
短期 (1-3)	7,369	99.59	99.74	2.06	0.58	0.78	0.77	2.05	2.04	2.05	66
中期 (3-7)	9,057	97.70	97.86	4.79	0.66	1.15	1.13	4.70	4.67	4.70	71
長期 (7-)	5,564	89.48	89.73	11.43	0.97	2.09	1.96	10.50	10.40	10.48	91
長期 (7-11)	3,178	92.76	92.98	8.74	0.90	1.88	1.78	8.37	8.29	8.36	93
超長期 (11-)	2,387	85.12	85.40	15.01	1.07	2.41	2.21	13.60	13.45	13.56	87
BBB 格	1,116	97.88	98.16	3.85	0.91	1.30	1.28	3.63	3.60	3.63	98
短期 (1-3)	604	99.59	99.87	1.97	0.80	0.97	0.97	1.95	1.94	1.95	87
中期 (3-7)	392	97.59	97.86	4.71	1.04	1.57	1.55	4.57	4.54	4.57	114
長期 (7-)	119	90.14	90.49	10.56	1.02	2.13	2.02	9.69	9.59	9.68	104
長期 (7-11)	76	93.56	93.88	8.15	0.91	1.82	1.77	7.82	7.76	7.82	98
超長期 (11-)	43	84.02	84.45	14.84	1.21	2.73	2.51	13.40	13.24	13.36	117

出所:NFRC

- 格付は、格付会社4社の最高格付をもとにNFRCで分類

事業債 最高格付別・ポートフォリオ指標 (2023年10月末)

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
AAA~AA格	47,800	95.64	95.80	8.60	0.67	0.99	0.95	7.26	7.21	7.22	32
短期(1-3)	12,883	99.87	99.96	2.09	0.35	0.39	0.39	2.08	2.07	2.08	27
中期(3-7)	16,726	99.32	99.46	4.76	0.62	0.75	0.74	4.67	4.65	4.67	33
長期(7-)	18,191	89.26	89.50	16.76	0.96	1.72	1.62	14.00	13.88	13.91	36
長期(7-11)	6,958	96.71	96.91	8.56	0.81	1.25	1.23	8.25	8.20	8.25	40
超長期(11-)	11,234	84.65	84.92	21.84	1.05	2.06	1.89	18.07	17.89	17.91	33
AAA~A格	67,536	95.76	95.93	7.75	0.67	1.06	1.02	6.67	6.62	6.64	43
短期(1-3)	19,384	99.77	99.87	2.07	0.40	0.50	0.50	2.06	2.06	2.06	38
中期(3-7)	24,680	98.81	98.95	4.77	0.62	0.86	0.85	4.68	4.66	4.68	44
長期(7-)	23,473	89.25	89.49	15.56	0.95	1.80	1.69	13.22	13.10	13.14	48
長期(7-11)	9,962	95.47	95.67	8.59	0.83	1.43	1.39	8.27	8.21	8.26	56
超長期(11-)	13,510	84.66	84.93	20.70	1.04	2.11	1.94	17.33	17.16	17.19	41
AAA~BBB格	68,174	95.78	95.94	7.71	0.67	1.06	1.02	6.64	6.59	6.61	44
短期(1-3)	19,673	99.77	99.87	2.07	0.40	0.50	0.50	2.06	2.06	2.06	39
中期(3-7)	24,966	98.79	98.93	4.76	0.62	0.87	0.86	4.68	4.66	4.68	44
長期(7-)	23,535	89.25	89.49	15.55	0.95	1.80	1.69	13.21	13.09	13.13	48
長期(7-11)	10,004	95.46	95.67	8.59	0.83	1.43	1.39	8.27	8.21	8.26	56
超長期(11-)	13,530	84.66	84.92	20.69	1.04	2.11	1.94	17.33	17.15	17.19	41
AAA~BB格	68,174	95.78	95.94	7.71	0.67	1.06	1.02	6.64	6.59	6.61	44
短期(1-3)	19,673	99.77	99.87	2.07	0.40	0.50	0.50	2.06	2.06	2.06	39
中期(3-7)	24,966	98.79	98.93	4.76	0.62	0.87	0.86	4.68	4.66	4.68	44
長期(7-)	23,535	89.25	89.49	15.55	0.95	1.80	1.69	13.21	13.09	13.13	48
長期(7-11)	10,004	95.46	95.67	8.59	0.83	1.43	1.39	8.27	8.21	8.26	56
超長期(11-)	13,530	84.66	84.92	20.69	1.04	2.11	1.94	17.33	17.15	17.19	41
AAA格	10,239	96.98	97.07	5.94	0.33	0.68	0.66	5.16	5.14	5.15	23
短期(1-3)	3,852	99.56	99.59	2.11	0.13	0.32	0.32	2.11	2.10	2.11	20
中期(3-7)	4,340	98.46	98.54	4.67	0.33	0.65	0.64	4.61	4.60	4.61	23
長期(7-)	2,047	89.01	89.18	15.84	0.71	1.51	1.41	12.87	12.77	12.78	29
長期(7-11)	1,240	95.35	95.50	8.43	0.51	1.13	1.10	8.23	8.18	8.22	28
超長期(11-)	807	79.26	79.49	27.21	1.02	2.22	1.97	21.45	21.23	21.20	30
AA格	37,562	95.27	95.46	9.33	0.77	1.08	1.04	7.84	7.78	7.80	35
短期(1-3)	9,031	100.01	100.11	2.07	0.44	0.42	0.42	2.06	2.06	2.06	31
中期(3-7)	12,386	99.62	99.78	4.79	0.72	0.78	0.78	4.69	4.67	4.69	36
長期(7-)	16,145	89.29	89.54	16.88	0.99	1.75	1.64	14.14	14.02	14.05	37
長期(7-11)	5,718	97.00	97.22	8.59	0.88	1.28	1.26	8.26	8.20	8.25	43
超長期(11-)	10,427	85.07	85.34	21.42	1.05	2.04	1.89	17.82	17.65	17.67	33
A格	19,736	96.06	96.22	5.67	0.67	1.21	1.17	5.24	5.20	5.24	70
短期(1-3)	6,501	99.58	99.71	2.05	0.51	0.71	0.71	2.04	2.03	2.04	60
中期(3-7)	7,954	97.73	97.88	4.79	0.62	1.11	1.09	4.70	4.68	4.70	67
長期(7-)	5,282	89.21	89.44	11.43	0.93	2.07	1.93	10.52	10.42	10.50	88
長期(7-11)	3,005	92.60	92.81	8.67	0.87	1.87	1.76	8.31	8.24	8.31	93
超長期(11-)	2,277	84.72	84.98	15.06	1.00	2.36	2.17	13.71	13.56	13.66	82
BBB格	638	97.52	97.70	4.01	0.76	1.26	1.24	3.82	3.79	3.82	92
短期(1-3)	290	99.43	99.58	2.10	0.54	0.82	0.81	2.08	2.08	2.08	70
中期(3-7)	287	97.26	97.46	4.56	0.98	1.59	1.57	4.45	4.41	4.44	118
長期(7-)	62	89.87	90.06	10.36	0.78	1.90	1.80	9.64	9.54	9.62	84
長期(7-11)	42	93.37	93.54	7.91	0.70	1.65	1.60	7.68	7.62	7.68	83
超長期(11-)	20	82.51	82.75	15.49	0.93	2.50	2.28	14.27	14.11	14.23	87
BB格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
B格以下	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
格付なし	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

出所:NFRC

- 格付は、格付会社4社の最高格付をもとにNFRCで分類

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

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
AAA~AA 格	48,551	95.67	95.84	8.61	0.68	1.00	0.96	7.27	7.22	7.24	33
短期 (1-3)	13,344	99.87	99.95	2.13	0.36	0.40	0.40	2.12	2.12	2.12	28
中期 (3-7)	16,857	99.29	99.43	4.82	0.63	0.76	0.75	4.73	4.71	4.73	33
長期 (7-)	18,350	89.30	89.54	16.79	0.96	1.73	1.62	14.04	13.91	13.94	36
長期 (7-11)	6,998	96.71	96.91	8.64	0.82	1.26	1.24	8.32	8.27	8.32	40
超長期 (11-)	11,352	84.74	85.00	21.82	1.05	2.06	1.89	18.06	17.88	17.90	33
AAA~A 格	68,673	95.80	95.96	7.75	0.68	1.06	1.02	6.68	6.64	6.66	43
短期 (1-3)	19,907	99.75	99.85	2.11	0.40	0.50	0.50	2.10	2.10	2.10	38
中期 (3-7)	25,042	98.79	98.93	4.82	0.63	0.87	0.86	4.74	4.72	4.74	44
長期 (7-)	23,725	89.32	89.55	15.58	0.96	1.80	1.69	13.24	13.12	13.16	48
長期 (7-11)	10,096	95.50	95.70	8.67	0.84	1.44	1.39	8.33	8.28	8.33	56
超長期 (11-)	13,629	84.74	85.00	20.69	1.04	2.11	1.94	17.33	17.16	17.19	41
AAA~BBB 格	69,317	95.81	95.97	7.72	0.68	1.06	1.02	6.66	6.61	6.63	44
短期 (1-3)	20,196	99.75	99.85	2.11	0.40	0.51	0.51	2.10	2.10	2.10	39
中期 (3-7)	25,333	98.77	98.92	4.82	0.63	0.88	0.87	4.73	4.71	4.73	44
長期 (7-)	23,787	89.32	89.55	15.56	0.96	1.80	1.69	13.23	13.11	13.15	48
長期 (7-11)	10,138	95.49	95.69	8.66	0.84	1.44	1.39	8.33	8.27	8.33	56
超長期 (11-)	13,649	84.73	85.00	20.69	1.04	2.11	1.94	17.33	17.15	17.19	41
AAA~BB 格	69,317	95.81	95.97	7.72	0.68	1.06	1.02	6.66	6.61	6.63	44
短期 (1-3)	20,196	99.75	99.85	2.11	0.40	0.51	0.51	2.10	2.10	2.10	39
中期 (3-7)	25,333	98.77	98.92	4.82	0.63	0.88	0.87	4.73	4.71	4.73	44
長期 (7-)	23,787	89.32	89.55	15.56	0.96	1.80	1.69	13.23	13.11	13.15	48
長期 (7-11)	10,138	95.49	95.69	8.66	0.84	1.44	1.39	8.33	8.27	8.33	56
超長期 (11-)	13,649	84.73	85.00	20.69	1.04	2.11	1.94	17.33	17.15	17.19	41
AAA 格	10,284	96.99	97.07	5.96	0.34	0.68	0.66	5.18	5.16	5.17	23
短期 (1-3)	3,897	99.54	99.57	2.16	0.13	0.32	0.32	2.15	2.15	2.15	20
中期 (3-7)	4,390	98.42	98.51	4.74	0.34	0.66	0.65	4.68	4.67	4.68	24
長期 (7-)	1,997	88.85	89.03	16.05	0.73	1.52	1.42	13.03	12.92	12.94	29
長期 (7-11)	1,190	95.36	95.51	8.48	0.53	1.13	1.11	8.28	8.23	8.27	29
超長期 (11-)	807	79.26	79.49	27.21	1.02	2.22	1.97	21.45	21.23	21.20	30
AA 格	38,267	95.32	95.51	9.32	0.77	1.08	1.04	7.84	7.78	7.80	35
短期 (1-3)	9,447	100.00	100.11	2.12	0.45	0.44	0.44	2.11	2.11	2.11	32
中期 (3-7)	12,467	99.60	99.76	4.84	0.72	0.79	0.79	4.75	4.73	4.75	36
長期 (7-)	16,353	89.36	89.60	16.88	0.99	1.75	1.65	14.16	14.03	14.07	37
長期 (7-11)	5,808	96.98	97.19	8.67	0.88	1.28	1.26	8.33	8.28	8.32	43
超長期 (11-)	10,545	85.16	85.42	21.41	1.05	2.04	1.89	17.81	17.64	17.66	33
A 格	20,122	96.09	96.25	5.69	0.66	1.21	1.16	5.27	5.24	5.27	69
短期 (1-3)	6,563	99.53	99.65	2.07	0.49	0.71	0.70	2.06	2.05	2.06	59
中期 (3-7)	8,184	97.75	97.90	4.84	0.63	1.10	1.09	4.75	4.72	4.75	66
長期 (7-)	5,375	89.36	89.59	11.42	0.94	2.07	1.92	10.51	10.41	10.49	88
長期 (7-11)	3,099	92.77	92.98	8.74	0.89	1.86	1.76	8.37	8.29	8.36	92
超長期 (11-)	2,277	84.72	84.98	15.06	1.00	2.36	2.17	13.71	13.56	13.66	82
BBB 格	643	97.54	97.71	4.03	0.77	1.27	1.25	3.84	3.81	3.84	93
短期 (1-3)	290	99.42	99.57	2.13	0.56	0.83	0.82	2.11	2.11	2.11	70
中期 (3-7)	292	97.29	97.49	4.57	0.99	1.60	1.57	4.45	4.41	4.45	118
長期 (7-)	62	89.87	90.06	10.36	0.78	1.90	1.80	9.64	9.54	9.62	84
長期 (7-11)	42	93.37	93.54	7.91	0.70	1.65	1.60	7.68	7.62	7.68	83
超長期 (11-)	20	82.51	82.75	15.49	0.93	2.50	2.28	14.27	14.11	14.23	87
BB 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
B 格以下	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
格付なし	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

出所:NFRC

- 格付は、格付会社4社の最高格付をもとにNFRCで分類

事業債 最低格付別・ポートフォリオ指標 (2023年10月末)

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
AAA~AA格	9,123	94.98	95.10	8.12	0.55	0.95	0.90	6.69	6.65	6.66	34
短期(1-3)	2,511	99.88	99.95	2.01	0.35	0.39	0.39	2.00	2.00	2.00	28
中期(3-7)	3,798	98.61	98.72	4.67	0.47	0.76	0.76	4.60	4.59	4.60	35
長期(7-)	2,814	85.72	85.89	18.24	0.82	1.81	1.67	14.81	14.67	14.69	39
長期(7-11)	1,050	95.10	95.27	8.75	0.65	1.29	1.26	8.49	8.43	8.48	41
超長期(11-)	1,764	80.13	80.31	23.89	0.92	2.18	1.96	19.27	19.07	19.07	37
AAA~A格	64,264	95.74	95.90	7.84	0.67	1.05	1.01	6.73	6.69	6.71	42
短期(1-3)	18,183	99.78	99.88	2.07	0.39	0.49	0.49	2.06	2.05	2.06	37
中期(3-7)	23,356	98.84	98.98	4.75	0.61	0.84	0.83	4.67	4.65	4.67	42
長期(7-)	22,725	89.32	89.56	15.62	0.95	1.79	1.68	13.25	13.13	13.17	47
長期(7-11)	9,615	95.54	95.74	8.60	0.83	1.43	1.38	8.27	8.21	8.26	55
超長期(11-)	13,110	84.77	85.03	20.77	1.04	2.10	1.93	17.37	17.20	17.23	40
AAA~BBB格	67,934	95.76	95.93	7.71	0.67	1.06	1.02	6.64	6.60	6.62	43
短期(1-3)	19,673	99.77	99.87	2.07	0.40	0.50	0.50	2.06	2.06	2.06	39
中期(3-7)	24,751	98.77	98.91	4.76	0.61	0.86	0.85	4.68	4.65	4.68	43
長期(7-)	23,510	89.25	89.49	15.54	0.95	1.80	1.69	13.21	13.09	13.13	48
長期(7-11)	10,004	95.46	95.67	8.59	0.83	1.43	1.39	8.27	8.21	8.26	56
超長期(11-)	13,505	84.65	84.91	20.70	1.04	2.11	1.94	17.33	17.16	17.19	41
AAA~BB格	68,174	95.78	95.94	7.71	0.67	1.06	1.02	6.64	6.59	6.61	44
短期(1-3)	19,673	99.77	99.87	2.07	0.40	0.50	0.50	2.06	2.06	2.06	39
中期(3-7)	24,966	98.79	98.93	4.76	0.62	0.87	0.86	4.68	4.66	4.68	44
長期(7-)	23,535	89.25	89.49	15.55	0.95	1.80	1.69	13.21	13.09	13.13	48
長期(7-11)	10,004	95.46	95.67	8.59	0.83	1.43	1.39	8.27	8.21	8.26	56
超長期(11-)	13,530	84.66	84.92	20.69	1.04	2.11	1.94	17.33	17.15	17.19	41
AAA格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA格	9,123	94.98	95.10	8.12	0.55	0.95	0.90	6.69	6.65	6.66	34
短期(1-3)	2,511	99.88	99.95	2.01	0.35	0.39	0.39	2.00	2.00	2.00	28
中期(3-7)	3,798	98.61	98.72	4.67	0.47	0.76	0.76	4.60	4.59	4.60	35
長期(7-)	2,814	85.72	85.89	18.24	0.82	1.81	1.67	14.81	14.67	14.69	39
長期(7-11)	1,050	95.10	95.27	8.75	0.65	1.29	1.26	8.49	8.43	8.48	41
超長期(11-)	1,764	80.13	80.31	23.89	0.92	2.18	1.96	19.27	19.07	19.07	37
A格	55,141	95.87	96.04	7.79	0.69	1.07	1.03	6.74	6.69	6.72	43
短期(1-3)	15,672	99.76	99.86	2.08	0.40	0.51	0.50	2.07	2.06	2.07	39
中期(3-7)	19,558	98.88	99.03	4.76	0.63	0.85	0.85	4.68	4.66	4.68	43
長期(7-)	19,911	89.83	90.08	15.25	0.97	1.79	1.68	13.04	12.93	12.97	48
長期(7-11)	8,565	95.59	95.80	8.58	0.85	1.44	1.40	8.24	8.19	8.24	57
超長期(11-)	11,346	85.49	85.76	20.29	1.06	2.08	1.92	17.09	16.93	16.96	41
BBB格	3,670	96.18	96.34	5.59	0.64	1.13	1.10	5.06	5.02	5.05	66
短期(1-3)	1,491	99.67	99.79	2.13	0.53	0.68	0.68	2.11	2.11	2.11	56
中期(3-7)	1,395	97.57	97.73	4.93	0.66	1.19	1.17	4.84	4.82	4.84	74
長期(7-)	785	87.09	87.32	13.33	0.83	2.01	1.86	11.87	11.75	11.83	73
長期(7-11)	390	93.53	93.73	8.49	0.74	1.62	1.55	8.20	8.14	8.20	73
超長期(11-)	395	80.73	80.99	18.12	0.90	2.46	2.22	16.06	15.88	15.98	72
BB格	240	99.98	100.59	6.57	2.26	2.12	2.12	5.89	5.82	5.87	155
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	215	101.10	101.67	5.41	2.25	2.01	2.01	5.09	5.04	5.09	153
長期(7-)	25	90.33	91.34	16.57	2.37	3.27	3.12	13.48	13.27	13.37	168
長期(7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期(11-)	25	90.33	91.34	16.57	2.37	3.27	3.12	13.48	13.27	13.37	168
B格以下	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
格付なし	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

出所:NFRC

- 格付は、格付会社4社の最低格付をもとにNFRCで分類

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

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
AAA~AA 格	9,299	95.04	95.16	8.10	0.55	0.95	0.90	6.69	6.64	6.66	34
短期 (1-3)	2,711	99.80	99.88	2.11	0.34	0.40	0.40	2.10	2.10	2.10	28
中期 (3-7)	3,722	98.61	98.72	4.75	0.49	0.77	0.77	4.68	4.66	4.68	35
長期 (7-)	2,866	85.91	86.09	18.11	0.83	1.80	1.67	14.72	14.58	14.60	39
長期 (7-11)	1,095	95.18	95.35	8.80	0.66	1.29	1.26	8.53	8.47	8.52	41
超長期 (11-)	1,771	80.19	80.36	23.87	0.92	2.18	1.96	19.26	19.06	19.06	37
AAA~A 格	65,071	95.76	95.92	7.85	0.67	1.05	1.01	6.75	6.70	6.73	42
短期 (1-3)	18,665	99.76	99.85	2.11	0.39	0.49	0.49	2.10	2.09	2.10	37
中期 (3-7)	23,523	98.82	98.96	4.81	0.61	0.85	0.84	4.72	4.70	4.72	42
長期 (7-)	22,883	89.36	89.60	15.66	0.96	1.80	1.68	13.29	13.17	13.21	47
長期 (7-11)	9,654	95.55	95.75	8.66	0.84	1.43	1.39	8.33	8.27	8.32	55
超長期 (11-)	13,229	84.84	85.10	20.77	1.05	2.10	1.93	17.37	17.20	17.23	40
AAA~BBB 格	69,077	95.80	95.96	7.72	0.67	1.06	1.02	6.66	6.61	6.63	43
短期 (1-3)	20,196	99.75	99.85	2.11	0.40	0.51	0.51	2.10	2.10	2.10	39
中期 (3-7)	25,118	98.75	98.89	4.82	0.62	0.87	0.86	4.73	4.71	4.73	44
長期 (7-)	23,762	89.32	89.55	15.56	0.96	1.80	1.69	13.23	13.11	13.15	48
長期 (7-11)	10,138	95.49	95.69	8.66	0.84	1.44	1.39	8.33	8.27	8.33	56
超長期 (11-)	13,624	84.72	84.98	20.69	1.04	2.11	1.94	17.33	17.16	17.19	41
AAA~BB 格	69,317	95.81	95.97	7.72	0.68	1.06	1.02	6.66	6.61	6.63	44
短期 (1-3)	20,196	99.75	99.85	2.11	0.40	0.51	0.51	2.10	2.10	2.10	39
中期 (3-7)	25,333	98.77	98.92	4.82	0.63	0.88	0.87	4.73	4.71	4.73	44
長期 (7-)	23,787	89.32	89.55	15.56	0.96	1.80	1.69	13.23	13.11	13.15	48
長期 (7-11)	10,138	95.49	95.69	8.66	0.84	1.44	1.39	8.33	8.27	8.33	56
超長期 (11-)	13,649	84.73	85.00	20.69	1.04	2.11	1.94	17.33	17.15	17.19	41
AAA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA 格	9,299	95.04	95.16	8.10	0.55	0.95	0.90	6.69	6.64	6.66	34
短期 (1-3)	2,711	99.80	99.88	2.11	0.34	0.40	0.40	2.10	2.10	2.10	28
中期 (3-7)	3,722	98.61	98.72	4.75	0.49	0.77	0.77	4.68	4.66	4.68	35
長期 (7-)	2,866	85.91	86.09	18.11	0.83	1.80	1.67	14.72	14.58	14.60	39
長期 (7-11)	1,095	95.18	95.35	8.80	0.66	1.29	1.26	8.53	8.47	8.52	41
超長期 (11-)	1,771	80.19	80.36	23.87	0.92	2.18	1.96	19.26	19.06	19.06	37
A 格	55,772	95.88	96.05	7.81	0.69	1.07	1.03	6.76	6.71	6.74	43
短期 (1-3)	15,955	99.75	99.85	2.11	0.40	0.51	0.51	2.10	2.09	2.10	39
中期 (3-7)	19,801	98.86	99.01	4.82	0.64	0.86	0.85	4.73	4.71	4.73	43
長期 (7-)	20,017	89.85	90.10	15.31	0.98	1.79	1.69	13.10	12.98	13.02	48
長期 (7-11)	8,559	95.60	95.80	8.64	0.86	1.45	1.40	8.30	8.24	8.30	57
超長期 (11-)	11,458	85.56	85.84	20.29	1.06	2.08	1.93	17.10	16.93	16.96	41
BBB 格	4,005	96.37	96.53	5.65	0.67	1.14	1.10	5.14	5.10	5.13	65
短期 (1-3)	1,531	99.66	99.79	2.15	0.53	0.68	0.68	2.14	2.13	2.14	56
中期 (3-7)	1,595	97.73	97.88	4.97	0.68	1.17	1.16	4.88	4.85	4.88	72
長期 (7-)	880	88.20	88.42	12.96	0.88	1.97	1.83	11.56	11.45	11.52	72
長期 (7-11)	485	94.28	94.48	8.76	0.86	1.62	1.56	8.42	8.35	8.41	71
超長期 (11-)	395	80.73	80.99	18.12	0.90	2.46	2.22	16.06	15.88	15.98	72
BB 格	240	99.98	100.59	6.57	2.26	2.12	2.12	5.89	5.82	5.87	155
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	215	101.10	101.67	5.41	2.25	2.01	2.01	5.09	5.04	5.09	153
長期 (7-)	25	90.33	91.34	16.57	2.37	3.27	3.12	13.48	13.27	13.37	168
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	25	90.33	91.34	16.57	2.37	3.27	3.12	13.48	13.27	13.37	168
B 格以下	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
格付なし	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

出所:NFRC

- 格付は、格付会社4社の最低格付をもとにNFRCで分類

事業債 R&I 格付別・ポートフォリオ指標 (2023年10月末)

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
AAA~AA 格	35,922	95.61	95.78	9.35	0.71	0.98	0.94	7.75	7.69	7.71	27
短期 (1-3)	9,293	99.88	99.95	2.06	0.29	0.34	0.34	2.05	2.05	2.05	23
中期 (3-7)	12,089	99.79	99.94	4.70	0.65	0.69	0.69	4.61	4.60	4.61	28
長期 (7-)	14,540	89.40	89.66	17.88	1.02	1.71	1.61	14.71	14.58	14.60	30
長期 (7-11)	4,918	97.89	98.12	8.67	0.90	1.18	1.16	8.32	8.27	8.32	33
超長期 (11-)	9,622	85.07	85.34	22.59	1.08	2.02	1.87	18.47	18.29	18.29	29
AAA~A 格	61,353	95.78	95.95	7.97	0.68	1.03	0.99	6.82	6.77	6.79	40
短期 (1-3)	17,341	99.82	99.91	2.08	0.38	0.45	0.45	2.07	2.06	2.07	34
中期 (3-7)	22,045	99.05	99.19	4.75	0.64	0.83	0.82	4.66	4.64	4.66	41
長期 (7-)	21,967	89.33	89.56	15.86	0.95	1.77	1.66	13.41	13.29	13.33	44
長期 (7-11)	9,072	95.96	96.16	8.59	0.82	1.35	1.33	8.27	8.22	8.27	50
超長期 (11-)	12,895	84.66	84.92	20.98	1.04	2.10	1.93	17.51	17.33	17.36	40
AAA~BBB 格	62,124	95.77	95.94	7.93	0.68	1.04	1.00	6.79	6.75	6.77	41
短期 (1-3)	17,654	99.80	99.90	2.08	0.39	0.47	0.46	2.07	2.06	2.07	35
中期 (3-7)	22,350	99.01	99.16	4.75	0.64	0.84	0.83	4.66	4.64	4.66	42
長期 (7-)	22,120	89.29	89.53	15.83	0.95	1.77	1.67	13.39	13.27	13.31	45
長期 (7-11)	9,140	95.91	96.10	8.58	0.82	1.36	1.33	8.27	8.21	8.26	50
超長期 (11-)	12,980	84.64	84.90	20.93	1.04	2.10	1.93	17.48	17.31	17.34	40
AAA~BB 格	62,124	95.77	95.94	7.93	0.68	1.04	1.00	6.79	6.75	6.77	41
短期 (1-3)	17,654	99.80	99.90	2.08	0.39	0.47	0.46	2.07	2.06	2.07	35
中期 (3-7)	22,350	99.01	99.16	4.75	0.64	0.84	0.83	4.66	4.64	4.66	42
長期 (7-)	22,120	89.29	89.53	15.83	0.95	1.77	1.67	13.39	13.27	13.31	45
長期 (7-11)	9,140	95.91	96.10	8.58	0.82	1.36	1.33	8.27	8.21	8.26	50
超長期 (11-)	12,980	84.64	84.90	20.93	1.04	2.10	1.93	17.48	17.31	17.34	40
AAA 格	755	97.80	97.87	4.40	0.23	0.63	0.62	4.27	4.26	4.27	26
短期 (1-3)	320	99.38	99.39	2.20	0.11	0.37	0.37	2.20	2.20	2.20	24
中期 (3-7)	275	98.53	98.60	4.13	0.26	0.62	0.61	4.11	4.09	4.11	26
長期 (7-)	160	93.41	93.57	9.26	0.44	1.21	1.17	8.99	8.93	8.98	29
長期 (7-11)	130	94.79	94.94	8.41	0.43	1.13	1.10	8.24	8.19	8.23	28
超長期 (11-)	30	87.44	87.62	12.92	0.45	1.63	1.52	12.51	12.41	12.50	30
AA 格	35,167	95.57	95.74	9.46	0.72	0.99	0.95	7.82	7.77	7.78	27
短期 (1-3)	8,973	99.90	99.97	2.06	0.30	0.34	0.34	2.05	2.05	2.05	23
中期 (3-7)	11,814	99.82	99.97	4.71	0.66	0.69	0.69	4.62	4.61	4.62	28
長期 (7-)	14,380	89.36	89.62	17.98	1.03	1.71	1.61	14.78	14.65	14.66	30
長期 (7-11)	4,788	97.98	98.20	8.67	0.91	1.18	1.17	8.32	8.27	8.32	33
超長期 (11-)	9,592	85.06	85.33	22.62	1.09	2.02	1.87	18.48	18.31	18.31	29
A 格	25,431	96.03	96.18	6.02	0.63	1.10	1.07	5.52	5.48	5.51	57
短期 (1-3)	8,048	99.74	99.86	2.09	0.49	0.58	0.58	2.08	2.08	2.08	46
中期 (3-7)	9,956	98.14	98.29	4.81	0.62	1.00	0.99	4.72	4.70	4.72	57
長期 (7-)	7,428	89.17	89.37	11.90	0.81	1.88	1.77	10.86	10.76	10.83	71
長期 (7-11)	4,154	93.68	93.85	8.50	0.72	1.58	1.53	8.21	8.15	8.21	71
超長期 (11-)	3,274	83.45	83.68	16.22	0.92	2.32	2.13	14.63	14.48	14.58	72
BBB 格	771	94.99	95.18	4.95	0.65	1.63	1.57	4.57	4.53	4.57	117
短期 (1-3)	314	98.99	99.15	2.09	0.53	1.22	1.22	2.08	2.07	2.08	110
中期 (3-7)	305	96.18	96.36	4.55	0.71	1.66	1.62	4.47	4.43	4.47	122
長期 (7-)	153	84.41	84.67	11.62	0.79	2.55	2.31	10.80	10.67	10.78	124
長期 (7-11)	68	88.19	88.37	7.94	0.68	2.45	2.22	7.70	7.61	7.69	146
超長期 (11-)	85	81.39	81.72	14.56	0.88	2.64	2.39	13.48	13.32	13.44	106
BB 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
B 格以下	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
格付なし	6,050	95.83	96.00	5.41	0.63	1.28	1.21	5.06	5.02	5.05	76
短期 (1-3)	2,019	99.50	99.61	2.05	0.56	0.83	0.83	2.04	2.03	2.04	71
中期 (3-7)	2,617	96.92	97.05	4.93	0.49	1.15	1.12	4.85	4.83	4.85	68
長期 (7-)	1,414	88.59	88.89	11.08	0.96	2.25	2.02	10.29	10.18	10.27	100
長期 (7-11)	864	90.74	91.04	8.67	0.94	2.23	2.00	8.26	8.18	8.26	116
超長期 (11-)	550	85.22	85.51	14.88	0.98	2.28	2.06	13.68	13.54	13.64	72

出所:NFRC

- 格付は、R&I の格付をもとに NFRC で分類

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

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
AAA~AA 格	36,379	95.63	95.80	9.37	0.71	0.98	0.94	7.77	7.72	7.73	27
短期 (1-3)	9,561	99.85	99.92	2.11	0.29	0.35	0.35	2.11	2.10	2.11	23
中期 (3-7)	12,127	99.77	99.92	4.76	0.66	0.69	0.69	4.68	4.66	4.68	28
長期 (7-)	14,691	89.47	89.73	17.89	1.03	1.71	1.61	14.73	14.60	14.62	30
長期 (7-11)	4,971	97.91	98.13	8.74	0.91	1.18	1.17	8.39	8.34	8.38	33
超長期 (11-)	9,720	85.15	85.43	22.57	1.09	2.02	1.87	18.46	18.28	18.28	29
AAA~A 格	62,456	95.82	95.98	7.98	0.68	1.03	1.00	6.84	6.79	6.81	40
短期 (1-3)	17,869	99.79	99.89	2.12	0.38	0.46	0.46	2.11	2.10	2.11	34
中期 (3-7)	22,374	99.02	99.17	4.81	0.64	0.83	0.83	4.72	4.70	4.72	41
長期 (7-)	22,213	89.39	89.63	15.88	0.96	1.77	1.67	13.43	13.31	13.35	44
長期 (7-11)	9,199	95.99	96.18	8.67	0.83	1.36	1.33	8.34	8.28	8.34	50
超長期 (11-)	13,014	84.73	85.00	20.97	1.05	2.10	1.93	17.51	17.33	17.36	40
AAA~BBB 格	63,237	95.81	95.97	7.94	0.68	1.04	1.00	6.81	6.76	6.78	41
短期 (1-3)	18,187	99.78	99.88	2.12	0.38	0.47	0.47	2.11	2.10	2.11	35
中期 (3-7)	22,684	98.98	99.13	4.81	0.65	0.85	0.84	4.72	4.70	4.72	42
長期 (7-)	22,366	89.36	89.59	15.85	0.96	1.78	1.67	13.42	13.29	13.33	45
長期 (7-11)	9,267	95.93	96.12	8.66	0.83	1.37	1.34	8.34	8.28	8.33	50
超長期 (11-)	13,099	84.71	84.97	20.93	1.05	2.10	1.94	17.48	17.31	17.34	40
AAA~BB 格	63,237	95.81	95.97	7.94	0.68	1.04	1.00	6.81	6.76	6.78	41
短期 (1-3)	18,187	99.78	99.88	2.12	0.38	0.47	0.47	2.11	2.10	2.11	35
中期 (3-7)	22,684	98.98	99.13	4.81	0.65	0.85	0.84	4.72	4.70	4.72	42
長期 (7-)	22,366	89.36	89.59	15.85	0.96	1.78	1.67	13.42	13.29	13.33	45
長期 (7-11)	9,267	95.93	96.12	8.66	0.83	1.37	1.34	8.34	8.28	8.33	50
超長期 (11-)	13,099	84.71	84.97	20.93	1.05	2.10	1.94	17.48	17.31	17.34	40
AAA 格	755	97.80	97.87	4.40	0.23	0.63	0.62	4.27	4.26	4.27	26
短期 (1-3)	320	99.38	99.39	2.20	0.11	0.37	0.37	2.20	2.20	2.20	24
中期 (3-7)	275	98.53	98.60	4.13	0.26	0.62	0.61	4.11	4.09	4.11	26
長期 (7-)	160	93.41	93.57	9.26	0.44	1.21	1.17	8.99	8.93	8.98	29
長期 (7-11)	130	94.79	94.94	8.41	0.43	1.13	1.10	8.24	8.19	8.23	28
超長期 (11-)	30	87.44	87.62	12.92	0.45	1.63	1.52	12.51	12.41	12.50	30
AA 格	35,624	95.58	95.76	9.47	0.72	0.99	0.95	7.85	7.79	7.81	27
短期 (1-3)	9,241	99.86	99.93	2.11	0.30	0.35	0.35	2.10	2.10	2.10	23
中期 (3-7)	11,852	99.80	99.95	4.78	0.67	0.70	0.69	4.69	4.67	4.69	28
長期 (7-)	14,531	89.43	89.68	17.99	1.04	1.72	1.62	14.80	14.66	14.68	30
長期 (7-11)	4,841	97.99	98.22	8.75	0.93	1.19	1.18	8.39	8.34	8.38	33
超長期 (11-)	9,690	85.15	85.42	22.60	1.09	2.02	1.87	18.47	18.30	18.30	29
A 格	26,076	96.08	96.23	6.03	0.64	1.10	1.07	5.54	5.50	5.53	57
短期 (1-3)	8,308	99.73	99.86	2.12	0.49	0.59	0.58	2.11	2.10	2.11	46
中期 (3-7)	10,247	98.13	98.28	4.87	0.63	1.00	1.00	4.78	4.75	4.78	57
長期 (7-)	7,522	89.25	89.44	11.93	0.82	1.89	1.78	10.89	10.79	10.86	71
長期 (7-11)	4,228	93.72	93.88	8.58	0.74	1.58	1.53	8.28	8.22	8.28	70
超長期 (11-)	3,294	83.50	83.72	16.24	0.93	2.32	2.13	14.64	14.49	14.58	72
BBB 格	781	95.04	95.23	4.94	0.66	1.63	1.57	4.56	4.52	4.56	117
短期 (1-3)	319	99.00	99.16	2.10	0.54	1.22	1.22	2.09	2.08	2.09	110
中期 (3-7)	310	96.22	96.41	4.55	0.72	1.66	1.62	4.47	4.44	4.47	122
長期 (7-)	153	84.41	84.67	11.62	0.79	2.55	2.31	10.80	10.67	10.78	124
長期 (7-11)	68	88.19	88.37	7.94	0.68	2.45	2.22	7.70	7.61	7.69	146
超長期 (11-)	85	81.39	81.72	14.56	0.88	2.64	2.39	13.48	13.32	13.44	106
BB 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
B 格以下	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
格付なし	6,080	95.84	96.01	5.42	0.63	1.28	1.21	5.07	5.04	5.07	76
短期 (1-3)	2,009	99.49	99.61	2.06	0.56	0.84	0.83	2.05	2.04	2.05	72
中期 (3-7)	2,650	96.94	97.07	4.94	0.50	1.15	1.11	4.86	4.83	4.86	68
長期 (7-)	1,421	88.64	88.94	11.09	0.96	2.25	2.02	10.29	10.19	10.27	100
長期 (7-11)	871	90.80	91.10	8.69	0.95	2.23	2.00	8.28	8.20	8.28	116
超長期 (11-)	550	85.22	85.51	14.88	0.98	2.28	2.06	13.68	13.54	13.64	72

出所:NFRC

- 格付は、R&Iの格付をもとに NFRC で分類

事業債 JCR 格付別・ポートフォリオ指標 (2023年10月末)

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
AAA~AA 格	26,889	96.20	96.32	6.30	0.48	0.89	0.86	5.61	5.57	5.60	37
短期 (1-3)	8,839	99.72	99.80	2.09	0.31	0.42	0.42	2.08	2.08	2.08	30
中期 (3-7)	10,631	98.38	98.49	4.72	0.45	0.78	0.77	4.65	4.63	4.65	36
長期 (7-)	7,419	88.87	89.05	13.59	0.72	1.68	1.58	11.84	11.74	11.79	48
長期 (7-11)	4,120	94.62	94.79	8.42	0.60	1.32	1.29	8.19	8.14	8.19	47
超長期 (11-)	3,299	81.69	81.89	20.05	0.87	2.21	2.00	17.12	16.94	17.00	48
AAA~A 格	39,274	95.98	96.11	6.18	0.55	1.03	0.99	5.56	5.53	5.55	50
短期 (1-3)	12,603	99.65	99.74	2.09	0.37	0.53	0.53	2.08	2.08	2.08	41
中期 (3-7)	15,537	98.15	98.28	4.76	0.53	0.91	0.90	4.68	4.66	4.68	48
長期 (7-)	11,135	88.78	88.98	12.79	0.79	1.85	1.73	11.34	11.24	11.30	65
長期 (7-11)	6,286	93.55	93.73	8.52	0.70	1.56	1.49	8.24	8.18	8.23	67
超長期 (11-)	4,849	82.61	82.83	18.32	0.92	2.29	2.08	15.90	15.73	15.81	62
AAA~BBB 格	39,696	95.99	96.13	6.16	0.56	1.04	1.00	5.55	5.51	5.53	51
短期 (1-3)	12,800	99.65	99.74	2.09	0.37	0.53	0.53	2.08	2.08	2.08	42
中期 (3-7)	15,715	98.14	98.27	4.75	0.54	0.92	0.91	4.68	4.65	4.68	49
長期 (7-)	11,182	88.78	88.98	12.78	0.79	1.86	1.73	11.34	11.23	11.30	65
長期 (7-11)	6,313	93.55	93.73	8.51	0.70	1.56	1.49	8.24	8.17	8.23	67
超長期 (11-)	4,869	82.61	82.83	18.31	0.92	2.29	2.08	15.89	15.73	15.80	62
AAA~BB 格	39,696	95.99	96.13	6.16	0.56	1.04	1.00	5.55	5.51	5.53	51
短期 (1-3)	12,800	99.65	99.74	2.09	0.37	0.53	0.53	2.08	2.08	2.08	42
中期 (3-7)	15,715	98.14	98.27	4.75	0.54	0.92	0.91	4.68	4.65	4.68	49
長期 (7-)	11,182	88.78	88.98	12.78	0.79	1.86	1.73	11.34	11.23	11.30	65
長期 (7-11)	6,313	93.55	93.73	8.51	0.70	1.56	1.49	8.24	8.17	8.23	67
超長期 (11-)	4,869	82.61	82.83	18.31	0.92	2.29	2.08	15.89	15.73	15.80	62
AAA 格	9,894	96.91	96.99	6.05	0.34	0.69	0.66	5.25	5.22	5.23	23
短期 (1-3)	3,642	99.57	99.60	2.11	0.13	0.32	0.32	2.11	2.10	2.11	20
中期 (3-7)	4,205	98.45	98.53	4.69	0.34	0.65	0.64	4.63	4.62	4.63	23
長期 (7-)	2,047	89.01	89.18	15.84	0.71	1.51	1.41	12.87	12.77	12.78	29
長期 (7-11)	1,240	95.35	95.50	8.43	0.51	1.13	1.10	8.23	8.18	8.22	28
超長期 (11-)	807	79.26	79.49	27.21	1.02	2.22	1.97	21.45	21.23	21.20	30
AA 格	16,996	95.79	95.93	6.45	0.56	1.00	0.97	5.82	5.79	5.81	45
短期 (1-3)	5,197	99.84	99.95	2.07	0.44	0.49	0.49	2.06	2.06	2.06	37
中期 (3-7)	6,426	98.34	98.46	4.74	0.53	0.86	0.86	4.66	4.64	4.66	44
長期 (7-)	5,372	88.81	89.00	12.74	0.72	1.75	1.64	11.45	11.35	11.41	55
長期 (7-11)	2,880	94.31	94.48	8.42	0.64	1.41	1.37	8.18	8.12	8.18	55
超長期 (11-)	2,492	82.47	82.67	17.73	0.82	2.21	2.01	15.77	15.61	15.69	54
A 格	12,385	95.49	95.66	5.91	0.71	1.35	1.30	5.46	5.42	5.46	80
短期 (1-3)	3,764	99.47	99.59	2.10	0.52	0.80	0.80	2.09	2.08	2.09	68
中期 (3-7)	4,906	97.66	97.82	4.84	0.69	1.21	1.18	4.74	4.71	4.74	76
長期 (7-)	3,716	88.62	88.84	11.18	0.94	2.20	2.03	10.34	10.24	10.32	100
長期 (7-11)	2,166	91.51	91.71	8.70	0.88	2.03	1.90	8.32	8.24	8.32	106
超長期 (11-)	1,550	84.57	84.82	14.64	1.02	2.45	2.24	13.40	13.25	13.36	91
BBB 格	422	97.32	97.52	4.10	0.83	1.34	1.32	3.86	3.82	3.85	100
短期 (1-3)	197	99.47	99.62	1.98	0.51	0.78	0.78	1.97	1.96	1.97	67
中期 (3-7)	178	97.13	97.36	4.56	1.17	1.83	1.80	4.42	4.38	4.42	141
長期 (7-)	47	89.05	89.26	11.19	0.85	1.98	1.86	10.32	10.22	10.30	84
長期 (7-11)	27	93.91	94.08	8.01	0.78	1.64	1.59	7.75	7.69	7.75	82
超長期 (11-)	20	82.51	82.75	15.49	0.93	2.50	2.28	14.27	14.11	14.23	87
BB 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
B 格以下	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
格付なし	28,478	95.48	95.69	9.88	0.83	1.09	1.05	8.17	8.11	8.13	34
短期 (1-3)	6,874	100.00	100.11	2.04	0.46	0.44	0.44	2.03	2.03	2.03	33
中期 (3-7)	9,252	99.89	100.06	4.78	0.77	0.78	0.78	4.68	4.67	4.68	36
長期 (7-)	12,353	89.67	89.95	18.05	1.09	1.75	1.65	14.88	14.75	14.77	32
長期 (7-11)	3,691	98.72	98.98	8.72	1.05	1.22	1.22	8.32	8.27	8.31	38
超長期 (11-)	8,662	85.82	86.10	22.02	1.11	2.01	1.86	18.10	17.93	17.94	30

出所:NFRC

- 格付は、JCR の格付をもとに NFRC で分類

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

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
AAA~AA 格	27,506	96.24	96.37	6.33	0.49	0.89	0.86	5.64	5.60	5.63	37
短期 (1-3)	9,147	99.74	99.82	2.14	0.33	0.43	0.43	2.13	2.12	2.13	31
中期 (3-7)	10,838	98.36	98.47	4.78	0.46	0.79	0.78	4.71	4.69	4.71	36
長期 (7-)	7,521	88.94	89.13	13.67	0.74	1.69	1.59	11.91	11.81	11.86	48
長期 (7-11)	4,152	94.63	94.79	8.51	0.61	1.33	1.30	8.27	8.22	8.27	47
超長期 (11-)	3,369	81.94	82.14	20.03	0.89	2.21	2.00	17.09	16.91	16.97	49
AAA~A 格	39,903	96.00	96.14	6.21	0.56	1.04	1.00	5.59	5.56	5.58	50
短期 (1-3)	12,885	99.64	99.73	2.13	0.37	0.54	0.53	2.12	2.11	2.12	41
中期 (3-7)	15,787	98.14	98.27	4.81	0.53	0.92	0.91	4.73	4.71	4.73	48
長期 (7-)	11,231	88.84	89.03	12.85	0.80	1.86	1.73	11.40	11.30	11.36	65
長期 (7-11)	6,312	93.57	93.74	8.58	0.71	1.57	1.50	8.30	8.24	8.29	67
超長期 (11-)	4,919	82.77	82.99	18.33	0.93	2.28	2.08	15.90	15.73	15.81	62
AAA~BBB 格	40,319	96.02	96.15	6.19	0.56	1.04	1.00	5.58	5.54	5.57	51
短期 (1-3)	13,077	99.63	99.73	2.13	0.38	0.54	0.54	2.12	2.11	2.12	42
中期 (3-7)	15,965	98.13	98.26	4.81	0.54	0.93	0.92	4.73	4.70	4.73	49
長期 (7-)	11,278	88.84	89.03	12.85	0.81	1.86	1.74	11.40	11.29	11.36	65
長期 (7-11)	6,339	93.57	93.75	8.58	0.71	1.57	1.50	8.30	8.23	8.29	67
超長期 (11-)	4,939	82.76	82.99	18.32	0.93	2.29	2.08	15.89	15.73	15.80	62
AAA~BB 格	40,319	96.02	96.15	6.19	0.56	1.04	1.00	5.58	5.54	5.57	51
短期 (1-3)	13,077	99.63	99.73	2.13	0.38	0.54	0.54	2.12	2.11	2.12	42
中期 (3-7)	15,965	98.13	98.26	4.81	0.54	0.93	0.92	4.73	4.70	4.73	49
長期 (7-)	11,278	88.84	89.03	12.85	0.81	1.86	1.74	11.40	11.29	11.36	65
長期 (7-11)	6,339	93.57	93.75	8.58	0.71	1.57	1.50	8.30	8.23	8.29	67
超長期 (11-)	4,939	82.76	82.99	18.32	0.93	2.29	2.08	15.89	15.73	15.80	62
AAA 格	9,939	96.91	97.00	6.06	0.34	0.69	0.67	5.27	5.24	5.25	23
短期 (1-3)	3,687	99.54	99.57	2.16	0.13	0.32	0.32	2.16	2.15	2.16	20
中期 (3-7)	4,255	98.41	98.50	4.76	0.34	0.66	0.65	4.70	4.69	4.70	23
長期 (7-)	1,997	88.85	89.03	16.05	0.73	1.52	1.42	13.03	12.92	12.94	29
長期 (7-11)	1,190	95.36	95.51	8.48	0.53	1.13	1.11	8.28	8.23	8.27	29
超長期 (11-)	807	79.26	79.49	27.21	1.02	2.22	1.97	21.45	21.23	21.20	30
AA 格	17,568	95.87	96.01	6.48	0.58	1.01	0.98	5.85	5.81	5.84	45
短期 (1-3)	5,460	99.87	99.99	2.12	0.47	0.50	0.50	2.11	2.10	2.11	38
中期 (3-7)	6,583	98.33	98.46	4.79	0.54	0.87	0.87	4.71	4.69	4.71	45
長期 (7-)	5,524	88.98	89.16	12.81	0.74	1.75	1.65	11.51	11.41	11.47	54
長期 (7-11)	2,962	94.34	94.50	8.52	0.65	1.41	1.37	8.27	8.22	8.27	54
超長期 (11-)	2,562	82.78	82.98	17.76	0.85	2.21	2.01	15.77	15.61	15.69	54
A 格	12,397	95.47	95.64	5.94	0.70	1.35	1.30	5.49	5.45	5.49	79
短期 (1-3)	3,738	99.39	99.50	2.12	0.48	0.79	0.79	2.10	2.10	2.10	67
中期 (3-7)	4,949	97.65	97.81	4.88	0.69	1.21	1.18	4.78	4.75	4.78	75
長期 (7-)	3,710	88.62	88.85	11.20	0.94	2.20	2.04	10.36	10.25	10.34	100
長期 (7-11)	2,160	91.53	91.73	8.73	0.89	2.04	1.90	8.35	8.27	8.34	106
超長期 (11-)	1,550	84.57	84.82	14.64	1.02	2.45	2.24	13.40	13.25	13.36	91
BBB 格	417	97.29	97.49	4.13	0.83	1.35	1.33	3.89	3.86	3.89	100
短期 (1-3)	192	99.46	99.62	2.01	0.52	0.78	0.78	2.00	1.99	2.00	67
中期 (3-7)	178	97.13	97.36	4.56	1.17	1.83	1.80	4.42	4.38	4.42	141
長期 (7-)	47	89.05	89.26	11.19	0.85	1.98	1.86	10.32	10.22	10.30	84
長期 (7-11)	27	93.91	94.08	8.01	0.78	1.64	1.59	7.75	7.69	7.75	82
超長期 (11-)	20	82.51	82.75	15.49	0.93	2.50	2.28	14.27	14.11	14.23	87
BB 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
B 格以下	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
格付なし	28,997	95.52	95.72	9.85	0.84	1.09	1.05	8.17	8.10	8.12	34
短期 (1-3)	7,119	99.96	100.07	2.08	0.45	0.45	0.45	2.07	2.07	2.07	33
中期 (3-7)	9,369	99.86	100.04	4.85	0.78	0.79	0.79	4.75	4.73	4.75	36
長期 (7-)	12,510	89.75	90.02	18.01	1.09	1.75	1.65	14.86	14.73	14.75	33
長期 (7-11)	3,799	98.69	98.94	8.80	1.07	1.24	1.23	8.39	8.34	8.38	38
超長期 (11-)	8,710	85.85	86.13	22.03	1.11	2.01	1.86	18.11	17.93	17.94	30

出所:NFRC

- 格付は、JCR の格付をもとに NFRC で分類

事業債 Moody's 格付別・ポートフォリオ指標 (2023年10月末)

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
AAA~AA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AAA~A 格	22,493	96.35	96.53	8.83	0.73	0.97	0.94	7.48	7.42	7.44	29
短期 (1-3)	6,233	99.95	100.04	2.08	0.35	0.36	0.36	2.07	2.07	2.07	24
中期 (3-7)	7,435	99.74	99.88	4.59	0.63	0.68	0.68	4.51	4.49	4.51	28
長期 (7-)	8,826	90.94	91.24	17.17	1.07	1.71	1.62	14.40	14.27	14.30	33
長期 (7-11)	3,011	97.27	97.49	8.63	0.84	1.22	1.20	8.30	8.25	8.30	37
超長期 (11-)	5,814	87.67	88.01	21.60	1.20	1.99	1.87	17.89	17.72	17.74	30
AAA~BBB 格	24,941	96.33	96.52	8.60	0.73	0.98	0.95	7.31	7.26	7.27	31
短期 (1-3)	7,002	99.93	100.01	2.08	0.36	0.37	0.37	2.07	2.07	2.07	25
中期 (3-7)	8,511	99.59	99.74	4.67	0.66	0.74	0.74	4.58	4.56	4.58	33
長期 (7-)	9,428	90.71	91.01	16.98	1.06	1.73	1.64	14.28	14.15	14.18	35
長期 (7-11)	3,288	97.05	97.27	8.62	0.83	1.24	1.22	8.30	8.25	8.30	38
超長期 (11-)	6,139	87.32	87.66	21.46	1.19	2.02	1.89	17.83	17.66	17.68	32
AAA~BB 格	24,941	96.33	96.52	8.60	0.73	0.98	0.95	7.31	7.26	7.27	31
短期 (1-3)	7,002	99.93	100.01	2.08	0.36	0.37	0.37	2.07	2.07	2.07	25
中期 (3-7)	8,511	99.59	99.74	4.67	0.66	0.74	0.74	4.58	4.56	4.58	33
長期 (7-)	9,428	90.71	91.01	16.98	1.06	1.73	1.64	14.28	14.15	14.18	35
長期 (7-11)	3,288	97.05	97.27	8.62	0.83	1.24	1.22	8.30	8.25	8.30	38
超長期 (11-)	6,139	87.32	87.66	21.46	1.19	2.02	1.89	17.83	17.66	17.68	32
AAA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
A 格	22,493	96.35	96.53	8.83	0.73	0.97	0.94	7.48	7.42	7.44	29
短期 (1-3)	6,233	99.95	100.04	2.08	0.35	0.36	0.36	2.07	2.07	2.07	24
中期 (3-7)	7,435	99.74	99.88	4.59	0.63	0.68	0.68	4.51	4.49	4.51	28
長期 (7-)	8,826	90.94	91.24	17.17	1.07	1.71	1.62	14.40	14.27	14.30	33
長期 (7-11)	3,011	97.27	97.49	8.63	0.84	1.22	1.20	8.30	8.25	8.30	37
超長期 (11-)	5,814	87.67	88.01	21.60	1.20	1.99	1.87	17.89	17.72	17.74	30
BBB 格	2,448	96.19	96.38	6.45	0.72	1.10	1.07	5.76	5.72	5.75	55
短期 (1-3)	770	99.78	99.85	2.10	0.38	0.44	0.44	2.09	2.08	2.09	32
中期 (3-7)	1,076	98.59	98.81	5.23	0.87	1.14	1.14	5.09	5.06	5.09	67
長期 (7-)	602	87.33	87.58	14.22	0.89	1.97	1.83	12.45	12.33	12.40	65
長期 (7-11)	277	94.65	94.87	8.56	0.74	1.44	1.40	8.26	8.21	8.26	58
超長期 (11-)	325	81.08	81.38	19.05	1.02	2.50	2.26	16.62	16.43	16.51	72
BB 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
B 格以下	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
格付なし	43,234	95.46	95.61	7.20	0.64	1.10	1.06	6.25	6.21	6.23	51
短期 (1-3)	12,671	99.68	99.79	2.07	0.43	0.58	0.58	2.06	2.05	2.06	46
中期 (3-7)	16,456	98.37	98.52	4.82	0.60	0.94	0.93	4.73	4.71	4.73	50
長期 (7-)	14,107	88.27	88.47	14.58	0.87	1.85	1.72	12.48	12.36	12.41	57
長期 (7-11)	6,716	94.68	94.88	8.58	0.83	1.53	1.47	8.25	8.19	8.25	64
超長期 (11-)	7,391	82.45	82.65	20.04	0.92	2.19	1.99	16.88	16.71	16.76	49

出所:NFRC

- 格付は、Moody's の格付をもとに NFRC で分類

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

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
AAA~AA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AAA~A 格	22,773	96.34	96.53	8.89	0.73	0.98	0.95	7.53	7.48	7.50	29
短期 (1-3)	6,331	99.94	100.03	2.12	0.36	0.37	0.37	2.11	2.11	2.11	24
中期 (3-7)	7,474	99.69	99.83	4.65	0.63	0.69	0.69	4.57	4.55	4.57	28
長期 (7-)	8,968	91.00	91.30	17.20	1.09	1.72	1.63	14.43	14.30	14.33	33
長期 (7-11)	3,052	97.29	97.52	8.71	0.86	1.23	1.21	8.38	8.33	8.37	37
超長期 (11-)	5,916	87.76	88.10	21.58	1.20	2.00	1.87	17.88	17.71	17.73	31
AAA~BBB 格	25,490	96.35	96.53	8.63	0.73	0.99	0.96	7.35	7.30	7.32	32
短期 (1-3)	7,110	99.92	100.01	2.12	0.36	0.37	0.37	2.11	2.11	2.11	25
中期 (3-7)	8,715	99.54	99.69	4.73	0.66	0.75	0.75	4.65	4.63	4.65	33
長期 (7-)	9,665	90.84	91.13	16.95	1.08	1.73	1.64	14.26	14.13	14.16	35
長期 (7-11)	3,424	97.08	97.30	8.73	0.86	1.26	1.24	8.39	8.34	8.39	40
超長期 (11-)	6,241	87.41	87.75	21.45	1.19	2.02	1.89	17.82	17.65	17.67	33
AAA~BB 格	25,490	96.35	96.53	8.63	0.73	0.99	0.96	7.35	7.30	7.32	32
短期 (1-3)	7,110	99.92	100.01	2.12	0.36	0.37	0.37	2.11	2.11	2.11	25
中期 (3-7)	8,715	99.54	99.69	4.73	0.66	0.75	0.75	4.65	4.63	4.65	33
長期 (7-)	9,665	90.84	91.13	16.95	1.08	1.73	1.64	14.26	14.13	14.16	35
長期 (7-11)	3,424	97.08	97.30	8.73	0.86	1.26	1.24	8.39	8.34	8.39	40
超長期 (11-)	6,241	87.41	87.75	21.45	1.19	2.02	1.89	17.82	17.65	17.67	33
AAA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
A 格	22,773	96.34	96.53	8.89	0.73	0.98	0.95	7.53	7.48	7.50	29
短期 (1-3)	6,331	99.94	100.03	2.12	0.36	0.37	0.37	2.11	2.11	2.11	24
中期 (3-7)	7,474	99.69	99.83	4.65	0.63	0.69	0.69	4.57	4.55	4.57	28
長期 (7-)	8,968	91.00	91.30	17.20	1.09	1.72	1.63	14.43	14.30	14.33	33
長期 (7-11)	3,052	97.29	97.52	8.71	0.86	1.23	1.21	8.38	8.33	8.37	37
超長期 (11-)	5,916	87.76	88.10	21.58	1.20	2.00	1.87	17.88	17.71	17.73	31
BBB 格	2,718	96.40	96.58	6.49	0.74	1.11	1.08	5.84	5.80	5.83	55
短期 (1-3)	780	99.77	99.84	2.11	0.38	0.44	0.44	2.10	2.09	2.10	32
中期 (3-7)	1,241	98.61	98.82	5.24	0.86	1.13	1.12	5.11	5.08	5.11	66
長期 (7-)	697	88.69	88.94	13.63	0.95	1.92	1.80	11.98	11.86	11.93	65
長期 (7-11)	372	95.34	95.55	8.89	0.89	1.49	1.46	8.52	8.46	8.52	60
超長期 (11-)	325	81.08	81.38	19.05	1.02	2.50	2.26	16.62	16.43	16.51	72
BB 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
B 格以下	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
格付なし	43,826	95.50	95.65	7.18	0.64	1.10	1.06	6.25	6.20	6.23	51
短期 (1-3)	13,086	99.65	99.76	2.11	0.43	0.58	0.58	2.10	2.09	2.10	46
中期 (3-7)	16,619	98.37	98.51	4.87	0.61	0.94	0.93	4.78	4.76	4.78	50
長期 (7-)	14,122	88.28	88.47	14.62	0.88	1.85	1.73	12.51	12.39	12.44	57
長期 (7-11)	6,714	94.68	94.87	8.63	0.83	1.54	1.48	8.30	8.24	8.29	64
超長期 (11-)	7,408	82.48	82.68	20.04	0.92	2.19	1.99	16.88	16.71	16.76	49

出所:NFRC

- 格付は、Moody's の格付をもとに NFRC で分類

事業債 S&P 格付別・ポートフォリオ指標 (2023年10月末)

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
AAA~AA 格	800	85.15	85.43	18.54	0.95	1.75	1.59	14.50	14.37	14.40	37
短期 (1-3)	30	102.16	102.56	2.23	1.52	0.38	0.39	2.19	2.19	2.19	26
中期 (3-7)	90	98.67	98.92	5.23	0.69	0.78	0.78	5.12	5.10	5.12	31
長期 (7-)	680	82.61	82.89	21.02	0.96	1.98	1.78	16.66	16.49	16.53	39
長期 (7-11)	222	98.60	98.88	9.05	1.05	1.25	1.25	8.61	8.56	8.61	37
超長期 (11-)	458	74.85	75.14	26.82	0.92	2.44	2.12	21.79	21.56	21.58	40
AAA~A 格	15,871	94.75	94.91	9.43	0.70	1.03	0.98	7.82	7.77	7.79	29
短期 (1-3)	3,693	99.94	100.02	2.10	0.35	0.36	0.36	2.10	2.09	2.10	24
中期 (3-7)	5,252	99.46	99.62	4.98	0.67	0.74	0.73	4.89	4.87	4.88	29
長期 (7-)	6,926	88.40	88.61	16.70	0.92	1.68	1.56	13.77	13.65	13.69	33
長期 (7-11)	2,842	98.14	98.38	8.57	0.93	1.18	1.17	8.22	8.18	8.22	34
超長期 (11-)	4,084	81.63	81.82	22.35	0.90	2.10	1.89	18.42	18.24	18.26	32
AAA~BBB 格	16,574	94.93	95.09	9.19	0.71	1.02	0.97	7.64	7.59	7.61	30
短期 (1-3)	4,079	99.95	100.04	2.11	0.39	0.38	0.38	2.10	2.10	2.10	26
中期 (3-7)	5,484	99.44	99.60	4.97	0.67	0.74	0.74	4.87	4.85	4.87	30
長期 (7-)	7,011	88.48	88.69	16.61	0.92	1.68	1.56	13.71	13.59	13.62	34
長期 (7-11)	2,917	98.08	98.31	8.58	0.93	1.19	1.18	8.23	8.18	8.23	35
超長期 (11-)	4,094	81.64	81.83	22.33	0.90	2.10	1.89	18.41	18.22	18.25	33
AAA~BB 格	16,814	95.00	95.17	9.15	0.73	1.03	0.99	7.62	7.56	7.58	32
短期 (1-3)	4,079	99.95	100.04	2.11	0.39	0.38	0.38	2.10	2.10	2.10	26
中期 (3-7)	5,699	99.50	99.68	4.99	0.73	0.79	0.79	4.88	4.86	4.88	35
長期 (7-)	7,036	88.49	88.70	16.61	0.92	1.68	1.57	13.71	13.59	13.62	34
長期 (7-11)	2,917	98.08	98.31	8.58	0.93	1.19	1.18	8.23	8.18	8.23	35
超長期 (11-)	4,119	81.69	81.89	22.30	0.91	2.10	1.90	18.37	18.19	18.21	33
AAA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA 格	800	85.15	85.43	18.54	0.95	1.75	1.59	14.50	14.37	14.40	37
短期 (1-3)	30	102.16	102.56	2.23	1.52	0.38	0.39	2.19	2.19	2.19	26
中期 (3-7)	90	98.67	98.92	5.23	0.69	0.78	0.78	5.12	5.10	5.12	31
長期 (7-)	680	82.61	82.89	21.02	0.96	1.98	1.78	16.66	16.49	16.53	39
長期 (7-11)	222	98.60	98.88	9.05	1.05	1.25	1.25	8.61	8.56	8.61	37
超長期 (11-)	458	74.85	75.14	26.82	0.92	2.44	2.12	21.79	21.56	21.58	40
A 格	15,071	95.26	95.41	8.94	0.69	0.99	0.95	7.51	7.45	7.47	29
短期 (1-3)	3,663	99.92	100.00	2.10	0.34	0.36	0.36	2.09	2.09	2.09	24
中期 (3-7)	5,162	99.47	99.63	4.98	0.67	0.73	0.73	4.88	4.86	4.88	29
長期 (7-)	6,246	89.03	89.24	16.23	0.91	1.65	1.54	13.48	13.37	13.40	33
長期 (7-11)	2,620	98.10	98.33	8.53	0.92	1.17	1.16	8.19	8.14	8.19	34
超長期 (11-)	3,626	82.48	82.66	21.79	0.90	2.06	1.87	18.03	17.86	17.88	32
BBB 格	703	99.04	99.22	3.89	0.74	0.80	0.80	3.76	3.74	3.76	49
短期 (1-3)	387	100.06	100.25	2.21	0.74	0.59	0.59	2.19	2.18	2.19	46
中期 (3-7)	232	98.95	99.12	4.66	0.67	0.91	0.90	4.58	4.56	4.58	50
長期 (7-)	85	94.64	94.81	9.50	0.90	1.55	1.50	9.02	8.96	9.02	60
長期 (7-11)	75	95.57	95.71	8.89	0.91	1.49	1.46	8.52	8.45	8.51	60
超長期 (11-)	10	87.70	88.09	14.07	0.88	2.00	1.88	13.13	13.01	13.11	58
BB 格	240	99.98	100.59	6.57	2.26	2.12	2.12	5.89	5.82	5.87	155
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	215	101.10	101.67	5.41	2.25	2.01	2.01	5.09	5.04	5.09	153
長期 (7-)	25	90.33	91.34	16.57	2.37	3.27	3.12	13.48	13.27	13.37	168
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	25	90.33	91.34	16.57	2.37	3.27	3.12	13.48	13.27	13.37	168
B 格以下	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
格付なし	51,361	96.03	96.20	7.24	0.65	1.07	1.03	6.32	6.28	6.30	48
短期 (1-3)	15,594	99.72	99.82	2.06	0.41	0.54	0.53	2.05	2.05	2.05	42
中期 (3-7)	19,268	98.58	98.71	4.70	0.59	0.89	0.88	4.62	4.60	4.62	47
長期 (7-)	16,499	89.58	89.83	15.09	0.96	1.85	1.74	13.00	12.88	12.92	54
長期 (7-11)	7,088	94.38	94.58	8.59	0.78	1.54	1.48	8.28	8.22	8.28	65
超長期 (11-)	9,412	85.96	86.25	19.98	1.09	2.11	1.96	16.89	16.72	16.76	45

出所:NFRC

- 格付は、S&P の格付をもとに NFRC で分類

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

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
AAA~AA 格	800	85.15	85.43	18.54	0.95	1.75	1.59	14.50	14.37	14.40	37
短期 (1-3)	30	102.16	102.56	2.23	1.52	0.38	0.39	2.19	2.19	2.19	26
中期 (3-7)	90	98.67	98.92	5.23	0.69	0.78	0.78	5.12	5.10	5.12	31
長期 (7-)	680	82.61	82.89	21.02	0.96	1.98	1.78	16.66	16.49	16.53	39
長期 (7-11)	222	98.60	98.88	9.05	1.05	1.25	1.25	8.61	8.56	8.61	37
超長期 (11-)	458	74.85	75.14	26.82	0.92	2.44	2.12	21.79	21.56	21.58	40
AAA~A 格	16,183	94.81	94.97	9.39	0.71	1.03	0.98	7.81	7.75	7.77	30
短期 (1-3)	3,713	99.93	100.02	2.11	0.35	0.36	0.36	2.10	2.10	2.10	24
中期 (3-7)	5,452	99.42	99.57	5.01	0.67	0.75	0.74	4.91	4.89	4.91	30
長期 (7-)	7,018	88.52	88.73	16.64	0.93	1.68	1.57	13.73	13.61	13.65	34
長期 (7-11)	2,924	98.12	98.36	8.64	0.95	1.20	1.19	8.28	8.23	8.27	35
超長期 (11-)	4,094	81.65	81.85	22.34	0.91	2.10	1.89	18.42	18.23	18.26	32
AAA~BBB 格	16,946	95.00	95.16	9.14	0.71	1.02	0.97	7.62	7.56	7.58	31
短期 (1-3)	4,129	99.94	100.04	2.12	0.39	0.38	0.38	2.11	2.11	2.11	26
中期 (3-7)	5,714	99.40	99.55	5.00	0.67	0.75	0.75	4.90	4.88	4.90	31
長期 (7-)	7,103	88.59	88.80	16.55	0.93	1.68	1.57	13.67	13.55	13.59	34
長期 (7-11)	2,999	98.06	98.29	8.65	0.95	1.21	1.19	8.29	8.24	8.28	36
超長期 (11-)	4,104	81.67	81.86	22.32	0.91	2.10	1.89	18.40	18.22	18.24	32
AAA~BB 格	17,186	95.07	95.24	9.10	0.73	1.04	0.99	7.59	7.54	7.56	33
短期 (1-3)	4,129	99.94	100.04	2.12	0.39	0.38	0.38	2.11	2.11	2.11	26
中期 (3-7)	5,929	99.46	99.63	5.01	0.73	0.80	0.80	4.91	4.88	4.90	35
長期 (7-)	7,128	88.60	88.81	16.55	0.93	1.69	1.57	13.67	13.55	13.59	35
長期 (7-11)	2,999	98.06	98.29	8.65	0.95	1.21	1.19	8.29	8.24	8.28	36
超長期 (11-)	4,129	81.72	81.92	22.29	0.91	2.10	1.90	18.37	18.19	18.21	33
AAA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA 格	800	85.15	85.43	18.54	0.95	1.75	1.59	14.50	14.37	14.40	37
短期 (1-3)	30	102.16	102.56	2.23	1.52	0.38	0.39	2.19	2.19	2.19	26
中期 (3-7)	90	98.67	98.92	5.23	0.69	0.78	0.78	5.12	5.10	5.12	31
長期 (7-)	680	82.61	82.89	21.02	0.96	1.98	1.78	16.66	16.49	16.53	39
長期 (7-11)	222	98.60	98.88	9.05	1.05	1.25	1.25	8.61	8.56	8.61	37
超長期 (11-)	458	74.85	75.14	26.82	0.92	2.44	2.12	21.79	21.56	21.58	40
A 格	15,383	95.31	95.47	8.91	0.70	1.00	0.95	7.50	7.44	7.46	30
短期 (1-3)	3,683	99.92	100.00	2.11	0.34	0.36	0.36	2.10	2.10	2.10	24
中期 (3-7)	5,362	99.43	99.59	5.01	0.67	0.74	0.74	4.91	4.89	4.91	30
長期 (7-)	6,338	89.15	89.35	16.17	0.92	1.65	1.55	13.44	13.33	13.36	33
長期 (7-11)	2,702	98.08	98.32	8.61	0.95	1.19	1.18	8.25	8.20	8.25	35
超長期 (11-)	3,636	82.51	82.69	21.78	0.90	2.06	1.87	18.03	17.85	17.88	32
BBB 格	763	99.06	99.23	3.89	0.74	0.81	0.81	3.76	3.75	3.76	50
短期 (1-3)	417	100.03	100.21	2.25	0.73	0.60	0.60	2.23	2.22	2.23	47
中期 (3-7)	262	98.94	99.11	4.69	0.69	0.92	0.92	4.61	4.59	4.61	51
長期 (7-)	85	94.64	94.81	9.50	0.90	1.55	1.50	9.02	8.96	9.02	60
長期 (7-11)	75	95.57	95.71	8.89	0.91	1.49	1.46	8.52	8.45	8.51	60
超長期 (11-)	10	87.70	88.09	14.07	0.88	2.00	1.88	13.13	13.01	13.11	58
BB 格	240	99.98	100.59	6.57	2.26	2.12	2.12	5.89	5.82	5.87	155
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	215	101.10	101.67	5.41	2.25	2.01	2.01	5.09	5.04	5.09	153
長期 (7-)	25	90.33	91.34	16.57	2.37	3.27	3.12	13.48	13.27	13.37	168
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	25	90.33	91.34	16.57	2.37	3.27	3.12	13.48	13.27	13.37	168
B 格以下	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
格付なし	52,131	96.06	96.22	7.26	0.66	1.07	1.03	6.35	6.31	6.33	47
短期 (1-3)	16,067	99.70	99.80	2.11	0.41	0.54	0.54	2.10	2.09	2.10	42
中期 (3-7)	19,405	98.56	98.70	4.76	0.60	0.90	0.89	4.68	4.66	4.68	47
長期 (7-)	16,660	89.63	89.87	15.14	0.97	1.85	1.74	13.04	12.92	12.97	54
長期 (7-11)	7,139	94.41	94.60	8.67	0.79	1.54	1.48	8.35	8.29	8.35	64
超長期 (11-)	9,520	86.04	86.33	19.99	1.10	2.11	1.96	16.90	16.73	16.77	45

出所:NFRC

- 格付は、S&P の格付をもとに NFRC で分類

円建外債 最高格付別・ポートフォリオ指標 (2023年10月末)

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
AAA~AA格	888	98.34	98.52	3.55	0.74	1.15	1.14	3.45	3.42	3.45	87
短期(1-3)	413	99.26	99.40	2.24	0.61	0.92	0.91	2.22	2.21	2.22	78
中期(3-7)	429	98.04	98.26	4.18	0.83	1.30	1.28	4.10	4.07	4.10	93
長期(7-)	47	92.87	93.15	9.24	1.10	2.04	1.97	8.66	8.58	8.65	109
長期(7-11)	42	93.15	93.41	8.68	1.01	1.95	1.88	8.28	8.21	8.28	105
超長期(11-)	4	89.96	90.53	14.92	1.99	2.97	2.83	12.61	12.43	12.53	151
AAA~A格	2,756	98.12	98.43	3.90	1.08	1.47	1.45	3.68	3.65	3.68	115
短期(1-3)	1,159	99.59	99.88	2.03	1.04	1.20	1.20	2.00	1.99	2.00	109
中期(3-7)	1,362	97.78	98.06	4.19	0.97	1.49	1.47	4.09	4.06	4.09	112
長期(7-)	236	92.93	93.48	11.37	1.87	2.73	2.63	9.97	9.83	9.93	159
長期(7-11)	121	92.75	93.06	8.87	1.28	2.28	2.20	8.34	8.25	8.33	135
超長期(11-)	114	93.11	93.93	14.03	2.50	3.21	3.09	11.68	11.50	11.62	184
AAA~BBB格	3,228	98.16	98.48	3.85	1.08	1.45	1.43	3.63	3.60	3.63	113
短期(1-3)	1,473	99.62	99.93	1.99	1.04	1.18	1.18	1.96	1.95	1.96	108
中期(3-7)	1,462	97.82	98.12	4.25	0.99	1.49	1.47	4.15	4.12	4.15	111
長期(7-)	293	92.44	92.99	11.26	1.76	2.66	2.56	9.93	9.80	9.90	153
長期(7-11)	156	92.98	93.33	8.78	1.25	2.23	2.15	8.26	8.18	8.26	131
超長期(11-)	137	91.83	92.61	14.07	2.33	3.16	3.03	11.83	11.66	11.77	178
AAA~BB格	3,228	98.16	98.48	3.85	1.08	1.45	1.43	3.63	3.60	3.63	113
短期(1-3)	1,473	99.62	99.93	1.99	1.04	1.18	1.18	1.96	1.95	1.96	108
中期(3-7)	1,462	97.82	98.12	4.25	0.99	1.49	1.47	4.15	4.12	4.15	111
長期(7-)	293	92.44	92.99	11.26	1.76	2.66	2.56	9.93	9.80	9.90	153
長期(7-11)	156	92.98	93.33	8.78	1.25	2.23	2.15	8.26	8.18	8.26	131
超長期(11-)	137	91.83	92.61	14.07	2.33	3.16	3.03	11.83	11.66	11.77	178
AAA格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA格	888	98.34	98.52	3.55	0.74	1.15	1.14	3.45	3.42	3.45	87
短期(1-3)	413	99.26	99.40	2.24	0.61	0.92	0.91	2.22	2.21	2.22	78
中期(3-7)	429	98.04	98.26	4.18	0.83	1.30	1.28	4.10	4.07	4.10	93
長期(7-)	47	92.87	93.15	9.24	1.10	2.04	1.97	8.66	8.58	8.65	109
長期(7-11)	42	93.15	93.41	8.68	1.01	1.95	1.88	8.28	8.21	8.28	105
超長期(11-)	4	89.96	90.53	14.92	1.99	2.97	2.83	12.61	12.43	12.53	151
A格	1,868	98.02	98.39	4.06	1.24	1.62	1.60	3.79	3.75	3.79	128
短期(1-3)	746	99.77	100.14	1.91	1.28	1.36	1.36	1.88	1.87	1.88	127
中期(3-7)	933	97.66	97.97	4.19	1.03	1.58	1.56	4.09	4.06	4.09	121
長期(7-)	189	92.94	93.57	11.90	2.06	2.90	2.80	10.29	10.14	10.25	171
長期(7-11)	79	92.54	92.88	8.98	1.43	2.46	2.37	8.37	8.27	8.36	151
超長期(11-)	110	93.23	94.06	14.00	2.52	3.22	3.10	11.65	11.47	11.58	185
BBB格	472	98.35	98.77	3.60	1.09	1.33	1.32	3.35	3.33	3.35	105
短期(1-3)	315	99.74	100.13	1.83	1.03	1.11	1.11	1.80	1.79	1.80	103
中期(3-7)	101	98.46	98.93	5.11	1.19	1.50	1.49	4.93	4.89	4.93	103
長期(7-)	57	90.43	90.97	10.77	1.28	2.37	2.26	9.76	9.65	9.74	126
長期(7-11)	34	93.80	94.30	8.45	1.16	2.04	1.98	8.00	7.92	7.99	117
超長期(11-)	23	85.35	85.95	14.27	1.45	2.92	2.71	12.67	12.50	12.62	142
BB格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
B格以下	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
格付なし	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

出所:NFRC

- 格付は、格付会社4社の最高格付をもとにNFRCで分類

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

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
AAA~AA格	1,081	98.46	98.64	3.81	0.77	1.15	1.14	3.71	3.68	3.71	83
短期(1-3)	439	99.30	99.43	2.31	0.60	0.89	0.88	2.29	2.28	2.29	74
中期(3-7)	584	98.28	98.48	4.40	0.87	1.27	1.26	4.31	4.28	4.31	88
長期(7-)	58	93.85	94.12	9.36	1.15	1.95	1.89	8.78	8.70	8.77	100
長期(7-11)	54	94.16	94.40	8.93	1.08	1.87	1.82	8.49	8.41	8.48	96
超長期(11-)	4	89.96	90.53	14.92	1.99	2.97	2.83	12.61	12.43	12.53	151
AAA~A格	2,949	98.18	98.48	3.97	1.07	1.44	1.43	3.76	3.73	3.76	111
短期(1-3)	1,245	99.80	100.13	2.11	1.10	1.19	1.19	2.08	2.07	2.08	107
中期(3-7)	1,457	97.66	97.88	4.32	0.90	1.46	1.45	4.23	4.20	4.23	108
長期(7-)	247	93.15	93.70	11.31	1.85	2.68	2.58	9.93	9.80	9.90	154
長期(7-11)	133	93.19	93.49	8.96	1.29	2.22	2.15	8.42	8.33	8.41	129
超長期(11-)	114	93.11	93.93	14.03	2.50	3.21	3.09	11.68	11.50	11.62	184
AAA~BBB格	3,421	98.21	98.52	3.92	1.07	1.43	1.41	3.70	3.67	3.70	111
短期(1-3)	1,560	99.79	100.13	2.05	1.09	1.18	1.17	2.02	2.01	2.02	107
中期(3-7)	1,558	97.71	97.95	4.37	0.92	1.47	1.45	4.27	4.24	4.27	108
長期(7-)	304	92.64	93.18	11.21	1.74	2.62	2.52	9.90	9.77	9.87	149
長期(7-11)	167	93.32	93.66	8.85	1.26	2.18	2.11	8.33	8.24	8.32	126
超長期(11-)	137	91.83	92.61	14.07	2.33	3.16	3.03	11.83	11.66	11.77	178
AAA~BB格	3,421	98.21	98.52	3.92	1.07	1.43	1.41	3.70	3.67	3.70	111
短期(1-3)	1,560	99.79	100.13	2.05	1.09	1.18	1.17	2.02	2.01	2.02	107
中期(3-7)	1,558	97.71	97.95	4.37	0.92	1.47	1.45	4.27	4.24	4.27	108
長期(7-)	304	92.64	93.18	11.21	1.74	2.62	2.52	9.90	9.77	9.87	149
長期(7-11)	167	93.32	93.66	8.85	1.26	2.18	2.11	8.33	8.24	8.32	126
超長期(11-)	137	91.83	92.61	14.07	2.33	3.16	3.03	11.83	11.66	11.77	178
AAA格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA格	1,081	98.46	98.64	3.81	0.77	1.15	1.14	3.71	3.68	3.71	83
短期(1-3)	439	99.30	99.43	2.31	0.60	0.89	0.88	2.29	2.28	2.29	74
中期(3-7)	584	98.28	98.48	4.40	0.87	1.27	1.26	4.31	4.28	4.31	88
長期(7-)	58	93.85	94.12	9.36	1.15	1.95	1.89	8.78	8.70	8.77	100
長期(7-11)	54	94.16	94.40	8.93	1.08	1.87	1.82	8.49	8.41	8.48	96
超長期(11-)	4	89.96	90.53	14.92	1.99	2.97	2.83	12.61	12.43	12.53	151
A格	1,868	98.02	98.39	4.06	1.24	1.62	1.60	3.79	3.75	3.79	128
短期(1-3)	806	100.07	100.51	2.00	1.38	1.36	1.36	1.96	1.95	1.96	126
中期(3-7)	873	97.24	97.48	4.27	0.93	1.60	1.58	4.18	4.14	4.18	121
長期(7-)	189	92.94	93.57	11.90	2.06	2.90	2.80	10.29	10.14	10.25	171
長期(7-11)	79	92.54	92.88	8.98	1.43	2.46	2.37	8.37	8.27	8.36	151
超長期(11-)	110	93.23	94.06	14.00	2.52	3.22	3.10	11.65	11.47	11.58	185
BBB格	472	98.35	98.77	3.60	1.09	1.33	1.32	3.35	3.33	3.35	105
短期(1-3)	315	99.74	100.13	1.83	1.03	1.11	1.11	1.80	1.79	1.80	103
中期(3-7)	101	98.46	98.93	5.11	1.19	1.50	1.49	4.93	4.89	4.93	103
長期(7-)	57	90.43	90.97	10.77	1.28	2.37	2.26	9.76	9.65	9.74	126
長期(7-11)	34	93.80	94.30	8.45	1.16	2.04	1.98	8.00	7.92	7.99	117
超長期(11-)	23	85.35	85.95	14.27	1.45	2.92	2.71	12.67	12.50	12.62	142
BB格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
B格以下	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
格付なし	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

出所:NFRC

- 格付は、格付会社4社の最高格付をもとにNFRCで分類

円建外債 最低格付別・ポートフォリオ指標 (2023年10月末)

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
AAA～AA格	214	98.64	98.81	3.09	0.71	1.06	1.06	3.02	3.00	3.02	83
短期(1-3)	122	99.73	99.93	1.96	0.78	0.96	0.96	1.95	1.94	1.95	86
中期(3-7)	84	97.71	97.85	4.27	0.61	1.16	1.15	4.21	4.18	4.21	79
長期(7-)	7	91.02	91.16	8.28	0.60	1.85	1.77	8.06	7.99	8.06	97
長期(7-11)	7	91.02	91.16	8.28	0.60	1.85	1.77	8.06	7.99	8.06	97
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AAA～A格	1,537	98.79	99.12	3.59	1.00	1.27	1.27	3.44	3.41	3.43	99
短期(1-3)	796	99.58	99.84	2.11	0.94	1.10	1.09	2.09	2.07	2.09	98
中期(3-7)	630	98.28	98.62	4.15	0.95	1.32	1.31	4.05	4.03	4.05	97
長期(7-)	112	96.13	96.84	11.02	1.74	2.31	2.28	9.80	9.69	9.77	125
長期(7-11)	62	92.27	92.52	8.56	0.87	1.94	1.87	8.23	8.15	8.22	104
超長期(11-)	50	100.87	102.17	14.04	2.81	2.72	2.73	11.57	11.41	11.50	149
AAA～BBB格	3,228	98.16	98.48	3.85	1.08	1.45	1.43	3.63	3.60	3.63	113
短期(1-3)	1,473	99.62	99.93	1.99	1.04	1.18	1.18	1.96	1.95	1.96	108
中期(3-7)	1,462	97.82	98.12	4.25	0.99	1.49	1.47	4.15	4.12	4.15	111
長期(7-)	293	92.44	92.99	11.26	1.76	2.66	2.56	9.93	9.80	9.90	153
長期(7-11)	156	92.98	93.33	8.78	1.25	2.23	2.15	8.26	8.18	8.26	131
超長期(11-)	137	91.83	92.61	14.07	2.33	3.16	3.03	11.83	11.66	11.77	178
AAA～BB格	3,228	98.16	98.48	3.85	1.08	1.45	1.43	3.63	3.60	3.63	113
短期(1-3)	1,473	99.62	99.93	1.99	1.04	1.18	1.18	1.96	1.95	1.96	108
中期(3-7)	1,462	97.82	98.12	4.25	0.99	1.49	1.47	4.15	4.12	4.15	111
長期(7-)	293	92.44	92.99	11.26	1.76	2.66	2.56	9.93	9.80	9.90	153
長期(7-11)	156	92.98	93.33	8.78	1.25	2.23	2.15	8.26	8.18	8.26	131
超長期(11-)	137	91.83	92.61	14.07	2.33	3.16	3.03	11.83	11.66	11.77	178
AAA格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA格	214	98.64	98.81	3.09	0.71	1.06	1.06	3.02	3.00	3.02	83
短期(1-3)	122	99.73	99.93	1.96	0.78	0.96	0.96	1.95	1.94	1.95	86
中期(3-7)	84	97.71	97.85	4.27	0.61	1.16	1.15	4.21	4.18	4.21	79
長期(7-)	7	91.02	91.16	8.28	0.60	1.85	1.77	8.06	7.99	8.06	97
長期(7-11)	7	91.02	91.16	8.28	0.60	1.85	1.77	8.06	7.99	8.06	97
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
A格	1,323	98.82	99.17	3.67	1.05	1.31	1.30	3.50	3.48	3.50	102
短期(1-3)	673	99.55	99.82	2.14	0.97	1.12	1.12	2.11	2.10	2.11	100
中期(3-7)	546	98.36	98.73	4.13	1.00	1.35	1.34	4.03	4.00	4.03	99
長期(7-)	104	96.48	97.23	11.21	1.82	2.34	2.31	9.92	9.80	9.88	127
長期(7-11)	54	92.44	92.70	8.60	0.90	1.95	1.88	8.25	8.17	8.24	105
超長期(11-)	50	100.87	102.17	14.04	2.81	2.72	2.73	11.57	11.41	11.50	149
BBB格	1,691	97.58	97.90	4.09	1.15	1.61	1.58	3.81	3.78	3.81	126
短期(1-3)	678	99.68	100.05	1.84	1.15	1.29	1.28	1.82	1.80	1.82	120
中期(3-7)	832	97.48	97.74	4.33	1.01	1.62	1.60	4.22	4.19	4.22	123
長期(7-)	181	90.17	90.62	11.41	1.77	2.89	2.75	10.01	9.87	9.98	171
長期(7-11)	94	93.45	93.87	8.92	1.51	2.41	2.34	8.29	8.19	8.28	148
超長期(11-)	87	86.63	87.11	14.09	2.05	3.46	3.23	12.01	11.82	11.95	197
BB格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
B格以下	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
格付なし	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

出所:NFRC

- 格付は、格付会社4社の最低格付をもとにNFRCで分類

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

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
AAA~AA格	284	98.93	99.08	3.46	0.71	0.98	0.98	3.38	3.36	3.38	71
短期(1-3)	155	99.79	99.95	2.16	0.72	0.86	0.86	2.14	2.13	2.14	73
中期(3-7)	115	98.28	98.41	4.55	0.67	1.07	1.07	4.48	4.45	4.48	67
長期(7-)	14	94.69	94.85	9.03	0.94	1.65	1.61	8.66	8.59	8.65	73
長期(7-11)	14	94.69	94.85	9.03	0.94	1.65	1.61	8.66	8.59	8.65	73
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AAA~A格	1,730	98.82	99.12	3.75	0.99	1.26	1.25	3.60	3.57	3.60	96
短期(1-3)	882	99.87	100.19	2.21	1.04	1.09	1.09	2.18	2.17	2.18	96
中期(3-7)	726	97.97	98.19	4.42	0.82	1.30	1.29	4.33	4.30	4.33	91
長期(7-)	123	96.29	96.96	10.91	1.70	2.24	2.21	9.75	9.64	9.72	120
長期(7-11)	73	93.15	93.38	8.76	0.94	1.89	1.82	8.39	8.31	8.38	98
超長期(11-)	50	100.87	102.17	14.04	2.81	2.72	2.73	11.57	11.41	11.50	149
AAA~BBB格	3,421	98.21	98.52	3.92	1.07	1.43	1.41	3.70	3.67	3.70	111
短期(1-3)	1,560	99.79	100.13	2.05	1.09	1.18	1.17	2.02	2.01	2.02	107
中期(3-7)	1,558	97.71	97.95	4.37	0.92	1.47	1.45	4.27	4.24	4.27	108
長期(7-)	304	92.64	93.18	11.21	1.74	2.62	2.52	9.90	9.77	9.87	149
長期(7-11)	167	93.32	93.66	8.85	1.26	2.18	2.11	8.33	8.24	8.32	126
超長期(11-)	137	91.83	92.61	14.07	2.33	3.16	3.03	11.83	11.66	11.77	178
AAA~BB格	3,421	98.21	98.52	3.92	1.07	1.43	1.41	3.70	3.67	3.70	111
短期(1-3)	1,560	99.79	100.13	2.05	1.09	1.18	1.17	2.02	2.01	2.02	107
中期(3-7)	1,558	97.71	97.95	4.37	0.92	1.47	1.45	4.27	4.24	4.27	108
長期(7-)	304	92.64	93.18	11.21	1.74	2.62	2.52	9.90	9.77	9.87	149
長期(7-11)	167	93.32	93.66	8.85	1.26	2.18	2.11	8.33	8.24	8.32	126
超長期(11-)	137	91.83	92.61	14.07	2.33	3.16	3.03	11.83	11.66	11.77	178
AAA格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA格	284	98.93	99.08	3.46	0.71	0.98	0.98	3.38	3.36	3.38	71
短期(1-3)	155	99.79	99.95	2.16	0.72	0.86	0.86	2.14	2.13	2.14	73
中期(3-7)	115	98.28	98.41	4.55	0.67	1.07	1.07	4.48	4.45	4.48	67
長期(7-)	14	94.69	94.85	9.03	0.94	1.65	1.61	8.66	8.59	8.65	73
長期(7-11)	14	94.69	94.85	9.03	0.94	1.65	1.61	8.66	8.59	8.65	73
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
A格	1,446	98.80	99.13	3.81	1.05	1.31	1.30	3.64	3.61	3.64	100
短期(1-3)	727	99.89	100.24	2.22	1.11	1.14	1.14	2.19	2.18	2.19	101
中期(3-7)	611	97.91	98.15	4.39	0.84	1.34	1.33	4.30	4.27	4.30	95
長期(7-)	109	96.50	97.23	11.15	1.80	2.32	2.29	9.89	9.77	9.85	125
長期(7-11)	59	92.79	93.04	8.70	0.95	1.94	1.87	8.33	8.25	8.32	103
超長期(11-)	50	100.87	102.17	14.04	2.81	2.72	2.73	11.57	11.41	11.50	149
BBB格	1,691	97.58	97.90	4.09	1.15	1.61	1.58	3.81	3.78	3.81	126
短期(1-3)	678	99.68	100.05	1.84	1.15	1.29	1.28	1.82	1.80	1.82	120
中期(3-7)	832	97.48	97.74	4.33	1.01	1.62	1.60	4.22	4.19	4.22	123
長期(7-)	181	90.17	90.62	11.41	1.77	2.89	2.75	10.01	9.87	9.98	171
長期(7-11)	94	93.45	93.87	8.92	1.51	2.41	2.34	8.29	8.19	8.28	148
超長期(11-)	87	86.63	87.11	14.09	2.05	3.46	3.23	12.01	11.82	11.95	197
BB格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
B格以下	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
格付なし	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

出所:NFRC

- 格付は、格付会社4社の最低格付をもとにNFRCで分類

円建外債 R&I 格付別・ポートフォリオ指標 (2023年10月末)

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
AAA~AA 格	60	99.98	100.25	1.95	0.91	1.02	1.02	1.93	1.92	1.93	93
短期 (1-3)	60	99.98	100.25	1.95	0.91	1.02	1.02	1.93	1.92	1.93	93
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AAA~A 格	865	98.48	98.89	3.28	1.22	1.53	1.51	3.17	3.15	3.17	127
短期 (1-3)	417	100.14	100.67	1.88	1.56	1.45	1.45	1.85	1.83	1.85	136
中期 (3-7)	419	97.32	97.60	4.27	0.90	1.57	1.55	4.18	4.15	4.18	118
長期 (7-)	29	91.45	91.78	9.01	0.96	2.10	2.02	8.59	8.51	8.59	114
長期 (7-11)	29	91.45	91.78	9.01	0.96	2.10	2.02	8.59	8.51	8.59	114
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AAA~BBB 格	914	98.35	98.74	3.31	1.20	1.52	1.50	3.18	3.15	3.18	126
短期 (1-3)	454	100.09	100.59	1.81	1.48	1.41	1.41	1.79	1.77	1.79	133
中期 (3-7)	419	97.32	97.60	4.27	0.90	1.57	1.55	4.18	4.15	4.18	118
長期 (7-)	41	89.39	89.78	10.16	1.06	2.34	2.22	9.47	9.36	9.45	125
長期 (7-11)	29	91.45	91.78	9.01	0.96	2.10	2.02	8.59	8.51	8.59	114
超長期 (11-)	11	84.13	84.66	13.11	1.32	3.01	2.77	11.89	11.72	11.86	156
AAA~BB 格	914	98.35	98.74	3.31	1.20	1.52	1.50	3.18	3.15	3.18	126
短期 (1-3)	454	100.09	100.59	1.81	1.48	1.41	1.41	1.79	1.77	1.79	133
中期 (3-7)	419	97.32	97.60	4.27	0.90	1.57	1.55	4.18	4.15	4.18	118
長期 (7-)	41	89.39	89.78	10.16	1.06	2.34	2.22	9.47	9.36	9.45	125
長期 (7-11)	29	91.45	91.78	9.01	0.96	2.10	2.02	8.59	8.51	8.59	114
超長期 (11-)	11	84.13	84.66	13.11	1.32	3.01	2.77	11.89	11.72	11.86	156
AAA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA 格	60	99.98	100.25	1.95	0.91	1.02	1.02	1.93	1.92	1.93	93
短期 (1-3)	60	99.98	100.25	1.95	0.91	1.02	1.02	1.93	1.92	1.93	93
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
A 格	805	98.37	98.78	3.38	1.25	1.56	1.55	3.26	3.24	3.26	130
短期 (1-3)	357	100.17	100.74	1.87	1.67	1.52	1.52	1.83	1.82	1.83	144
中期 (3-7)	419	97.32	97.60	4.27	0.90	1.57	1.55	4.18	4.15	4.18	118
長期 (7-)	29	91.45	91.78	9.01	0.96	2.10	2.02	8.59	8.51	8.59	114
長期 (7-11)	29	91.45	91.78	9.01	0.96	2.10	2.02	8.59	8.51	8.59	114
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
BBB 格	49	95.92	96.20	3.92	0.71	1.37	1.32	3.33	3.29	3.32	108
短期 (1-3)	37	99.53	99.74	1.11	0.52	0.94	0.94	1.10	1.10	1.10	96
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	11	84.13	84.66	13.11	1.32	3.01	2.77	11.89	11.72	11.86	156
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	11	84.13	84.66	13.11	1.32	3.01	2.77	11.89	11.72	11.86	156
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	2,314	98.08	98.38	4.07	1.03	1.42	1.40	3.81	3.78	3.81	108
短期 (1-3)	1,019	99.41	99.64	2.06	0.84	1.08	1.08	2.04	2.03	2.04	97
中期 (3-7)	1,043	98.03	98.33	4.25	1.02	1.46	1.44	4.14	4.11	4.14	109
長期 (7-)	252	92.93	93.51	11.43	1.87	2.71	2.61	10.00	9.87	9.96	157
長期 (7-11)	127	93.34	93.69	8.73	1.32	2.25	2.18	8.19	8.10	8.18	135
超長期 (11-)	126	92.52	93.33	14.16	2.42	3.18	3.05	11.83	11.65	11.76	179

出所:NFRC

- 格付は、R&I の格付をもとに NFRC で分類

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

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
AAA~AA 格	60	99.98	100.25	1.95	0.91	1.02	1.02	1.93	1.92	1.93	93
短期 (1-3)	60	99.98	100.25	1.95	0.91	1.02	1.02	1.93	1.92	1.93	93
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AAA~A 格	865	98.48	98.89	3.28	1.22	1.53	1.51	3.17	3.15	3.17	127
短期 (1-3)	417	100.14	100.67	1.88	1.56	1.45	1.45	1.85	1.83	1.85	136
中期 (3-7)	419	97.32	97.60	4.27	0.90	1.57	1.55	4.18	4.15	4.18	118
長期 (7-)	29	91.45	91.78	9.01	0.96	2.10	2.02	8.59	8.51	8.59	114
長期 (7-11)	29	91.45	91.78	9.01	0.96	2.10	2.02	8.59	8.51	8.59	114
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AAA~BBB 格	914	98.35	98.74	3.31	1.20	1.52	1.50	3.18	3.15	3.18	126
短期 (1-3)	454	100.09	100.59	1.81	1.48	1.41	1.41	1.79	1.77	1.79	133
中期 (3-7)	419	97.32	97.60	4.27	0.90	1.57	1.55	4.18	4.15	4.18	118
長期 (7-)	41	89.39	89.78	10.16	1.06	2.34	2.22	9.47	9.36	9.45	125
長期 (7-11)	29	91.45	91.78	9.01	0.96	2.10	2.02	8.59	8.51	8.59	114
超長期 (11-)	11	84.13	84.66	13.11	1.32	3.01	2.77	11.89	11.72	11.86	156
AAA~BB 格	914	98.35	98.74	3.31	1.20	1.52	1.50	3.18	3.15	3.18	126
短期 (1-3)	454	100.09	100.59	1.81	1.48	1.41	1.41	1.79	1.77	1.79	133
中期 (3-7)	419	97.32	97.60	4.27	0.90	1.57	1.55	4.18	4.15	4.18	118
長期 (7-)	41	89.39	89.78	10.16	1.06	2.34	2.22	9.47	9.36	9.45	125
長期 (7-11)	29	91.45	91.78	9.01	0.96	2.10	2.02	8.59	8.51	8.59	114
超長期 (11-)	11	84.13	84.66	13.11	1.32	3.01	2.77	11.89	11.72	11.86	156
AAA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA 格	60	99.98	100.25	1.95	0.91	1.02	1.02	1.93	1.92	1.93	93
短期 (1-3)	60	99.98	100.25	1.95	0.91	1.02	1.02	1.93	1.92	1.93	93
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
A 格	805	98.37	98.78	3.38	1.25	1.56	1.55	3.26	3.24	3.26	130
短期 (1-3)	357	100.17	100.74	1.87	1.67	1.52	1.52	1.83	1.82	1.83	144
中期 (3-7)	419	97.32	97.60	4.27	0.90	1.57	1.55	4.18	4.15	4.18	118
長期 (7-)	29	91.45	91.78	9.01	0.96	2.10	2.02	8.59	8.51	8.59	114
長期 (7-11)	29	91.45	91.78	9.01	0.96	2.10	2.02	8.59	8.51	8.59	114
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
BBB 格	49	95.92	96.20	3.92	0.71	1.37	1.32	3.33	3.29	3.32	108
短期 (1-3)	37	99.53	99.74	1.11	0.52	0.94	0.94	1.10	1.10	1.10	96
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	11	84.13	84.66	13.11	1.32	3.01	2.77	11.89	11.72	11.86	156
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	11	84.13	84.66	13.11	1.32	3.01	2.77	11.89	11.72	11.86	156
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	2,507	98.16	98.44	4.14	1.02	1.40	1.38	3.89	3.86	3.89	105
短期 (1-3)	1,105	99.66	99.94	2.15	0.93	1.08	1.08	2.12	2.11	2.12	96
中期 (3-7)	1,139	97.85	98.08	4.41	0.93	1.43	1.42	4.31	4.28	4.31	104
長期 (7-)	263	93.14	93.71	11.37	1.85	2.66	2.57	9.97	9.83	9.93	153
長期 (7-11)	138	93.71	94.05	8.82	1.33	2.20	2.13	8.28	8.19	8.27	129
超長期 (11-)	126	92.52	93.33	14.16	2.42	3.18	3.05	11.83	11.65	11.76	179

出所:NFRC

- 格付は、R&Iの格付をもとに NFRC で分類

円建外債 JCR 格付別・ポートフォリオ指標 (2023年10月末)

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
AAA~AA 格	224	98.47	98.74	4.09	1.06	1.38	1.36	3.91	3.88	3.91	103
短期 (1-3)	39	99.26	99.36	2.10	0.64	0.98	0.98	2.09	2.08	2.09	86
中期 (3-7)	163	99.03	99.33	3.78	1.11	1.36	1.35	3.69	3.67	3.69	104
長期 (7-)	22	92.92	93.31	9.80	1.36	2.26	2.18	8.96	8.86	8.94	126
長期 (7-11)	18	93.61	93.96	8.60	1.21	2.10	2.04	8.14	8.06	8.13	121
超長期 (11-)	4	89.96	90.53	14.92	1.99	2.97	2.83	12.61	12.43	12.53	151
AAA~A 格	1,073	98.15	98.55	4.54	1.39	1.64	1.62	4.13	4.09	4.13	126
短期 (1-3)	370	100.00	100.39	1.77	1.31	1.27	1.28	1.75	1.74	1.75	120
中期 (3-7)	537	98.51	98.85	4.04	1.21	1.51	1.50	3.93	3.90	3.93	117
長期 (7-)	167	92.85	93.52	12.29	2.16	2.97	2.87	10.52	10.37	10.48	175
長期 (7-11)	62	93.27	93.61	9.02	1.60	2.52	2.45	8.34	8.24	8.33	158
超長期 (11-)	104	92.60	93.47	14.24	2.49	3.25	3.12	11.83	11.65	11.76	186
AAA~BBB 格	1,074	98.14	98.55	4.54	1.39	1.64	1.62	4.13	4.09	4.13	126
短期 (1-3)	370	100.00	100.39	1.77	1.31	1.27	1.28	1.75	1.74	1.75	120
中期 (3-7)	538	98.50	98.84	4.05	1.21	1.52	1.50	3.93	3.90	3.93	117
長期 (7-)	167	92.85	93.52	12.29	2.16	2.97	2.87	10.52	10.37	10.48	175
長期 (7-11)	62	93.27	93.61	9.02	1.60	2.52	2.45	8.34	8.24	8.33	158
超長期 (11-)	104	92.60	93.47	14.24	2.49	3.25	3.12	11.83	11.65	11.76	186
AAA~BB 格	1,074	98.14	98.55	4.54	1.39	1.64	1.62	4.13	4.09	4.13	126
短期 (1-3)	370	100.00	100.39	1.77	1.31	1.27	1.28	1.75	1.74	1.75	120
中期 (3-7)	538	98.50	98.84	4.05	1.21	1.52	1.50	3.93	3.90	3.93	117
長期 (7-)	167	92.85	93.52	12.29	2.16	2.97	2.87	10.52	10.37	10.48	175
長期 (7-11)	62	93.27	93.61	9.02	1.60	2.52	2.45	8.34	8.24	8.33	158
超長期 (11-)	104	92.60	93.47	14.24	2.49	3.25	3.12	11.83	11.65	11.76	186
AAA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA 格	224	98.47	98.74	4.09	1.06	1.38	1.36	3.91	3.88	3.91	103
短期 (1-3)	39	99.26	99.36	2.10	0.64	0.98	0.98	2.09	2.08	2.09	86
中期 (3-7)	163	99.03	99.33	3.78	1.11	1.36	1.35	3.69	3.67	3.69	104
長期 (7-)	22	92.92	93.31	9.80	1.36	2.26	2.18	8.96	8.86	8.94	126
長期 (7-11)	18	93.61	93.96	8.60	1.21	2.10	2.04	8.14	8.06	8.13	121
超長期 (11-)	4	89.96	90.53	14.92	1.99	2.97	2.83	12.61	12.43	12.53	151
A 格	849	98.06	98.51	4.66	1.48	1.72	1.69	4.19	4.15	4.18	133
短期 (1-3)	331	100.08	100.51	1.73	1.39	1.31	1.31	1.71	1.70	1.71	124
中期 (3-7)	374	98.29	98.64	4.16	1.25	1.58	1.57	4.03	4.00	4.03	122
長期 (7-)	144	92.84	93.55	12.67	2.28	3.09	2.97	10.76	10.60	10.71	183
長期 (7-11)	44	93.14	93.47	9.19	1.75	2.70	2.61	8.43	8.32	8.41	174
超長期 (11-)	100	92.71	93.59	14.21	2.51	3.26	3.13	11.80	11.62	11.73	187
BBB 格	1	91.92	92.04	5.89	1.05	2.63	2.54	5.71	5.64	5.71	200
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	1	91.92	92.04	5.89	1.05	2.63	2.54	5.71	5.64	5.71	200
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	2,154	98.16	98.45	3.51	0.92	1.35	1.34	3.38	3.35	3.38	107
短期 (1-3)	1,103	99.50	99.78	2.06	0.95	1.15	1.15	2.03	2.02	2.03	104
中期 (3-7)	925	97.43	97.70	4.37	0.86	1.47	1.46	4.28	4.25	4.28	108
長期 (7-)	126	91.90	92.30	9.90	1.23	2.24	2.15	9.13	9.03	9.11	122
長期 (7-11)	93	92.79	93.15	8.62	1.02	2.02	1.96	8.21	8.13	8.21	112
超長期 (11-)	33	89.35	89.86	13.54	1.82	2.89	2.74	11.85	11.69	11.80	152

出所:NFRC

- 格付は、JCR の格付をもとに NFRC で分類

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

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
AAA~AA 格	224	98.47	98.74	4.09	1.06	1.38	1.36	3.91	3.88	3.91	103
短期 (1-3)	39	99.26	99.36	2.10	0.64	0.98	0.98	2.09	2.08	2.09	86
中期 (3-7)	163	99.03	99.33	3.78	1.11	1.36	1.35	3.69	3.67	3.69	104
長期 (7-)	22	92.92	93.31	9.80	1.36	2.26	2.18	8.96	8.86	8.94	126
長期 (7-11)	18	93.61	93.96	8.60	1.21	2.10	2.04	8.14	8.06	8.13	121
超長期 (11-)	4	89.96	90.53	14.92	1.99	2.97	2.83	12.61	12.43	12.53	151
AAA~A 格	1,073	98.15	98.55	4.54	1.39	1.64	1.62	4.13	4.09	4.13	126
短期 (1-3)	430	100.53	101.03	1.95	1.49	1.28	1.29	1.92	1.90	1.92	119
中期 (3-7)	477	97.85	98.08	4.17	1.03	1.54	1.52	4.06	4.03	4.06	117
長期 (7-)	167	92.85	93.52	12.29	2.16	2.97	2.87	10.52	10.37	10.48	175
長期 (7-11)	62	93.27	93.61	9.02	1.60	2.52	2.45	8.34	8.24	8.33	158
超長期 (11-)	104	92.60	93.47	14.24	2.49	3.25	3.12	11.83	11.65	11.76	186
AAA~BBB 格	1,074	98.14	98.55	4.54	1.39	1.64	1.62	4.13	4.09	4.13	126
短期 (1-3)	430	100.53	101.03	1.95	1.49	1.28	1.29	1.92	1.90	1.92	119
中期 (3-7)	478	97.84	98.06	4.17	1.03	1.54	1.52	4.07	4.04	4.07	117
長期 (7-)	167	92.85	93.52	12.29	2.16	2.97	2.87	10.52	10.37	10.48	175
長期 (7-11)	62	93.27	93.61	9.02	1.60	2.52	2.45	8.34	8.24	8.33	158
超長期 (11-)	104	92.60	93.47	14.24	2.49	3.25	3.12	11.83	11.65	11.76	186
AAA~BB 格	1,074	98.14	98.55	4.54	1.39	1.64	1.62	4.13	4.09	4.13	126
短期 (1-3)	430	100.53	101.03	1.95	1.49	1.28	1.29	1.92	1.90	1.92	119
中期 (3-7)	478	97.84	98.06	4.17	1.03	1.54	1.52	4.07	4.04	4.07	117
長期 (7-)	167	92.85	93.52	12.29	2.16	2.97	2.87	10.52	10.37	10.48	175
長期 (7-11)	62	93.27	93.61	9.02	1.60	2.52	2.45	8.34	8.24	8.33	158
超長期 (11-)	104	92.60	93.47	14.24	2.49	3.25	3.12	11.83	11.65	11.76	186
AAA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA 格	224	98.47	98.74	4.09	1.06	1.38	1.36	3.91	3.88	3.91	103
短期 (1-3)	39	99.26	99.36	2.10	0.64	0.98	0.98	2.09	2.08	2.09	86
中期 (3-7)	163	99.03	99.33	3.78	1.11	1.36	1.35	3.69	3.67	3.69	104
長期 (7-)	22	92.92	93.31	9.80	1.36	2.26	2.18	8.96	8.86	8.94	126
長期 (7-11)	18	93.61	93.96	8.60	1.21	2.10	2.04	8.14	8.06	8.13	121
超長期 (11-)	4	89.96	90.53	14.92	1.99	2.97	2.83	12.61	12.43	12.53	151
A 格	849	98.06	98.51	4.66	1.48	1.72	1.69	4.19	4.15	4.18	133
短期 (1-3)	391	100.65	101.20	1.93	1.58	1.31	1.32	1.90	1.89	1.90	122
中期 (3-7)	314	97.24	97.43	4.37	0.99	1.63	1.61	4.26	4.23	4.26	124
長期 (7-)	144	92.84	93.55	12.67	2.28	3.09	2.97	10.76	10.60	10.71	183
長期 (7-11)	44	93.14	93.47	9.19	1.75	2.70	2.61	8.43	8.32	8.41	174
超長期 (11-)	100	92.71	93.59	14.21	2.51	3.26	3.13	11.80	11.62	11.73	187
BBB 格	1	91.92	92.04	5.89	1.05	2.63	2.54	5.71	5.64	5.71	200
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	1	91.92	92.04	5.89	1.05	2.63	2.54	5.71	5.64	5.71	200
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	2,347	98.24	98.51	3.64	0.92	1.33	1.32	3.51	3.48	3.50	103
短期 (1-3)	1,130	99.51	99.78	2.09	0.93	1.13	1.13	2.06	2.05	2.06	102
中期 (3-7)	1,080	97.65	97.90	4.46	0.87	1.43	1.42	4.37	4.33	4.37	103
長期 (7-)	137	92.39	92.77	9.90	1.24	2.19	2.11	9.14	9.04	9.12	117
長期 (7-11)	104	93.34	93.69	8.75	1.06	1.98	1.91	8.33	8.25	8.32	107
超長期 (11-)	33	89.35	89.86	13.54	1.82	2.89	2.74	11.85	11.69	11.80	152

出所:NFRC

- 格付は、JCR の格付をもとに NFRC で分類

円建外債 Moody's 格付別・ポートフォリオ指標 (2023年10月末)

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
AAA~AA 格	713	98.26	98.42	3.36	0.65	1.09	1.08	3.29	3.27	3.29	82
短期 (1-3)	408	99.26	99.39	2.25	0.61	0.92	0.92	2.23	2.22	2.23	78
中期 (3-7)	274	97.46	97.63	4.41	0.68	1.27	1.25	4.34	4.31	4.34	87
長期 (7-)	32	92.41	92.59	8.64	0.80	1.84	1.77	8.32	8.25	8.32	94
長期 (7-11)	32	92.41	92.59	8.64	0.80	1.84	1.77	8.32	8.25	8.32	94
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AAA~A 格	1,570	98.57	98.86	3.74	0.90	1.26	1.25	3.57	3.55	3.57	96
短期 (1-3)	755	99.34	99.51	2.15	0.71	1.00	1.00	2.13	2.12	2.13	88
中期 (3-7)	688	98.19	98.54	4.14	0.95	1.35	1.34	4.04	4.02	4.04	99
長期 (7-)	127	96.04	96.72	11.02	1.78	2.36	2.32	9.80	9.69	9.77	130
長期 (7-11)	67	92.11	92.38	8.65	0.90	1.98	1.91	8.29	8.21	8.29	107
超長期 (11-)	60	100.46	101.59	13.68	2.78	2.74	2.75	11.35	11.19	11.29	153
AAA~BBB 格	2,812	98.03	98.33	4.03	0.98	1.39	1.37	3.79	3.76	3.79	105
短期 (1-3)	1,209	99.44	99.66	2.03	0.78	1.03	1.02	2.01	2.00	2.01	92
中期 (3-7)	1,318	97.94	98.24	4.28	1.00	1.46	1.45	4.18	4.15	4.18	108
長期 (7-)	285	92.48	93.05	11.34	1.77	2.67	2.57	9.98	9.85	9.95	153
長期 (7-11)	148	93.09	93.45	8.81	1.26	2.21	2.14	8.28	8.19	8.27	130
超長期 (11-)	137	91.83	92.61	14.07	2.33	3.16	3.03	11.83	11.66	11.77	178
AAA~BB 格	2,812	98.03	98.33	4.03	0.98	1.39	1.37	3.79	3.76	3.79	105
短期 (1-3)	1,209	99.44	99.66	2.03	0.78	1.03	1.02	2.01	2.00	2.01	92
中期 (3-7)	1,318	97.94	98.24	4.28	1.00	1.46	1.45	4.18	4.15	4.18	108
長期 (7-)	285	92.48	93.05	11.34	1.77	2.67	2.57	9.98	9.85	9.95	153
長期 (7-11)	148	93.09	93.45	8.81	1.26	2.21	2.14	8.28	8.19	8.27	130
超長期 (11-)	137	91.83	92.61	14.07	2.33	3.16	3.03	11.83	11.66	11.77	178
AAA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA 格	713	98.26	98.42	3.36	0.65	1.09	1.08	3.29	3.27	3.29	82
短期 (1-3)	408	99.26	99.39	2.25	0.61	0.92	0.92	2.23	2.22	2.23	78
中期 (3-7)	274	97.46	97.63	4.41	0.68	1.27	1.25	4.34	4.31	4.34	87
長期 (7-)	32	92.41	92.59	8.64	0.80	1.84	1.77	8.32	8.25	8.32	94
長期 (7-11)	32	92.41	92.59	8.64	0.80	1.84	1.77	8.32	8.25	8.32	94
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
A 格	858	98.83	99.22	4.05	1.12	1.40	1.40	3.81	3.78	3.81	108
短期 (1-3)	347	99.45	99.64	2.03	0.83	1.10	1.10	2.01	2.00	2.01	99
中期 (3-7)	414	98.68	99.13	3.96	1.13	1.41	1.40	3.85	3.82	3.85	107
長期 (7-)	96	97.24	98.08	11.81	2.11	2.52	2.49	10.26	10.14	10.22	141
長期 (7-11)	36	91.85	92.19	8.66	0.98	2.11	2.03	8.27	8.19	8.26	119
超長期 (11-)	60	100.46	101.59	13.68	2.78	2.74	2.75	11.35	11.19	11.29	153
BBB 格	1,242	97.35	97.65	4.40	1.08	1.54	1.52	4.07	4.03	4.06	117
短期 (1-3)	455	99.60	99.91	1.84	0.89	1.06	1.06	1.82	1.81	1.82	98
中期 (3-7)	630	97.65	97.92	4.45	1.05	1.58	1.56	4.33	4.29	4.33	118
長期 (7-)	157	89.60	90.07	11.60	1.76	2.94	2.78	10.14	9.99	10.10	173
長期 (7-11)	80	93.92	94.36	8.94	1.56	2.40	2.34	8.27	8.18	8.26	148
超長期 (11-)	77	85.10	85.61	14.37	1.97	3.55	3.29	12.28	12.09	12.22	201
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	416	99.01	99.55	2.66	1.74	1.86	1.85	2.57	2.54	2.57	167
短期 (1-3)	264	100.45	101.20	1.77	2.22	1.90	1.90	1.73	1.72	1.73	182
中期 (3-7)	144	96.80	96.99	3.97	0.90	1.75	1.73	3.88	3.85	3.88	140
長期 (7-)	8	90.89	91.11	8.32	1.15	2.47	2.36	7.92	7.83	7.91	156
長期 (7-11)	8	90.89	91.11	8.32	1.15	2.47	2.36	7.92	7.83	7.91	156
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

出所:NFRC

- 格付は、Moody's の格付をもとに NFRC で分類

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

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
AAA~AA 格	906	98.43	98.57	3.72	0.70	1.09	1.09	3.63	3.61	3.63	79
短期 (1-3)	434	99.30	99.43	2.31	0.60	0.89	0.89	2.29	2.28	2.29	74
中期 (3-7)	429	98.00	98.16	4.62	0.78	1.24	1.23	4.53	4.51	4.53	83
長期 (7-)	43	93.86	94.04	8.95	0.95	1.77	1.72	8.57	8.50	8.56	85
長期 (7-11)	43	93.86	94.04	8.95	0.95	1.77	1.72	8.57	8.50	8.56	85
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AAA~A 格	1,763	98.62	98.89	3.88	0.90	1.25	1.24	3.72	3.69	3.72	93
短期 (1-3)	841	99.68	99.91	2.25	0.84	1.01	1.01	2.22	2.21	2.22	87
中期 (3-7)	784	97.92	98.15	4.39	0.83	1.32	1.31	4.30	4.27	4.30	93
長期 (7-)	139	96.20	96.83	10.93	1.75	2.29	2.26	9.76	9.65	9.73	124
長期 (7-11)	79	92.94	93.19	8.82	0.96	1.92	1.86	8.43	8.36	8.43	101
超長期 (11-)	60	100.46	101.59	13.68	2.78	2.74	2.75	11.35	11.19	11.29	153
AAA~BBB 格	3,006	98.10	98.38	4.10	0.98	1.37	1.35	3.86	3.83	3.86	103
短期 (1-3)	1,296	99.65	99.91	2.11	0.86	1.03	1.03	2.08	2.07	2.08	91
中期 (3-7)	1,414	97.80	98.05	4.42	0.92	1.44	1.42	4.31	4.28	4.31	105
長期 (7-)	296	92.69	93.24	11.28	1.76	2.62	2.53	9.95	9.82	9.92	149
長期 (7-11)	159	93.44	93.78	8.88	1.27	2.17	2.10	8.35	8.26	8.34	125
超長期 (11-)	137	91.83	92.61	14.07	2.33	3.16	3.03	11.83	11.66	11.77	178
AAA~BB 格	3,006	98.10	98.38	4.10	0.98	1.37	1.35	3.86	3.83	3.86	103
短期 (1-3)	1,296	99.65	99.91	2.11	0.86	1.03	1.03	2.08	2.07	2.08	91
中期 (3-7)	1,414	97.80	98.05	4.42	0.92	1.44	1.42	4.31	4.28	4.31	105
長期 (7-)	296	92.69	93.24	11.28	1.76	2.62	2.53	9.95	9.82	9.92	149
長期 (7-11)	159	93.44	93.78	8.88	1.27	2.17	2.10	8.35	8.26	8.34	125
超長期 (11-)	137	91.83	92.61	14.07	2.33	3.16	3.03	11.83	11.66	11.77	178
AAA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA 格	906	98.43	98.57	3.72	0.70	1.09	1.09	3.63	3.61	3.63	79
短期 (1-3)	434	99.30	99.43	2.31	0.60	0.89	0.89	2.29	2.28	2.29	74
中期 (3-7)	429	98.00	98.16	4.62	0.78	1.24	1.23	4.53	4.51	4.53	83
長期 (7-)	43	93.86	94.04	8.95	0.95	1.77	1.72	8.57	8.50	8.56	85
長期 (7-11)	43	93.86	94.04	8.95	0.95	1.77	1.72	8.57	8.50	8.56	85
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
A 格	858	98.83	99.22	4.05	1.12	1.40	1.40	3.81	3.78	3.81	108
短期 (1-3)	407	100.08	100.43	2.18	1.09	1.14	1.14	2.15	2.13	2.15	101
中期 (3-7)	354	97.82	98.14	4.11	0.88	1.42	1.41	4.02	3.99	4.02	106
長期 (7-)	96	97.24	98.08	11.81	2.11	2.52	2.49	10.26	10.14	10.22	141
長期 (7-11)	36	91.85	92.19	8.66	0.98	2.11	2.03	8.27	8.19	8.26	119
超長期 (11-)	60	100.46	101.59	13.68	2.78	2.74	2.75	11.35	11.19	11.29	153
BBB 格	1,242	97.35	97.65	4.40	1.08	1.54	1.52	4.07	4.03	4.06	117
短期 (1-3)	455	99.60	99.91	1.84	0.89	1.06	1.06	1.82	1.81	1.82	98
中期 (3-7)	630	97.65	97.92	4.45	1.05	1.58	1.56	4.33	4.29	4.33	118
長期 (7-)	157	89.60	90.07	11.60	1.76	2.94	2.78	10.14	9.99	10.10	173
長期 (7-11)	80	93.92	94.36	8.94	1.56	2.40	2.34	8.27	8.18	8.26	148
超長期 (11-)	77	85.10	85.61	14.37	1.97	3.55	3.29	12.28	12.09	12.22	201
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	416	99.01	99.55	2.66	1.74	1.86	1.85	2.57	2.54	2.57	167
短期 (1-3)	264	100.45	101.20	1.77	2.22	1.90	1.90	1.73	1.72	1.73	182
中期 (3-7)	144	96.80	96.99	3.97	0.90	1.75	1.73	3.88	3.85	3.88	140
長期 (7-)	8	90.89	91.11	8.32	1.15	2.47	2.36	7.92	7.83	7.91	156
長期 (7-11)	8	90.89	91.11	8.32	1.15	2.47	2.36	7.92	7.83	7.91	156
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

出所:NFRC

- 格付は、Moody's の格付をもとに NFRC で分類

円建外債 S&P 格付別・ポートフォリオ指標 (2023年10月末)

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
AAA~AA 格	136	98.20	98.39	3.70	0.71	1.09	1.08	3.61	3.59	3.61	79
短期 (1-3)	51	100.09	100.33	2.14	0.96	0.96	0.96	2.11	2.10	2.11	84
中期 (3-7)	78	97.62	97.78	4.30	0.55	1.12	1.11	4.23	4.21	4.23	74
長期 (7-)	7	91.02	91.16	8.28	0.60	1.85	1.77	8.06	7.99	8.06	97
長期 (7-11)	7	91.02	91.16	8.28	0.60	1.85	1.77	8.06	7.99	8.06	97
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AAA~A 格	1,386	98.48	98.77	3.86	0.89	1.28	1.27	3.69	3.66	3.69	96
短期 (1-3)	605	99.22	99.38	2.26	0.68	1.02	1.01	2.24	2.22	2.24	88
中期 (3-7)	671	98.19	98.52	4.12	0.94	1.35	1.34	4.03	4.00	4.03	99
長期 (7-)	109	96.23	96.96	11.07	1.76	2.32	2.29	9.84	9.72	9.80	126
長期 (7-11)	59	92.33	92.58	8.57	0.88	1.95	1.88	8.23	8.16	8.23	105
超長期 (11-)	50	100.87	102.17	14.04	2.81	2.72	2.73	11.57	11.41	11.50	149
AAA~BBB 格	3,012	98.00	98.31	3.99	1.03	1.45	1.43	3.76	3.73	3.76	112
短期 (1-3)	1,272	99.46	99.73	2.04	0.92	1.15	1.15	2.01	2.00	2.01	104
中期 (3-7)	1,450	97.83	98.13	4.25	0.99	1.49	1.47	4.15	4.11	4.15	111
長期 (7-)	290	92.45	93.01	11.28	1.77	2.67	2.57	9.94	9.81	9.91	153
長期 (7-11)	153	93.02	93.37	8.79	1.26	2.23	2.16	8.27	8.18	8.26	131
超長期 (11-)	137	91.83	92.61	14.07	2.33	3.16	3.03	11.83	11.66	11.77	178
AAA~BB 格	3,012	98.00	98.31	3.99	1.03	1.45	1.43	3.76	3.73	3.76	112
短期 (1-3)	1,272	99.46	99.73	2.04	0.92	1.15	1.15	2.01	2.00	2.01	104
中期 (3-7)	1,450	97.83	98.13	4.25	0.99	1.49	1.47	4.15	4.11	4.15	111
長期 (7-)	290	92.45	93.01	11.28	1.77	2.67	2.57	9.94	9.81	9.91	153
長期 (7-11)	153	93.02	93.37	8.79	1.26	2.23	2.16	8.27	8.18	8.26	131
超長期 (11-)	137	91.83	92.61	14.07	2.33	3.16	3.03	11.83	11.66	11.77	178
AAA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA 格	136	98.20	98.39	3.70	0.71	1.09	1.08	3.61	3.59	3.61	79
短期 (1-3)	51	100.09	100.33	2.14	0.96	0.96	0.96	2.11	2.10	2.11	84
中期 (3-7)	78	97.62	97.78	4.30	0.55	1.12	1.11	4.23	4.21	4.23	74
長期 (7-)	7	91.02	91.16	8.28	0.60	1.85	1.77	8.06	7.99	8.06	97
長期 (7-11)	7	91.02	91.16	8.28	0.60	1.85	1.77	8.06	7.99	8.06	97
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
A 格	1,250	98.51	98.81	3.87	0.91	1.30	1.29	3.70	3.67	3.70	98
短期 (1-3)	554	99.14	99.29	2.27	0.65	1.02	1.02	2.25	2.24	2.25	88
中期 (3-7)	594	98.26	98.62	4.10	0.99	1.38	1.37	4.00	3.98	4.00	102
長期 (7-)	102	96.60	97.37	11.27	1.85	2.35	2.32	9.95	9.84	9.92	128
長期 (7-11)	52	92.51	92.77	8.62	0.92	1.96	1.89	8.26	8.18	8.25	106
超長期 (11-)	50	100.87	102.17	14.04	2.81	2.72	2.73	11.57	11.41	11.50	149
BBB 格	1,627	97.59	97.92	4.11	1.15	1.60	1.58	3.82	3.78	3.82	126
短期 (1-3)	667	99.68	100.05	1.84	1.14	1.27	1.27	1.81	1.80	1.81	119
中期 (3-7)	778	97.52	97.78	4.36	1.02	1.61	1.59	4.25	4.21	4.25	122
長期 (7-)	181	90.17	90.62	11.41	1.77	2.89	2.75	10.01	9.87	9.98	171
長期 (7-11)	94	93.45	93.87	8.92	1.51	2.41	2.34	8.29	8.19	8.28	148
超長期 (11-)	87	86.63	87.11	14.09	2.05	3.46	3.23	12.01	11.82	11.95	197
BB 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
B 格以下	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
格付なし	216	100.35	100.90	1.91	1.72	1.39	1.40	1.87	1.85	1.87	131
短期 (1-3)	201	100.65	101.23	1.67	1.78	1.38	1.38	1.64	1.63	1.64	132
中期 (3-7)	13	97.20	97.35	4.73	0.97	1.56	1.55	4.62	4.59	4.62	113
長期 (7-)	2	90.75	90.87	8.26	0.51	1.80	1.72	8.08	8.01	8.08	91
長期 (7-11)	2	90.75	90.87	8.26	0.51	1.80	1.72	8.08	8.01	8.08	91
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

出所:NFRC

- 格付は、S&P の格付をもとに NFRC で分類

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

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
AAA~AA 格	206	98.75	98.90	4.00	0.71	0.97	0.96	3.90	3.88	3.90	63
短期 (1-3)	84	100.05	100.22	2.42	0.77	0.77	0.77	2.40	2.39	2.40	61
中期 (3-7)	108	98.25	98.39	4.59	0.63	1.04	1.03	4.51	4.49	4.51	63
長期 (7-)	14	94.69	94.85	9.03	0.94	1.65	1.61	8.66	8.59	8.65	73
長期 (7-11)	14	94.69	94.85	9.03	0.94	1.65	1.61	8.66	8.59	8.65	73
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AAA~A 格	1,579	98.55	98.82	4.00	0.89	1.26	1.25	3.84	3.81	3.84	93
短期 (1-3)	692	99.64	99.89	2.37	0.83	1.02	1.02	2.34	2.33	2.34	87
中期 (3-7)	767	97.91	98.13	4.38	0.82	1.32	1.31	4.30	4.27	4.30	93
長期 (7-)	121	96.40	97.07	10.96	1.73	2.25	2.22	9.78	9.67	9.75	120
長期 (7-11)	71	93.22	93.46	8.78	0.96	1.89	1.83	8.40	8.32	8.39	98
超長期 (11-)	50	100.87	102.17	14.04	2.81	2.72	2.73	11.57	11.41	11.50	149
AAA~BBB 格	3,206	98.06	98.36	4.06	1.03	1.43	1.41	3.83	3.80	3.83	109
短期 (1-3)	1,359	99.66	99.97	2.11	0.98	1.15	1.14	2.08	2.07	2.08	103
中期 (3-7)	1,545	97.71	97.96	4.37	0.92	1.47	1.45	4.27	4.24	4.27	108
長期 (7-)	302	92.66	93.20	11.23	1.75	2.63	2.53	9.91	9.79	9.88	150
長期 (7-11)	165	93.35	93.69	8.86	1.27	2.19	2.12	8.34	8.25	8.33	127
超長期 (11-)	137	91.83	92.61	14.07	2.33	3.16	3.03	11.83	11.66	11.77	178
AAA~BB 格	3,206	98.06	98.36	4.06	1.03	1.43	1.41	3.83	3.80	3.83	109
短期 (1-3)	1,359	99.66	99.97	2.11	0.98	1.15	1.14	2.08	2.07	2.08	103
中期 (3-7)	1,545	97.71	97.96	4.37	0.92	1.47	1.45	4.27	4.24	4.27	108
長期 (7-)	302	92.66	93.20	11.23	1.75	2.63	2.53	9.91	9.79	9.88	150
長期 (7-11)	165	93.35	93.69	8.86	1.27	2.19	2.12	8.34	8.25	8.33	127
超長期 (11-)	137	91.83	92.61	14.07	2.33	3.16	3.03	11.83	11.66	11.77	178
AAA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA 格	206	98.75	98.90	4.00	0.71	0.97	0.96	3.90	3.88	3.90	63
短期 (1-3)	84	100.05	100.22	2.42	0.77	0.77	0.77	2.40	2.39	2.40	61
中期 (3-7)	108	98.25	98.39	4.59	0.63	1.04	1.03	4.51	4.49	4.51	63
長期 (7-)	14	94.69	94.85	9.03	0.94	1.65	1.61	8.66	8.59	8.65	73
長期 (7-11)	14	94.69	94.85	9.03	0.94	1.65	1.61	8.66	8.59	8.65	73
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
A 格	1,373	98.52	98.81	4.00	0.92	1.30	1.29	3.83	3.80	3.83	97
短期 (1-3)	607	99.58	99.84	2.36	0.84	1.06	1.05	2.33	2.32	2.33	91
中期 (3-7)	659	97.85	98.09	4.35	0.85	1.37	1.35	4.26	4.23	4.26	98
長期 (7-)	107	96.61	97.36	11.21	1.83	2.33	2.30	9.92	9.81	9.89	126
長期 (7-11)	57	92.86	93.12	8.72	0.96	1.95	1.88	8.33	8.26	8.33	104
超長期 (11-)	50	100.87	102.17	14.04	2.81	2.72	2.73	11.57	11.41	11.50	149
BBB 格	1,627	97.59	97.92	4.11	1.15	1.60	1.58	3.82	3.78	3.82	126
短期 (1-3)	667	99.68	100.05	1.84	1.14	1.27	1.27	1.81	1.80	1.81	119
中期 (3-7)	778	97.52	97.78	4.36	1.02	1.61	1.59	4.25	4.21	4.25	122
長期 (7-)	181	90.17	90.62	11.41	1.77	2.89	2.75	10.01	9.87	9.98	171
長期 (7-11)	94	93.45	93.87	8.92	1.51	2.41	2.34	8.29	8.19	8.28	148
超長期 (11-)	87	86.63	87.11	14.09	2.05	3.46	3.23	12.01	11.82	11.95	197
BB 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
B 格以下	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
格付なし	216	100.35	100.90	1.91	1.72	1.39	1.40	1.87	1.85	1.87	131
短期 (1-3)	201	100.65	101.23	1.67	1.78	1.38	1.38	1.64	1.63	1.64	132
中期 (3-7)	13	97.20	97.35	4.73	0.97	1.56	1.55	4.62	4.59	4.62	113
長期 (7-)	2	90.75	90.87	8.26	0.51	1.80	1.72	8.08	8.01	8.08	91
長期 (7-11)	2	90.75	90.87	8.26	0.51	1.80	1.72	8.08	8.01	8.08	91
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

出所:NFRC

- 格付は、S&P の格付をもとに NFRC で分類

NOMURA-BPI/Extended 総合・ポートフォリオ指標の推移

	2019年3月末	2020年3月末	2021年3月末	2022年3月末	2023年3月末	2023年10月末
銘柄数	12,974	14,003	14,825	15,436	15,639	15,956
額面(10億円)	956,369	972,326	1,018,210	1,056,757	1,085,263	1,112,623
時価単価(円)	109.39	108.39	106.48	104.19	101.51	96.80
利含単価(円)	109.53	108.52	106.59	104.30	101.61	96.97
残存年数(年)	9.68	9.84	9.89	10.01	10.16	10.14
利率(%)	0.95	0.89	0.83	0.79	0.77	0.77
単利(%)	0.02	0.08	0.14	0.27	0.43	0.86
複利(%)	0.02	0.08	0.14	0.27	0.43	0.83
Dur(年)	9.29	9.47	9.36	9.31	9.18	8.78
M-Dur	9.28	9.46	9.34	9.29	9.15	8.73
E-Dur	9.26	9.45	9.33	9.29	9.15	8.75
Tspd(bp)	4	5	4	3	6	5

出所:NFRC

NOMURA-BPI/Extended の定義

NOMURA-BPI/Extended の銘柄組入基準

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

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

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

累積投資収益指数の計算方法

ある時点における投資収益指数は以下の計算式から算出される。

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

$BPIE_{today}$: 当日累積投資収益指数

$BPIE_{e.l.m.}$: 前月末累積投資収益指数

$MVLt_{today}$: 当日経過利子込み時価総額

$MVLt_{e.l.m.}$: 前月末経過利子込み時価総額

$CF_{e.l.m.,today}$: 前月末から当日までのインカム収入と償還金の合計

各ポートフォリオの累積投資収益指数は以下の基準日を 100 としている。

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

ただし、

- 日付はすべて営業日ベース。
- 評価時価には JS Price(なければ野村証券評価・算定時価)を使用。
- 貸付債権担保住宅金融公庫債券 (RMBS) について、毎月 25 日に公表される翌月 10 日の償還額は NOMURA-BPI の計算上、翌月 10 日に償還金として計上する (RMBS の額面は、元利払日の 10 日に償還金の分、減ることになる)。
- 1995 年 12 月以前の指数は、NOMURA-BPI の指数と同じ。
- 「除く MBS」の 2003 年 3 月以前の指数は、NOMURA-BPI/Extended の指数と同じ。
- 「除く ABS」の 2008 年 3 月以前の指数は、NOMURA-BPI/Extended の指数と同じ。
- 「除く MBS・ABS」の 2008 年 3 月以前の指数は、「除く MBS」の指数と同じ。

投資収益率の計算方法

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

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

ただし、 $BPIE_t$ 、 $BPIE_s$ は、時点 t 、 s における累積投資収益指数。

レポートの表記等について

投資収益率 投資収益指数

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

月間投資収益率

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

ポートフォリオ指標

- 時価単価・利含単価・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 10 月ポートフォリオの、右ページには 11 月ポートフォリオの、2023 年 10 月の月末営業日における指標を掲載。

現存額

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

格付会社別ポートフォリオ指標

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

その他

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

NOMURA-BPI/Extended のデータ提供について

NOMURA-BPI/Extended のデータは以下の情報端末でもご覧いただけます。

Quick-IS

NRIJ108, NRIJ109, NRIJ110, NRIJ111
NRIJ112, NRIJ113, NRIJ114, NRIJ115

REUTERS

NMSBPI メニュー

Bloomberg

NBPI(GO) メニュー

時事通信社

BPIXG/12400

NFRC Web ページ

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

ディスクレイマー

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

「インデックス・ライセンスについて」

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

本資料は、お客様への情報提供を目的として、NFRC が作成したものです。

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

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

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

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

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

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

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