

NOMURA-BPI

月間投資収益率 (2023年11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 367.118	25.61	24.82	0.79	-3.14	0.09

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11月末)

	翌月ポート (2023年12月)	当月ポート (2023年11月)	差
額面[兆円]	1114.25	1123.24	-8.99
デュレーション[年]	9.02	8.87	0.15
修正デュレーション	8.97	8.82	0.15
時価単価[円]	98.78	98.79	0.00
利含単価[円]	99.00	99.01	0.00
残存年数[年]	10.28	10.11	0.17
利率[%]	0.77	0.77	0.01
単利[%]	0.67	0.65	0.01
複利[%]	0.65	0.64	0.01
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12月4日

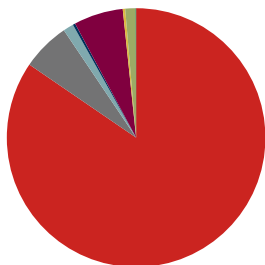
リサーチアナリスト

インデックスプロダクト

インデックス事業部 - NFRC

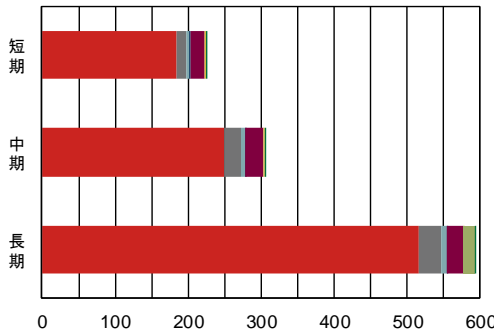
bpi@nfrc.co.jp

銘柄別額面構成 (2023年11月末)



出所: NFRC

残存別額面構成 (2023年11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%	6.0%	1.3%	0.3%	6.2%	0.3%	1.3%	0.1%
全体	949.62	67.61	14.65	3.43	69.32	3.42	14.47	0.71
短期	184.24	13.01	3.76	1.89	20.20	1.56	-	0.19
中期	248.74	23.95	4.53	1.32	25.33	1.56	-	0.30
長期	516.64	30.65	6.36	0.22	23.79	0.30	14.47	0.23

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11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	367.118	25.61	24.82	0.79	-3.14	0.09
国債	378.104	26.74	25.92	0.82	-3.46	0.02
地方債	391.217	21.27	20.67	0.59	-1.25	0.59
政保債	367.399	22.92	22.23	0.69	-2.42	0.02
金融債	273.808	7.20	7.01	0.19	-0.12	0.35
事業債	385.772	17.98	17.28	0.70	-1.36	0.52
円建外債	389.052	10.17	9.10	1.08	1.49	2.40
MBS	125.500	18.80	18.15	0.64	-1.35	-0.04
ABS	113.814	16.80	16.08	0.72	-0.59	0.73

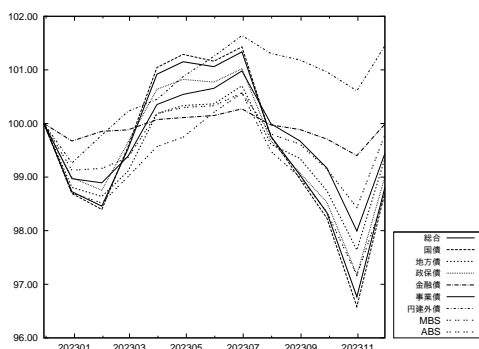
出所:NFRC
投資収益率は年率換算(%)

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
2022/11/30	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
2023/10/31	359.551	369.972	384.497	360.606	272.197	380.155	385.826	123.591	112.264
2023/11/01	359.284	369.684	384.303	360.370	272.104	379.933	385.614	123.532	112.217
2023/11/02	360.326	370.799	385.240	361.317	272.320	380.732	386.126	123.820	112.427
2023/11/06	361.594	372.171	386.264	362.460	272.540	381.659	386.610	124.142	112.650
2023/11/07	361.608	372.192	386.253	362.470	272.529	381.629	386.447	124.111	112.626
2023/11/08	362.650	373.323	387.071	363.369	272.699	382.367	386.764	124.392	112.795
2023/11/09	363.608	374.382	387.623	364.204	272.773	382.984	387.006	124.609	112.900
2023/11/10	363.042	373.771	387.171	363.710	272.718	382.561	386.742	124.455	112.808
2023/11/13	362.472	373.148	386.770	363.223	272.674	382.165	386.568	124.311	112.729
2023/11/14	363.028	373.741	387.261	363.734	272.832	382.618	386.950	124.463	112.863
2023/11/15	364.591	375.418	388.625	365.107	273.177	383.822	387.724	124.890	113.177
2023/11/16	364.570	375.378	388.736	365.105	273.236	383.865	387.852	124.940	113.216
2023/11/17	365.693	376.587	389.682	366.111	273.477	384.734	388.357	125.222	113.428
2023/11/20	366.053	376.977	389.993	366.435	273.561	384.981	388.368	125.303	113.503
2023/11/21	367.648	378.722	391.147	367.806	273.751	386.081	388.880	125.574	113.756
2023/11/22	366.351	377.306	390.234	366.654	273.581	385.156	388.621	125.271	113.571
2023/11/24	365.240	376.119	389.246	365.668	273.331	384.296	387.991	124.915	113.349
2023/11/27	365.021	375.869	389.204	365.489	273.355	384.163	388.101	124.883	113.357
2023/11/28	365.295	376.151	389.567	365.772	273.459	384.415	388.352	124.938	113.447
2023/11/29	367.395	378.416	391.358	367.608	273.818	385.925	389.306	125.495	113.843
2023/11/30	367.118	378.104	391.217	367.399	273.808	385.772	389.052	125.500	113.814

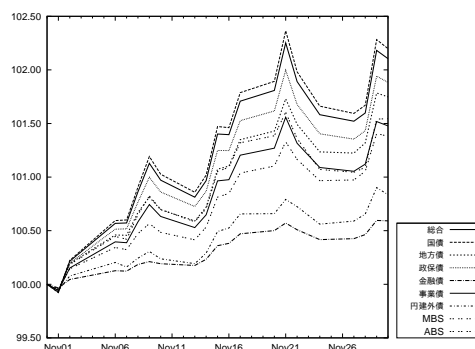
出所:NFRC
1983年12月末=100。MBSセクターは2003年3月末=100。ABSセクターは2008年3月末=100

指数の推移(月次) 2022年11月末=100に補正。



出所:NFRC

指数の推移(日次) 2023年10月末=100に補正。



出所:NFRC

総合 残存別・投資収益率(2023年11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	367.118	25.61	24.82	0.79	-3.14	0.09
短期(1-3)	235.006	2.51	2.12	0.39	-0.20	0.15
中期(3-7)	338.256	12.08	11.49	0.59	-0.55	0.63
長期(7-)	544.071	42.50	41.44	1.07	-5.60	-0.24
長期(7-11)	194.317	28.83	27.93	0.91	-2.02	0.24
超長期(11-)	243.113	50.59	49.43	1.16	-7.60	-0.53
(11-15)	227.497	41.34	40.21	1.13	-3.51	0.32
(15-)	250.919	54.06	52.88	1.17	-9.06	-0.81

出所:NFRC

投資収益率は年率換算(%)

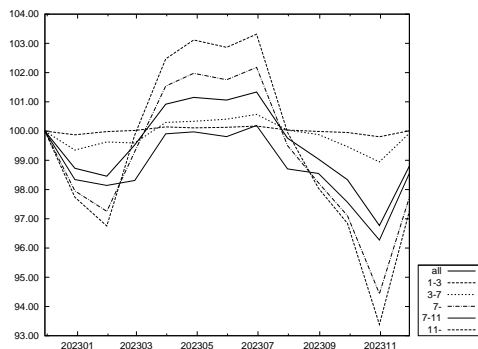
総合 残存別・投資収益指数の推移

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-)*
2022/11/30	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
2023/10/31	359.551	234.523	334.930	525.707	189.819	233.407	220.021	240.245
2023/11/01	359.284	234.498	334.716	525.149	189.740	233.070	219.907	239.815
2023/11/02	360.326	234.569	335.144	527.699	190.394	234.396	220.998	241.245
2023/11/06	361.594	234.635	335.632	530.852	191.020	236.170	222.190	243.266
2023/11/07	361.608	234.645	335.519	530.980	190.931	236.325	222.218	243.474
2023/11/08	362.650	234.707	335.859	533.618	191.408	237.842	223.173	245.230
2023/11/09	363.608	234.753	335.985	536.213	191.583	239.549	223.991	247.310
2023/11/10	363.042	234.760	335.770	534.771	191.311	238.728	223.289	246.435
2023/11/13	362.472	234.768	335.608	533.269	191.055	237.852	222.797	245.398
2023/11/14	363.028	234.814	335.963	534.512	191.429	238.458	223.324	246.039
2023/11/15	364.591	234.946	336.696	538.236	192.334	240.433	224.752	248.249
2023/11/16	364.570	234.981	336.785	538.066	192.484	240.203	224.899	247.863
2023/11/17	365.693	235.044	337.345	540.744	193.063	241.674	225.854	249.555
2023/11/20	366.053	235.067	337.510	541.611	193.226	242.169	226.238	250.097
2023/11/21	367.648	235.092	338.030	545.707	193.983	244.513	227.633	252.843
2023/11/22	366.351	235.027	337.613	542.410	193.495	242.538	226.503	250.511
2023/11/24	365.240	234.939	337.072	539.777	192.856	241.142	225.308	249.025
2023/11/27	365.021	234.931	337.156	539.082	192.867	240.642	225.147	248.384
2023/11/28	365.295	234.943	337.419	539.629	193.153	240.821	225.628	248.440
2023/11/29	367.395	235.017	338.299	544.817	194.376	243.597	227.607	251.558
2023/11/30	367.118	235.006	338.256	544.071	194.317	243.113	227.497	250.919

出所:NFRC

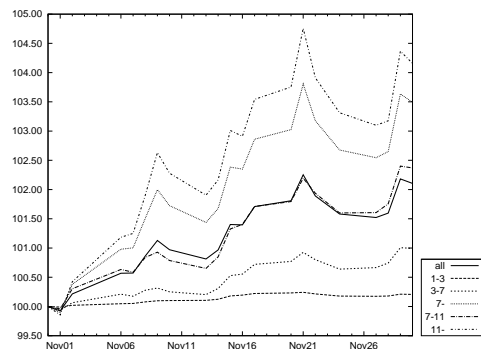
* は 1995年12月末=100。それ以外は、1983年12月末=100。

指数の推移(月次) 2022年11月末=100に補正。



出所:NFRC

指数の推移(日次) 2023年10月末=100に補正。



出所:NFRC

国債 残存別・投資収益率 (2023年11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	378.104	26.74	25.92	0.82	-3.46	0.02
短期 (1-3)	221.653	2.38	2.00	0.38	-0.27	0.09
中期 (3-7)	336.972	11.96	11.36	0.60	-0.66	0.56
長期 (7-)	555.024	43.72	42.62	1.09	-5.96	-0.29
長期 (7-11)	192.800	28.92	28.00	0.92	-2.23	0.15
超長期 (11-)	242.152	52.42	51.22	1.19	-8.02	-0.56
(11-15)	225.500	41.51	40.36	1.15	-3.57	0.34
(15-)	250.540	56.55	55.34	1.21	-9.64	-0.86

出所:NFRC

投資収益率は年率換算 (%)

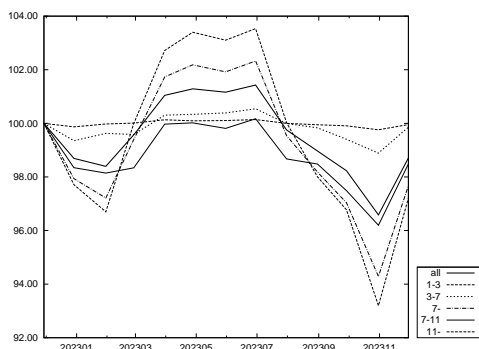
国債 残存別・投資収益指数の推移

国債 年/月/日	全体	短期 (1-3)	中期 (3-7)	長期 (7-)	長期*			
					(7-11)	超長期*	(11-15)*	(15-)*
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
2023/10/31	369.972	221.219	333.693	535.772	188.324	232.150	218.060	239.413
2023/11/01	369.684	221.197	333.479	535.176	188.245	231.797	217.946	238.958
2023/11/02	370.799	221.261	333.900	537.836	188.896	233.155	219.028	240.439
2023/11/06	372.171	221.322	334.384	541.154	189.520	234.986	220.212	242.550
2023/11/07	372.192	221.330	334.266	541.302	189.428	235.155	220.243	242.777
2023/11/08	373.323	221.387	334.602	544.083	189.902	236.725	221.192	244.614
2023/11/09	374.382	221.429	334.726	546.857	190.077	238.507	222.004	246.811
2023/11/10	373.771	221.436	334.510	545.347	189.803	237.666	221.306	245.905
2023/11/13	373.148	221.443	334.350	543.758	189.549	236.758	220.818	244.817
2023/11/14	373.741	221.486	334.703	545.058	189.921	237.382	221.345	245.485
2023/11/15	375.418	221.607	335.429	548.956	190.821	239.412	222.760	247.784
2023/11/16	375.378	221.640	335.517	548.744	190.970	239.158	222.908	247.360
2023/11/17	376.587	221.697	336.073	551.557	191.547	240.675	223.854	249.125
2023/11/20	376.977	221.717	336.236	552.475	191.709	241.190	224.243	249.694
2023/11/21	378.722	221.739	336.753	556.828	192.463	243.639	225.632	252.599
2023/11/22	377.306	221.678	336.337	553.334	191.977	241.586	224.507	250.148
2023/11/24	376.119	221.596	335.798	550.592	191.345	240.158	223.318	248.611
2023/11/27	375.869	221.587	335.882	549.840	191.357	239.631	223.159	247.929
2023/11/28	376.151	221.597	336.142	550.391	191.642	239.804	223.640	247.975
2023/11/29	378.416	221.664	337.014	555.837	192.861	242.668	225.609	251.228
2023/11/30	378.104	221.653	336.972	555.024	192.800	242.152	225.500	250.540

出所:NFRC

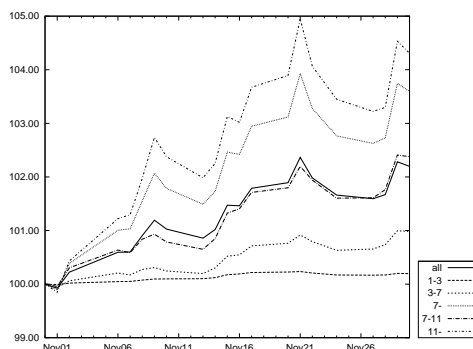
* は 1995年12月末=100。それ以外は、1983年12月末=100。

指数の推移 (月次) 2022年11月末=100に補正。



出所:NFRC

指数の推移 (日次) 2023年10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11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	367.015	25.69	24.90	0.79	-3.16	0.09
短期(1-3)	235.006	2.51	2.12	0.39	-0.20	0.15
中期(3-7)	338.256	12.08	11.49	0.59	-0.55	0.63
長期(7-)	546.187	43.11	42.03	1.08	-5.71	-0.25
長期(7-11)	194.313	28.86	27.95	0.91	-2.03	0.24
超長期(11-)	245.165	51.89	50.70	1.18	-7.84	-0.54
(11-15)	227.485	41.35	40.22	1.13	-3.52	0.32
(15-)	253.494	56.05	54.85	1.20	-9.48	-0.85

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(%)

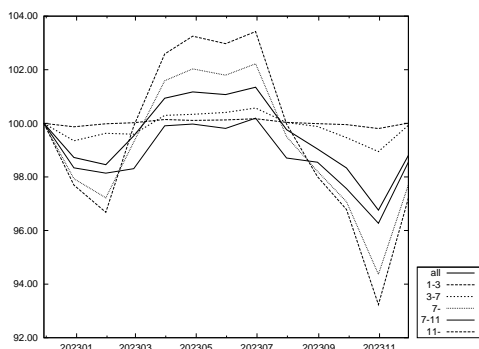
「除くMBS」残存別・投資収益指数の推移

除くMBS 年/月/日	全体	短期 (1-3)	中期 (3-7)	長期 (7-)	長期*			
					長期* (7-11)	超長期* (11-)	(11-15)*	(15-)*
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
2023/10/31	359.425	234.523	334.930	527.497	189.811	235.137	220.008	242.330
2023/11/01	359.156	234.498	334.716	526.929	189.732	234.788	219.894	241.878
2023/11/02	360.200	234.569	335.144	529.522	190.387	236.157	220.985	243.370
2023/11/06	361.473	234.635	335.632	532.732	191.013	237.991	222.177	245.489
2023/11/07	361.487	234.645	335.519	532.866	190.924	238.156	222.206	245.713
2023/11/08	362.533	234.707	335.859	535.550	191.402	239.724	223.160	247.553
2023/11/09	363.495	234.753	335.985	538.198	191.576	241.498	223.979	249.747
2023/11/10	362.927	234.760	335.770	536.730	191.304	240.648	223.277	248.831
2023/11/13	362.355	234.768	335.608	535.200	191.048	239.742	222.785	247.742
2023/11/14	362.912	234.814	335.963	536.462	191.423	240.365	223.312	248.409
2023/11/15	364.479	234.946	336.696	540.249	192.328	242.402	224.740	250.716
2023/11/16	364.455	234.981	336.785	540.068	192.478	242.157	224.887	250.299
2023/11/17	365.583	235.044	337.345	542.793	193.058	243.678	225.842	252.071
2023/11/20	365.944	235.067	337.510	543.677	193.221	244.190	226.227	252.639
2023/11/21	367.548	235.092	338.030	547.863	193.978	246.627	227.622	255.536
2023/11/22	366.247	235.027	337.613	544.503	193.490	244.579	226.492	253.084
2023/11/24	365.135	234.939	337.072	541.832	192.850	243.144	225.297	251.540
2023/11/27	364.915	234.931	337.156	541.120	192.862	242.622	225.136	250.861
2023/11/28	365.190	234.943	337.419	541.677	193.148	242.805	225.616	250.914
2023/11/29	367.295	235.017	338.299	546.955	194.372	245.673	227.596	254.176
2023/11/30	367.015	235.006	338.256	546.187	194.313	245.165	227.485	253.494

出所:NFRC

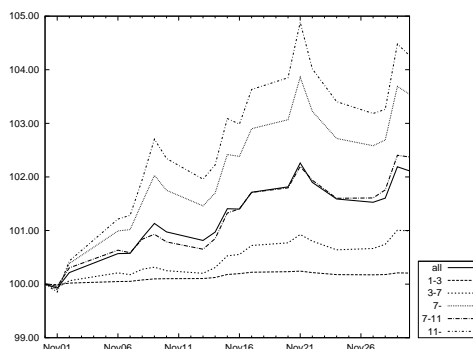
* は1995年12月末=100。それ以外は、1983年12月末=100。

指数の推移(月次) 2022年11月末=100に補正。



出所:NFRC

指数の推移(日次) 2023年10月末=100に補正。



出所:NFRC

「除く ABS」 残存別・投資収益率 (2023年11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	367.146	25.61	24.82	0.79	-3.14	0.08
短期 (1-3)	234.966	2.51	2.12	0.39	-0.20	0.15
中期 (3-7)	338.253	12.08	11.49	0.59	-0.55	0.63
長期 (7-)	544.073	42.50	41.44	1.07	-5.60	-0.24
長期 (7-11)	194.311	28.83	27.93	0.91	-2.03	0.24
超長期 (11-)	243.112	50.60	49.44	1.16	-7.60	-0.53
(11-15)	227.488	41.34	40.21	1.13	-3.52	0.32
(15-)	250.921	54.06	52.88	1.17	-9.06	-0.81

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 (%)

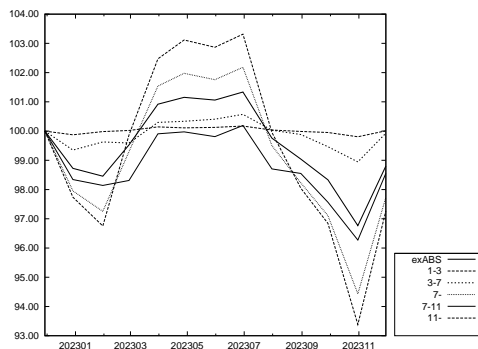
「除く ABS」 残存別 投資収益指数の推移

除く ABS 年/月/日	全体	短期 (1-3)	中期 (3-7)	長期 (7-)	長期*			
					(7-11)	超長期*	(11-15)*	(15-)*
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
2023/10/31	359.577	234.483	334.927	525.707	189.813	233.406	220.013	240.247
2023/11/01	359.309	234.458	334.713	525.149	189.734	233.068	219.899	239.817
2023/11/02	360.352	234.529	335.142	527.700	190.389	234.395	220.990	241.247
2023/11/06	361.621	234.595	335.630	530.853	191.014	236.168	222.182	243.268
2023/11/07	361.634	234.605	335.516	530.981	190.925	236.323	222.210	243.476
2023/11/08	362.677	234.667	335.856	533.619	191.402	237.840	223.165	245.232
2023/11/09	363.636	234.713	335.983	536.215	191.577	239.548	223.983	247.312
2023/11/10	363.069	234.720	335.767	534.772	191.305	238.726	223.281	246.437
2023/11/13	362.499	234.728	335.605	533.270	191.049	237.851	222.789	245.400
2023/11/14	363.055	234.774	335.961	534.513	191.424	238.457	223.316	246.042
2023/11/15	364.618	234.906	336.693	538.238	192.328	240.431	224.744	248.251
2023/11/16	364.597	234.941	336.782	538.067	192.478	240.201	224.891	247.865
2023/11/17	365.721	235.004	337.342	540.746	193.057	241.673	225.846	249.557
2023/11/20	366.081	235.027	337.508	541.613	193.220	242.167	226.230	250.099
2023/11/21	367.676	235.053	338.027	545.709	193.977	244.512	227.625	252.845
2023/11/22	366.379	234.987	337.610	542.412	193.489	242.536	226.495	250.513
2023/11/24	365.268	234.899	337.069	539.779	192.850	241.141	225.300	249.027
2023/11/27	365.048	234.891	337.154	539.084	192.861	240.641	225.139	248.386
2023/11/28	365.323	234.903	337.416	539.630	193.147	240.819	225.620	248.442
2023/11/29	367.423	234.977	338.296	544.819	194.371	243.596	227.599	251.560
2023/11/30	367.146	234.966	338.253	544.073	194.311	243.112	227.488	250.921

出所:NFRC

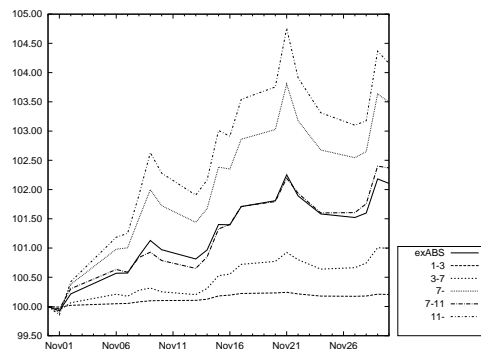
* は 1995年12月末=100。それ以外は、1983年12月末=100。

指数の推移 (月次) 2022年11月末=100に補正。



出所:NFRC

指数の推移 (日次) 2023年10月末=100に補正。



出所:NFRC

「除く国債」残存別・投資収益率(2023年11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	171.359	19.37	18.72	0.65	-1.33	0.49
短期(1-3)	134.345	3.07	2.68	0.39	0.13	0.42
中期(3-7)	167.257	12.64	12.07	0.57	-0.03	0.97
長期(7-)	235.203	34.14	33.28	0.86	-3.11	0.14
長期(7-11)	199.217	28.24	27.46	0.78	-0.74	0.79
超長期(11-)	241.047	37.81	36.89	0.91	-4.54	-0.24

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(%)

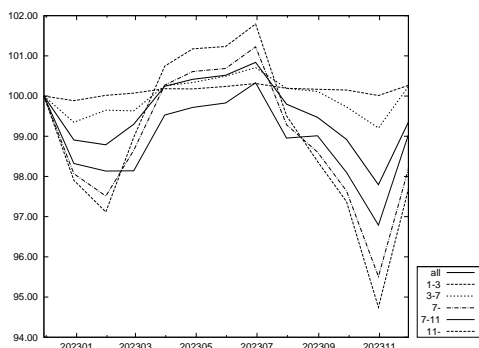
「除く国債」残存別・投資収益指数の推移

除く国債 年/月/日	全体	短期 (1-3)	中期 (3-7)	長期 (7-)	長期*	超長期*
					(7-11)	(11-)
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
2023/10/31	168.674	134.006	165.537	228.783	194.698	233.783
2023/11/01	168.582	133.988	165.433	228.620	194.621	233.571
2023/11/02	168.962	134.035	165.657	229.551	195.279	234.622
2023/11/06	169.391	134.079	165.904	230.617	195.897	235.927
2023/11/07	169.379	134.087	165.858	230.622	195.839	235.978
2023/11/08	169.723	134.127	166.033	231.496	196.318	237.069
2023/11/09	169.988	134.157	166.099	232.247	196.490	238.185
2023/11/10	169.795	134.161	165.995	231.739	196.234	237.533
2023/11/13	169.618	134.166	165.914	231.254	195.981	236.919
2023/11/14	169.826	134.195	166.091	231.698	196.354	237.376
2023/11/15	170.388	134.277	166.461	233.019	197.269	238.882
2023/11/16	170.422	134.299	166.508	233.057	197.417	238.834
2023/11/17	170.818	134.343	166.788	233.979	197.999	239.927
2023/11/20	170.938	134.360	166.874	234.255	198.165	240.262
2023/11/21	171.423	134.378	167.133	235.513	198.918	241.784
2023/11/22	171.018	134.341	166.927	234.472	198.427	240.426
2023/11/24	170.608	134.288	166.659	233.499	197.760	239.312
2023/11/27	170.568	134.285	166.702	233.325	197.766	239.018
2023/11/28	170.696	134.296	166.835	233.580	198.050	239.229
2023/11/29	171.421	134.346	167.280	235.373	199.269	241.290
2023/11/30	171.359	134.345	167.257	235.203	199.217	241.047

出所:NFRC

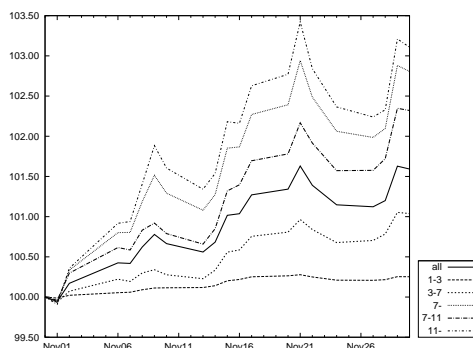
*は1995年12月末=100。それ以外は、1993年12月末=100。

指数の推移(月次) 2022年11月末=100に補正。



出所:NFRC

指数の推移(日次) 2023年10月末=100に補正。



出所:NFRC

銘柄 残存別・月間投資収益率(2023年11月末)

	全体	短期 (1-3)	中期 (3-7)	長期 (7-)	(7-11)	
					(7-11)	(11-)
総合	25.61	2.51	12.08	42.50	28.83	50.59
国債	26.74	2.38	11.96	43.72	28.92	52.42
30年国債	52.34	-	18.08	52.81	30.81	54.53
20年国債	31.60	2.64	12.99	41.25	28.99	48.89
10年国債	15.40	2.57	12.77	28.63	28.63	-
5年国債	5.71	2.68	8.81	-	-	-
中期国債	1.27	1.27	-	-	-	-
地方債	21.27	3.02	13.54	35.92	29.03	43.36
東京都債	19.90	2.75	13.22	36.74	28.43	51.12
五大都市債	22.63	3.22	13.08	37.87	28.32	42.92
その他地方債	20.67	3.07	13.63	34.87	29.23	41.37
政保債	22.92	2.36	11.54	44.91	30.18	50.73
公営企業債券	6.47	2.38	10.29	-	-	-
その他政保債	25.61	2.35	11.90	44.91	30.18	50.73
金融債	7.20	3.11	9.84	27.78	27.78	-
特定金融債	-	-	-	-	-	-
事業債	17.98	3.15	12.25	38.74	27.21	48.39
円建外債	10.17	4.12	10.38	42.49	27.19	61.33
MBS	18.80	-	-	18.80	6.38	19.00
ABS	16.80	3.10	13.26	34.14	27.70	46.30

出所:NFRC

「除く(銘柄)」残存別・月間投資収益率(2023年11月末)

	全体	短期 (1-3)	中期 (3-7)	長期 (7-)	(7-11)	
					(7-11)	(11-)
除く国債	19.37	3.07	12.64	34.14	28.24	37.81
除く30年国債	20.94	2.51	12.04	38.35	28.72	47.70
除く20年国債	23.45	2.49	11.84	43.20	28.74	51.51
除く10年国債	29.23	2.48	11.61	45.24	28.99	50.59
除く5年国債	28.02	2.45	12.85	42.50	28.83	50.59
除く中期国債	26.36	2.72	12.08	42.50	28.83	50.59
除く地方債	25.88	2.48	11.96	42.86	28.82	50.89
除く東京都債	25.63	2.51	12.08	42.52	28.83	50.59
除く五大都市債	25.62	2.50	12.08	42.52	28.83	50.64
除くその他地方債	25.82	2.48	12.00	42.78	28.81	50.84
除く政保債	25.64	2.51	12.09	42.47	28.82	50.59
除く公営企業債券	25.64	2.51	12.09	42.50	28.83	50.59
除くその他政保債	25.61	2.51	12.08	42.47	28.82	50.59
除く金融債	25.66	2.50	12.09	42.51	28.83	50.59
除く特定金融債	25.61	2.51	12.08	42.50	28.83	50.59
除く事業債	26.10	2.44	12.07	42.65	28.91	50.67
除く円建外債	25.65	2.50	12.09	42.50	28.83	50.59
除くMBS	25.69	2.51	12.08	43.11	28.86	51.89
除くABS	25.61	2.51	12.08	42.50	28.83	50.60
除くMBS・ABS	25.70	2.51	12.08	43.11	28.86	51.89

出所:NFRC

- ・月間投資収益率とは、前月末～今月末までの投資収益率を年率換算(%)。
- ・「除く(銘柄)」とは、NOMURA-BPI/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11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	17.98	3.15	12.25	38.74	27.21	48.39
水産・農林業	11.88	-	11.88	-	-	-
鉱業	17.85	3.79	-	25.29	25.29	-
建設業	11.63	3.04	11.80	33.58	28.69	41.62
食料品	11.83	3.51	10.54	29.22	24.09	37.18
繊維製品	11.23	2.43	10.51	47.97	-	47.97
パルプ・紙	12.51	2.64	11.28	35.48	25.08	49.83
化学	14.44	2.68	12.11	33.22	27.49	41.28
医薬品	15.32	4.65	12.41	22.03	13.66	45.60
石油・石炭製品	19.55	3.03	14.92	32.26	29.06	49.53
ゴム製品	12.03	4.33	12.01	28.37	28.37	-
ガラス・土石製品	15.42	3.07	11.15	30.43	28.28	37.14
鉄鋼	9.04	3.00	12.73	29.45	29.45	-
非鉄金属	11.86	3.37	9.85	29.02	29.02	-
金属製品	9.85	2.78	11.69	31.26	31.26	-
機械	12.65	3.41	12.15	29.67	29.67	-
電気機器	11.20	3.37	13.26	28.91	28.91	-
輸送用機器	10.77	3.25	9.77	29.87	25.70	38.14
精密機器	12.80	2.19	15.29	29.04	29.04	-
その他製品	19.25	3.01	15.35	39.21	26.31	44.06
電気・ガス業	20.35	2.94	12.65	37.38	28.03	47.24
陸運業	25.70	2.47	12.07	38.99	24.87	46.21
海運業	12.97	4.31	13.37	23.04	23.04	-
空運業	22.05	4.59	12.59	44.13	31.62	47.63
倉庫・運輸関連業	17.25	1.79	16.76	39.49	28.30	49.88
情報・通信業	13.14	4.04	13.39	34.21	30.68	44.28
卸売業	16.20	2.70	12.86	29.73	23.94	40.30
小売業	8.32	3.09	9.65	30.15	25.15	38.61
銀行業	8.73	3.54	13.29	26.74	26.74	-
証券・商品先物取引業	5.32	3.71	10.03	31.18	31.18	-
保険業	11.16	5.77	10.23	31.22	31.22	-
その他金融業	9.48	3.01	12.21	27.13	25.32	41.91
不動産業	19.24	2.82	12.24	34.20	26.71	44.84
サービス業	18.38	4.62	22.26	43.03	42.37	45.40
財投機関債	22.55	2.99	11.74	44.29	28.22	51.11

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11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	17.60	3.22	12.14	38.79	27.21	48.53
AAA～A格	17.73	3.22	12.13	38.82	27.22	48.53
AAA～AA格	19.29	3.15	12.05	40.38	27.07	49.80
AAA格	12.66	3.03	11.97	35.38	26.41	51.28
AA格	21.04	3.19	12.08	40.99	27.20	49.70
A格	14.23	3.36	12.30	33.67	27.57	42.51
BBB格	9.54	3.23	12.80	33.31	25.87	48.08
事業債全体	17.98	3.15	12.25	38.74	27.21	48.39
AAA～A格	18.05	3.15	12.24	38.76	27.22	48.39
AAA～AA格	19.53	3.12	12.12	40.42	27.07	49.80
AAA格	12.66	3.03	11.97	35.38	26.41	51.28
AA格	21.41	3.15	12.17	41.03	27.21	49.70
A格	14.49	3.21	12.51	33.08	27.55	41.32
BBB格	10.32	3.31	12.88	33.44	26.40	50.13
円建外債全体	10.17	4.12	10.38	42.49	27.19	61.33
AAA～A格	10.45	4.36	10.23	44.58	27.70	64.05
AAA～AA格	8.54	4.02	10.12	28.18	26.79	46.62
AAA格	-	-	-	-	-	-
AA格	8.54	4.02	10.12	28.18	26.79	46.62
A格	11.55	4.55	10.30	49.61	28.33	64.69
BBB格	8.49	3.15	12.58	33.18	25.23	46.33

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11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	19.53	3.12	12.12	40.42	27.07	49.80
AAA~A格	18.05	3.15	12.24	38.76	27.22	48.39
AAA~BBB格	17.98	3.15	12.25	38.74	27.21	48.39
AAA~BB格	17.98	3.15	12.25	38.74	27.21	48.39
AAA格	12.66	3.03	11.97	35.38	26.41	51.28
AA格	21.41	3.15	12.17	41.03	27.21	49.70
A格	14.49	3.21	12.51	33.08	27.55	41.32
BBB格	10.32	3.31	12.88	33.44	26.40	50.13
BB格	-	-	-	-	-	-
B格以下	-	-	-	-	-	-
格付なし	-	-	-	-	-	-
円建外債						
AAA~AA格	8.54	4.02	10.12	28.18	26.79	46.62
AAA~A格	10.45	4.36	10.23	44.58	27.70	64.05
AAA~BBB格	10.17	4.12	10.38	42.49	27.19	61.33
AAA~BB格	10.17	4.12	10.38	42.49	27.19	61.33
AAA格	-	-	-	-	-	-
AA格	8.54	4.02	10.12	28.18	26.79	46.62
A格	11.55	4.55	10.30	49.61	28.33	64.69
BBB格	8.49	3.15	12.58	33.18	25.23	46.33
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11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	16.91	3.05	11.62	39.99	28.07	48.73
AAA~A格	18.22	3.14	12.16	38.82	27.18	48.38
AAA~BBB格	17.98	3.15	12.23	38.74	27.21	48.40
AAA~BB格	17.98	3.15	12.25	38.74	27.21	48.39
AAA格	-	-	-	-	-	-
AA格	16.91	3.05	11.62	39.99	28.07	48.73
A格	18.44	3.15	12.26	38.66	27.06	48.32
BBB格	14.08	3.33	13.29	36.77	27.94	49.40
BB格	16.81	-	14.38	40.12	-	40.12
B格以下	-	-	-	-	-	-
格付なし	-	-	-	-	-	-
円建外債						
AAA~AA格	7.46	3.66	10.45	26.92	26.92	-
AAA~A格	10.26	4.59	10.38	51.70	27.08	84.42
AAA~BBB格	10.17	4.12	10.38	42.49	27.19	61.33
AAA~BB格	10.17	4.12	10.38	42.49	27.19	61.33
AAA格	-	-	-	-	-	-
AA格	7.46	3.66	10.45	26.92	26.92	-
A格	10.81	4.79	10.37	54.74	27.12	84.42
BBB格	10.08	3.50	10.38	35.82	27.27	45.77
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11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	20.83	3.06	11.93	41.88	27.85	50.13
AAA~A 格	18.40	3.12	12.11	39.11	27.15	48.68
AAA~BBB 格	18.34	3.13	12.11	39.10	27.15	48.67
AAA~BB 格	18.34	3.13	12.11	39.10	27.15	48.67
AAA 格	10.37	3.13	8.85	28.50	25.89	40.72
AA 格	21.06	3.06	12.00	42.04	27.90	50.16
A 格	15.03	3.19	12.34	33.67	26.28	44.32
BBB 格	13.03	3.57	12.17	38.07	27.17	47.49
BB 格	-	-	-	-	-	-
B 格以下	-	-	-	-	-	-
格付なし	14.23	3.34	13.44	33.08	27.96	41.71
円建外債						
AAA~AA 格	3.40	3.40	-	-	-	-
AAA~A 格	7.59	3.82	10.15	27.68	27.68	-
AAA~BBB 格	7.72	3.64	10.15	31.84	27.68	43.36
AAA~BB 格	7.72	3.64	10.15	31.84	27.68	43.36
AAA 格	-	-	-	-	-	-
AA 格	3.40	3.40	-	-	-	-
A 格	7.91	3.89	10.15	27.68	27.68	-
BBB 格	10.16	1.52	-	43.36	-	43.36
BB 格	-	-	-	-	-	-
B 格以下	-	-	-	-	-	-
格付なし	11.07	4.32	10.47	44.06	27.09	62.81

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、R&Iの格付をもとにNFRCで分類

事業債 円建外債 JCR 格付別・月間投資収益率(2023年11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	14.82	3.14	11.97	35.28	26.09	48.34
AAA~A 格	14.94	3.23	12.25	34.16	26.41	45.39
AAA~BBB 格	14.90	3.22	12.27	34.16	26.41	45.41
AAA~BB 格	14.90	3.22	12.27	34.16	26.41	45.41
AAA 格	12.92	3.04	12.06	35.38	26.41	51.28
AA 格	15.91	3.21	11.91	35.24	25.96	47.46
A 格	15.21	3.45	12.89	31.88	27.04	39.18
BBB 格	10.78	2.82	13.50	35.91	26.65	50.13
BB 格	-	-	-	-	-	-
B 格以下	-	-	-	-	-	-
格付なし	22.28	3.02	12.22	42.83	28.49	50.02
円建外債						
AAA~AA 格	9.57	3.55	8.42	29.70	25.89	46.62
AAA~A 格	14.04	4.68	10.02	52.22	27.77	66.86
AAA~BBB 格	14.05	4.68	10.04	52.22	27.77	66.86
AAA~BB 格	14.05	4.68	10.04	52.22	27.77	66.86
AAA 格	-	-	-	-	-	-
AA 格	9.57	3.55	8.42	29.70	25.89	46.62
A 格	15.23	4.79	10.87	55.68	28.53	67.68
BBB 格	16.74	-	16.74	-	-	-
BB 格	-	-	-	-	-	-
B 格以下	-	-	-	-	-	-
格付なし	8.40	3.90	10.53	30.57	26.85	42.99

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、JCRの格付をもとにNFRCで分類

事業債 円建外債 Moody's 格付別・月間投資収益率(2023年11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	20.58	3.08	11.55	42.33	28.34	50.31
AAA~BBB格	20.13	3.09	11.90	41.99	28.36	50.27
AAA~BB格	20.13	3.09	11.90	41.99	28.36	50.27
AAA格	-	-	-	-	-	-
AA格	-	-	-	-	-	-
A格	20.58	3.08	11.55	42.33	28.34	50.31
BBB格	16.35	3.18	14.02	37.49	28.60	49.44
BB格	-	-	-	-	-	-
B格以下	-	-	-	-	-	-
格付なし	16.71	3.18	12.44	36.46	26.61	46.70
円建外債						
AAA~AA格	8.23	4.04	10.75	26.86	26.86	-
AAA~A格	10.58	4.64	10.24	49.72	27.30	76.63
AAA~BBB格	10.69	4.12	10.41	42.93	27.26	61.33
AAA~BB格	10.69	4.12	10.41	42.93	27.26	61.33
AAA格	-	-	-	-	-	-
AA格	8.23	4.04	10.75	26.86	26.86	-
A格	13.04	5.28	9.61	59.49	27.83	76.63
BBB格	10.86	3.16	10.63	36.50	27.23	47.17
BB格	-	-	-	-	-	-
B格以下	-	-	-	-	-	-
格付なし	6.48	4.09	10.07	25.67	25.67	-

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11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	37.76	3.41	13.63	43.45	29.42	52.39
AAA~A格	21.33	3.01	12.96	39.56	27.40	49.99
AAA~BBB格	20.73	3.05	12.88	39.40	27.37	49.97
AAA~BB格	20.68	3.05	12.93	39.41	27.37	49.90
AAA格	-	-	-	-	-	-
AA格	37.76	3.41	13.63	43.45	29.42	52.39
A格	20.56	3.00	12.95	39.17	27.23	49.72
BBB格	8.66	3.41	11.24	27.64	26.20	39.28
BB格	16.81	-	14.38	40.12	-	40.12
B格以下	-	-	-	-	-	-
格付なし	17.10	3.18	12.04	38.46	27.15	47.77
円建外債						
AAA~AA格	8.94	4.18	10.52	26.92	26.92	-
AAA~A格	11.11	5.06	10.28	52.16	27.15	84.42
AAA~BBB格	10.62	4.28	10.37	42.62	27.22	61.33
AAA~BB格	10.62	4.28	10.37	42.62	27.22	61.33
AAA格	-	-	-	-	-	-
AA格	8.94	4.18	10.52	26.92	26.92	-
A格	11.44	5.18	10.24	55.31	27.20	84.42
BBB格	10.15	3.48	10.46	35.82	27.27	45.77
BB格	-	-	-	-	-	-
B格以下	-	-	-	-	-	-
格付なし	3.69	3.02	11.48	24.88	24.88	-

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11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	1,123,238	98.79	99.01	10.11	0.77	0.65	0.64	8.87	8.82	8.83	5
短期(1-3)	224,839	100.59	100.71	1.88	0.39	0.07	0.07	1.88	1.88	1.88	6
中期(3-7)	305,739	101.53	101.72	4.70	0.60	0.28	0.28	4.63	4.63	4.63	6
長期(7-)	592,661	96.69	96.97	16.01	1.00	1.09	1.07	13.91	13.82	13.84	4
長期(7-11)	205,469	102.63	102.90	8.64	0.91	0.61	0.62	8.31	8.28	8.30	5
超長期(11-)	387,192	93.53	93.81	19.92	1.05	1.36	1.33	17.17	17.05	17.06	4
(11-15)	96,447	101.45	101.77	12.85	1.11	0.97	0.97	11.95	11.90	11.93	4
(15-)	290,745	90.91	91.17	22.27	1.02	1.51	1.46	19.10	18.96	18.95	4
国債	949,624	98.95	99.18	10.59	0.79	0.64	0.63	9.25	9.20	9.21	1
短期(1-3)	184,239	100.69	100.81	1.86	0.39	0.02	0.01	1.85	1.85	1.85	0
中期(3-7)	248,744	101.86	102.05	4.69	0.60	0.22	0.22	4.62	4.61	4.62	0
長期(7-)	516,641	96.92	97.21	16.54	1.03	1.08	1.06	14.32	14.24	14.25	1
長期(7-11)	177,658	103.16	103.45	8.66	0.94	0.57	0.58	8.32	8.30	8.32	1
超長期(11-)	338,984	93.65	93.95	20.67	1.08	1.38	1.33	17.79	17.66	17.67	1
(11-15)	84,559	102.20	102.54	12.88	1.14	0.93	0.94	11.97	11.92	11.95	1
(15-)	254,425	90.80	91.09	23.26	1.05	1.55	1.48	19.97	19.82	19.81	1
地方債	67,609	98.69	98.83	7.46	0.58	0.58	0.59	6.96	6.93	6.93	14
短期(1-3)	13,008	100.43	100.53	2.00	0.39	0.14	0.14	2.00	1.99	2.00	12
中期(3-7)	23,954	100.51	100.64	4.94	0.50	0.37	0.38	4.87	4.87	4.87	13
長期(7-)	30,646	96.52	96.69	11.75	0.72	0.94	0.97	10.84	10.78	10.79	14
政保債	14,651	98.29	98.44	9.08	0.68	0.64	0.62	7.97	7.93	7.94	10
短期(1-3)	3,759	100.18	100.22	1.82	0.24	0.10	0.10	1.81	1.81	1.81	10
中期(3-7)	4,531	100.98	101.12	4.53	0.49	0.31	0.31	4.48	4.47	4.48	10
長期(7-)	6,361	95.25	95.49	16.60	1.07	1.22	1.17	14.43	14.33	14.36	11
金融債	3,431	99.31	99.36	3.19	0.19	0.36	0.36	3.16	3.15	3.16	25
短期(1-3)	1,889	99.71	99.74	2.04	0.12	0.25	0.25	2.04	2.03	2.04	23
中期(3-7)	1,322	99.30	99.36	4.02	0.25	0.42	0.42	4.00	3.99	4.00	26
長期(7-)	220	96.04	96.17	8.10	0.40	0.93	0.92	7.96	7.92	7.95	39
事業債	69,317	97.17	97.36	7.64	0.68	0.87	0.85	6.66	6.62	6.64	44
短期(1-3)	20,196	99.97	100.09	2.03	0.40	0.41	0.41	2.02	2.02	2.02	39
中期(3-7)	25,333	99.71	99.88	4.74	0.63	0.68	0.67	4.66	4.64	4.66	45
長期(7-)	23,787	92.09	92.34	15.48	0.96	1.53	1.45	13.24	13.14	13.16	49
長期(7-11)	10,138	97.56	97.79	8.58	0.84	1.17	1.14	8.26	8.21	8.26	57
超長期(11-)	13,649	88.03	88.29	20.60	1.04	1.83	1.71	17.35	17.19	17.20	43
円建外債	3,421	98.94	99.26	3.84	1.07	1.27	1.26	3.65	3.62	3.65	110
短期(1-3)	1,560	100.04	100.39	1.97	1.09	1.06	1.06	1.94	1.93	1.94	105
中期(3-7)	1,558	98.47	98.73	4.29	0.92	1.29	1.28	4.20	4.17	4.20	109
長期(7-)	304	95.76	96.12	11.12	1.74	2.26	2.21	9.91	9.80	9.88	144
長期(7-11)	167	95.31	95.64	8.77	1.26	1.91	1.86	8.27	8.19	8.26	128
超長期(11-)	137	96.31	96.71	13.99	2.33	2.69	2.62	11.89	11.74	11.83	164
MBS	14,471	96.99	97.03	7.01	0.63	0.74	0.96	6.63	6.60	6.66	20
ABS	714	97.07	97.23	5.97	0.69	1.00	0.97	5.58	5.54	5.57	65
短期(1-3)	187	100.10	100.25	1.93	0.69	0.61	0.61	1.92	1.91	1.92	60
中期(3-7)	297	98.83	99.00	4.87	0.68	0.88	0.88	4.77	4.75	4.77	64
長期(7-)	230	92.34	92.50	10.69	0.72	1.49	1.42	9.91	9.84	9.89	71

出所:NFRIC

「除く」銘柄 残存別・ポートフォリオ指標 (2023年11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	1,108,767	98.81	99.03	10.15	0.77	0.65	0.64	8.89	8.85	8.86	5
短期 (1-3)	224,839	100.59	100.71	1.88	0.39	0.07	0.07	1.88	1.88	1.88	6
中期 (3-7)	305,739	101.53	101.72	4.70	0.60	0.28	0.28	4.63	4.63	4.63	6
長期 (7-)	578,189	96.68	96.96	16.24	1.01	1.10	1.07	14.09	14.01	14.02	4
長期 (7-11)	205,249	102.63	102.91	8.65	0.91	0.61	0.62	8.31	8.29	8.31	5
超長期 (11-)	372,941	93.40	93.69	20.41	1.06	1.39	1.34	17.59	17.46	17.47	3
(11-15)	96,422	101.45	101.77	12.85	1.11	0.97	0.97	11.96	11.90	11.94	4
(15-)	276,518	90.60	90.88	23.05	1.04	1.55	1.48	19.78	19.63	19.63	3
除く ABS	1,122,524	98.79	99.01	10.11	0.77	0.65	0.64	8.87	8.82	8.83	5
短期 (1-3)	224,652	100.59	100.71	1.88	0.39	0.07	0.07	1.88	1.88	1.88	6
中期 (3-7)	305,442	101.54	101.72	4.70	0.60	0.28	0.28	4.63	4.63	4.63	6
長期 (7-)	592,431	96.69	96.97	16.01	1.00	1.09	1.07	13.91	13.83	13.84	4
長期 (7-11)	205,324	102.63	102.91	8.64	0.91	0.61	0.62	8.31	8.28	8.30	5
超長期 (11-)	387,106	93.53	93.82	19.92	1.05	1.36	1.33	17.17	17.05	17.06	4
(11-15)	96,390	101.46	101.78	12.85	1.11	0.97	0.97	11.95	11.90	11.93	4
(15-)	290,717	90.91	91.18	22.27	1.02	1.51	1.46	19.10	18.96	18.95	4
除く MBS・ABS	1,108,053	98.81	99.04	10.15	0.77	0.65	0.64	8.90	8.85	8.86	5
短期 (1-3)	224,652	100.59	100.71	1.88	0.39	0.07	0.07	1.88	1.88	1.88	6
中期 (3-7)	305,442	101.54	101.72	4.70	0.60	0.28	0.28	4.63	4.63	4.63	6
長期 (7-)	577,959	96.68	96.97	16.24	1.01	1.10	1.07	14.09	14.01	14.02	4
長期 (7-11)	205,104	102.63	102.91	8.65	0.91	0.61	0.62	8.31	8.29	8.31	5
超長期 (11-)	372,855	93.40	93.69	20.41	1.06	1.39	1.34	17.59	17.46	17.47	3
(11-15)	96,365	101.46	101.78	12.85	1.11	0.97	0.97	11.96	11.90	11.94	4
(15-)	276,490	90.60	90.88	23.05	1.04	1.55	1.48	19.78	19.63	19.63	3
除く 国債	173,614	97.92	98.07	7.47	0.63	0.73	0.74	6.75	6.72	6.73	28
短期 (1-3)	40,599	100.13	100.24	2.00	0.40	0.31	0.31	1.99	1.99	1.99	29
中期 (3-7)	56,995	100.10	100.25	4.78	0.56	0.53	0.53	4.71	4.70	4.71	30
長期 (7-)	76,020	95.10	95.28	12.40	0.81	1.11	1.14	11.04	10.97	10.99	27
長期 (7-11)	27,811	99.21	99.41	8.51	0.76	0.88	0.87	8.23	8.19	8.22	31
超長期 (11-)	48,209	92.73	92.89	14.65	0.83	1.26	1.30	12.78	12.68	12.70	24

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。

銘柄残存別・ポートフォリオ指標(2023年11月末、12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	1,114,250	98.78	99.00	10.28	0.77	0.67	0.65	9.02	8.97	8.98	5
短期(1-3)	227,878	100.62	100.74	2.08	0.38	0.08	0.08	2.07	2.07	2.07	5
中期(3-7)	301,258	101.61	101.80	4.94	0.62	0.30	0.30	4.85	4.85	4.85	6
長期(7-)	585,114	96.61	96.89	16.22	1.01	1.10	1.08	14.08	13.99	14.01	4
長期(7-11)	201,477	102.77	103.05	8.84	0.94	0.63	0.64	8.48	8.46	8.48	5
超長期(11-)	383,636	93.38	93.65	20.09	1.04	1.38	1.34	17.32	17.19	17.20	4
(11-15)	94,178	100.70	101.00	13.05	1.07	0.99	0.99	12.17	12.11	12.14	5
(15-)	289,459	91.00	91.26	22.38	1.04	1.52	1.46	19.17	19.03	19.02	4
国債	941,348	98.94	99.18	10.77	0.80	0.65	0.64	9.41	9.36	9.37	1
短期(1-3)	187,434	100.73	100.85	2.07	0.38	0.03	0.03	2.06	2.06	2.06	0
中期(3-7)	244,683	101.96	102.15	4.94	0.63	0.24	0.25	4.86	4.86	4.86	0
長期(7-)	509,231	96.83	97.13	16.77	1.04	1.10	1.07	14.52	14.43	14.44	1
長期(7-11)	173,815	103.32	103.62	8.88	0.96	0.59	0.60	8.51	8.48	8.50	1
超長期(11-)	335,416	93.47	93.77	20.86	1.07	1.39	1.34	17.96	17.83	17.83	1
(11-15)	82,363	101.39	101.70	13.11	1.09	0.95	0.96	12.20	12.15	12.18	1
(15-)	253,054	90.90	91.18	23.39	1.07	1.55	1.48	20.04	19.89	19.88	1
地方債	67,589	98.69	98.83	7.56	0.58	0.59	0.60	7.05	7.02	7.03	14
短期(1-3)	13,117	100.44	100.54	2.13	0.38	0.15	0.15	2.12	2.12	2.12	12
中期(3-7)	23,982	100.48	100.60	5.07	0.50	0.39	0.39	5.00	4.99	5.00	13
長期(7-)	30,489	96.53	96.70	11.86	0.73	0.95	0.98	10.93	10.87	10.88	14
政保債	14,366	98.25	98.40	9.28	0.68	0.65	0.64	8.16	8.11	8.13	10
短期(1-3)	3,529	100.13	100.17	1.96	0.22	0.11	0.11	1.96	1.96	1.96	10
中期(3-7)	4,516	101.07	101.20	4.64	0.51	0.32	0.32	4.58	4.57	4.58	10
長期(7-)	6,321	95.18	95.42	16.68	1.07	1.22	1.18	14.50	14.40	14.43	11
金融債	3,409	99.31	99.36	3.29	0.20	0.37	0.37	3.25	3.24	3.25	25
短期(1-3)	1,913	99.68	99.71	2.14	0.12	0.26	0.26	2.14	2.14	2.14	23
中期(3-7)	1,290	99.24	99.30	4.18	0.27	0.44	0.44	4.15	4.14	4.15	26
長期(7-)	206	96.24	96.38	8.32	0.45	0.95	0.94	8.15	8.12	8.15	39
事業債	68,908	97.17	97.35	7.77	0.69	0.88	0.85	6.78	6.74	6.75	44
短期(1-3)	20,214	99.94	100.05	2.16	0.41	0.41	0.41	2.15	2.15	2.15	38
中期(3-7)	24,894	99.76	99.92	4.85	0.64	0.67	0.67	4.77	4.75	4.77	44
長期(7-)	23,800	92.11	92.36	15.57	0.97	1.54	1.46	13.32	13.21	13.24	49
長期(7-11)	10,151	97.63	97.86	8.68	0.86	1.18	1.15	8.35	8.30	8.34	57
超長期(11-)	13,649	88.01	88.27	20.70	1.05	1.84	1.72	17.42	17.27	17.27	43
円建外債	3,384	98.95	99.26	4.03	1.09	1.28	1.27	3.83	3.80	3.83	110
短期(1-3)	1,465	100.02	100.37	2.17	1.11	1.08	1.08	2.14	2.13	2.14	105
中期(3-7)	1,617	98.57	98.83	4.37	0.95	1.29	1.28	4.27	4.24	4.27	108
長期(7-)	303	95.83	96.19	11.18	1.75	2.25	2.20	9.96	9.85	9.93	143
長期(7-11)	166	95.44	95.76	8.86	1.27	1.89	1.85	8.35	8.27	8.34	126
超長期(11-)	137	96.31	96.71	13.99	2.33	2.69	2.62	11.89	11.74	11.83	164
MBS	14,533	97.01	97.05	7.05	0.63	0.75	0.96	6.67	6.63	6.69	20
ABS	713	97.06	97.22	6.00	0.69	1.00	0.98	5.61	5.57	5.60	65
短期(1-3)	206	100.21	100.38	2.11	0.71	0.61	0.61	2.09	2.09	2.09	59
中期(3-7)	277	98.65	98.79	5.00	0.65	0.91	0.90	4.91	4.89	4.91	65
長期(7-)	230	92.34	92.50	10.69	0.72	1.49	1.42	9.91	9.84	9.89	71

出所:NFRIC

「除く」銘柄 残存別・ポートフォリオ指標 (2023年11月末、12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	1,099,717	98.81	99.03	10.32	0.78	0.66	0.65	9.05	9.00	9.01	5
短期 (1-3)	227,878	100.62	100.74	2.08	0.38	0.08	0.08	2.07	2.07	2.07	5
中期 (3-7)	301,258	101.61	101.80	4.94	0.62	0.30	0.30	4.85	4.85	4.85	6
長期 (7-)	570,580	96.60	96.89	16.45	1.02	1.11	1.08	14.27	14.18	14.19	4
長期 (7-11)	201,258	102.77	103.05	8.85	0.94	0.63	0.64	8.49	8.46	8.49	5
超長期 (11-)	369,323	93.24	93.52	20.59	1.06	1.40	1.35	17.74	17.62	17.62	3
(11-15)	94,153	100.70	101.00	13.06	1.07	0.99	0.99	12.17	12.11	12.15	5
(15-)	275,170	90.69	90.97	23.17	1.06	1.56	1.49	19.86	19.71	19.70	3
除く ABS	1,113,537	98.78	99.00	10.28	0.77	0.67	0.65	9.02	8.97	8.98	5
短期 (1-3)	227,672	100.62	100.74	2.08	0.38	0.08	0.08	2.07	2.07	2.07	5
中期 (3-7)	300,981	101.61	101.80	4.94	0.62	0.30	0.30	4.85	4.85	4.85	6
長期 (7-)	584,884	96.61	96.89	16.22	1.01	1.10	1.08	14.08	14.00	14.01	4
長期 (7-11)	201,333	102.77	103.06	8.85	0.94	0.63	0.64	8.48	8.46	8.48	5
超長期 (11-)	383,551	93.38	93.65	20.09	1.04	1.38	1.34	17.32	17.19	17.20	4
(11-15)	94,120	100.71	101.00	13.05	1.07	0.99	0.99	12.17	12.11	12.14	5
(15-)	289,431	91.00	91.26	22.38	1.04	1.52	1.46	19.17	19.03	19.02	4
除く MBS・ABS	1,099,004	98.81	99.03	10.32	0.78	0.66	0.65	9.05	9.00	9.01	5
短期 (1-3)	227,672	100.62	100.74	2.08	0.38	0.08	0.08	2.07	2.07	2.07	5
中期 (3-7)	300,981	101.61	101.80	4.94	0.62	0.30	0.30	4.85	4.85	4.85	6
長期 (7-)	570,350	96.60	96.89	16.45	1.02	1.11	1.08	14.27	14.18	14.19	4
長期 (7-11)	201,113	102.78	103.06	8.85	0.94	0.63	0.64	8.49	8.46	8.49	5
超長期 (11-)	369,237	93.24	93.52	20.59	1.06	1.40	1.35	17.74	17.62	17.62	3
(11-15)	94,095	100.71	101.00	13.06	1.07	0.99	0.99	12.17	12.11	12.15	5
(15-)	275,142	90.69	90.97	23.17	1.06	1.56	1.49	19.86	19.71	19.70	3
除く 国債	172,902	97.92	98.07	7.58	0.64	0.73	0.74	6.86	6.82	6.84	28
短期 (1-3)	40,444	100.11	100.22	2.13	0.40	0.32	0.32	2.12	2.12	2.12	29
中期 (3-7)	56,575	100.11	100.26	4.90	0.57	0.54	0.54	4.82	4.81	4.82	30
長期 (7-)	75,882	95.11	95.28	12.49	0.82	1.12	1.14	11.11	11.04	11.06	27
長期 (7-11)	27,662	99.28	99.48	8.63	0.78	0.89	0.88	8.33	8.29	8.32	31
超長期 (11-)	48,220	92.72	92.88	14.70	0.84	1.26	1.30	12.82	12.73	12.74	24

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11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	69,317	97.17	97.36	7.64	0.68	0.87	0.85	6.66	6.62	6.64	44
短期 (1-3)	20,196	99.97	100.09	2.03	0.40	0.41	0.41	2.02	2.02	2.02	39
中期 (3-7)	25,333	99.71	99.88	4.74	0.63	0.68	0.67	4.66	4.64	4.66	45
長期 (7-)	23,787	92.09	92.34	15.48	0.96	1.53	1.45	13.24	13.14	13.16	49
長期 (7-11)	10,138	97.56	97.79	8.58	0.84	1.17	1.14	8.26	8.21	8.26	57
超長期 (11-)	13,649	88.03	88.29	20.60	1.04	1.83	1.71	17.35	17.19	17.20	43
水産・農林業	18	99.79	99.96	4.52	0.78	0.83	0.83	4.44	4.42	4.44	62
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	18	99.79	99.96	4.52	0.78	0.83	0.83	4.44	4.42	4.44	62
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
鉱業	30	96.79	96.82	5.82	0.21	0.72	0.71	5.72	5.69	5.72	38
短期 (1-3)	10	99.36	99.38	2.29	0.08	0.36	0.36	2.29	2.28	2.29	33
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	20	95.50	95.55	7.58	0.28	0.91	0.89	7.50	7.47	7.50	41
長期 (7-11)	20	95.50	95.55	7.58	0.28	0.91	0.89	7.50	7.47	7.50	41
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
建設業	1,257	98.55	98.69	4.64	0.40	0.61	0.60	4.48	4.46	4.48	38
短期 (1-3)	400	99.81	99.89	2.02	0.24	0.32	0.32	2.02	2.01	2.02	30
中期 (3-7)	692	98.99	99.12	4.61	0.42	0.62	0.61	4.55	4.54	4.55	40
長期 (7-)	165	93.69	93.96	11.13	0.68	1.29	1.24	10.51	10.44	10.50	47
長期 (7-11)	99	96.72	96.96	8.73	0.67	1.09	1.07	8.47	8.42	8.46	49
超長期 (11-)	66	89.15	89.47	14.72	0.71	1.60	1.52	13.83	13.72	13.80	43
食料品	1,392	98.34	98.45	5.20	0.43	0.65	0.65	4.96	4.94	4.96	38
短期 (1-3)	476	99.78	99.87	2.19	0.26	0.34	0.34	2.18	2.18	2.18	31
中期 (3-7)	623	98.87	98.98	4.54	0.37	0.61	0.60	4.49	4.48	4.49	39
長期 (7-)	293	94.85	95.02	11.47	0.82	1.31	1.27	10.75	10.68	10.73	47
長期 (7-11)	173	97.25	97.42	9.08	0.74	1.09	1.07	8.77	8.73	8.77	46
超長期 (11-)	120	91.38	91.58	14.91	0.92	1.65	1.58	13.79	13.68	13.75	49
繊維製品	235	98.43	98.57	4.49	0.38	0.62	0.61	4.30	4.28	4.30	40
短期 (1-3)	60	99.80	99.88	1.82	0.23	0.32	0.32	1.81	1.81	1.81	31
中期 (3-7)	155	99.02	99.16	4.21	0.39	0.61	0.61	4.17	4.16	4.17	43
長期 (7-)	20	89.76	90.06	14.62	0.83	1.71	1.62	13.70	13.59	13.67	54
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	20	89.76	90.06	14.62	0.83	1.71	1.62	13.70	13.59	13.67	54
パルプ・紙	374	97.68	97.80	5.01	0.42	0.73	0.71	4.75	4.73	4.75	46
短期 (1-3)	150	99.73	99.82	2.12	0.36	0.45	0.45	2.11	2.10	2.11	42
中期 (3-7)	144	98.66	98.79	4.60	0.39	0.66	0.66	4.54	4.53	4.54	44
長期 (7-)	80	92.08	92.23	11.18	0.58	1.41	1.35	10.53	10.46	10.52	58
長期 (7-11)	45	94.23	94.32	7.63	0.35	1.17	1.13	7.52	7.48	7.52	65
超長期 (11-)	35	89.32	89.53	15.74	0.88	1.74	1.65	14.61	14.49	14.57	48
化学	2,288	96.81	96.93	5.69	0.41	0.81	0.78	5.31	5.28	5.31	48
短期 (1-3)	679	99.73	99.79	1.84	0.21	0.36	0.36	1.83	1.83	1.83	35
中期 (3-7)	996	98.44	98.54	4.61	0.37	0.69	0.69	4.56	4.54	4.56	47
長期 (7-)	613	90.93	91.14	11.72	0.69	1.55	1.47	10.85	10.77	10.83	67
長期 (7-11)	340	95.42	95.62	8.31	0.58	1.20	1.17	8.10	8.05	8.09	63
超長期 (11-)	273	85.33	85.56	15.97	0.83	2.04	1.88	14.69	14.55	14.65	72
医薬品	708	96.50	96.62	6.89	0.48	0.89	0.87	6.50	6.47	6.50	47
短期 (1-3)	163	99.97	100.05	2.53	0.30	0.32	0.32	2.52	2.51	2.52	27
中期 (3-7)	180	99.63	99.77	4.74	0.49	0.58	0.57	4.68	4.66	4.68	35
長期 (7-)	365	93.40	93.53	9.90	0.56	1.33	1.28	9.37	9.31	9.36	62
長期 (7-11)	265	94.37	94.43	7.92	0.43	1.21	1.18	7.79	7.74	7.79	67
超長期 (11-)	100	90.82	91.14	15.15	0.91	1.64	1.56	13.72	13.60	13.66	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11月末、12月ポートフォリオ)

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
事業債 全体	68,908	97.17	97.35	7.77	0.69	0.88	0.85	6.78	6.74	6.75	44
短期 (1-3)	20,214	99.94	100.05	2.16	0.41	0.41	0.41	2.15	2.15	2.15	38
中期 (3-7)	24,894	99.76	99.92	4.85	0.64	0.67	0.67	4.77	4.75	4.77	44
長期 (7-)	23,800	92.11	92.36	15.57	0.97	1.54	1.46	13.32	13.21	13.24	49
長期 (7-11)	10,151	97.63	97.86	8.68	0.86	1.18	1.15	8.35	8.30	8.34	57
超長期 (11-)	13,649	88.01	88.27	20.70	1.05	1.84	1.72	17.42	17.27	17.27	43
水産・農林業	18	99.79	99.96	4.52	0.78	0.83	0.83	4.44	4.42	4.44	62
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	18	99.79	99.96	4.52	0.78	0.83	0.83	4.44	4.42	4.44	62
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
鉱業	30	96.79	96.82	5.82	0.21	0.72	0.71	5.72	5.69	5.72	38
短期 (1-3)	10	99.36	99.38	2.29	0.08	0.36	0.36	2.29	2.28	2.29	33
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	20	95.50	95.55	7.58	0.28	0.91	0.89	7.50	7.47	7.50	41
長期 (7-11)	20	95.50	95.55	7.58	0.28	0.91	0.89	7.50	7.47	7.50	41
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
建設業	1,258	98.56	98.69	4.67	0.40	0.61	0.60	4.51	4.49	4.51	38
短期 (1-3)	420	99.75	99.83	2.12	0.23	0.33	0.33	2.11	2.11	2.11	30
中期 (3-7)	673	99.00	99.14	4.69	0.44	0.63	0.62	4.63	4.61	4.63	40
長期 (7-)	165	93.69	93.96	11.13	0.68	1.29	1.24	10.51	10.44	10.50	47
長期 (7-11)	99	96.72	96.96	8.73	0.67	1.09	1.07	8.47	8.42	8.46	49
超長期 (11-)	66	89.15	89.47	14.72	0.71	1.60	1.52	13.83	13.72	13.80	43
食料品	1,485	98.48	98.60	5.33	0.46	0.67	0.66	5.10	5.07	5.09	38
短期 (1-3)	481	99.77	99.85	2.22	0.26	0.34	0.34	2.21	2.21	2.21	31
中期 (3-7)	678	99.01	99.12	4.66	0.41	0.62	0.61	4.60	4.59	4.60	39
長期 (7-)	326	95.49	95.66	11.31	0.87	1.30	1.26	10.60	10.53	10.58	48
長期 (7-11)	206	97.89	98.05	9.21	0.83	1.10	1.09	8.86	8.81	8.86	47
超長期 (11-)	120	91.38	91.58	14.91	0.92	1.65	1.58	13.79	13.68	13.75	49
繊維製品	235	98.43	98.57	4.49	0.38	0.62	0.61	4.30	4.28	4.30	40
短期 (1-3)	70	99.72	99.81	1.99	0.23	0.34	0.34	1.98	1.98	1.98	32
中期 (3-7)	145	99.00	99.14	4.29	0.40	0.62	0.62	4.25	4.24	4.25	43
長期 (7-)	20	89.76	90.06	14.62	0.83	1.71	1.62	13.70	13.59	13.67	54
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	20	89.76	90.06	14.62	0.83	1.71	1.62	13.70	13.59	13.67	54
パルプ・紙	359	97.58	97.69	5.18	0.42	0.74	0.73	4.91	4.89	4.91	46
短期 (1-3)	165	99.65	99.73	2.38	0.33	0.45	0.45	2.37	2.37	2.37	41
中期 (3-7)	114	98.45	98.58	5.01	0.43	0.73	0.72	4.95	4.93	4.95	47
長期 (7-)	80	92.08	92.23	11.18	0.58	1.41	1.35	10.53	10.46	10.52	58
長期 (7-11)	45	94.23	94.32	7.63	0.35	1.17	1.13	7.52	7.48	7.52	65
超長期 (11-)	35	89.32	89.53	15.74	0.88	1.74	1.65	14.61	14.49	14.57	48
化学	2,265	96.79	96.91	5.80	0.42	0.81	0.79	5.42	5.39	5.41	48
短期 (1-3)	715	99.66	99.73	2.06	0.23	0.38	0.38	2.05	2.05	2.05	36
中期 (3-7)	967	98.39	98.48	4.85	0.39	0.71	0.71	4.79	4.77	4.79	47
長期 (7-)	583	90.62	90.83	11.96	0.70	1.58	1.50	11.07	10.98	11.05	68
長期 (7-11)	310	95.27	95.47	8.43	0.59	1.22	1.20	8.21	8.16	8.21	64
超長期 (11-)	273	85.33	85.56	15.97	0.83	2.04	1.88	14.69	14.55	14.65	72
医薬品	708	96.50	96.62	6.89	0.48	0.89	0.87	6.50	6.47	6.50	47
短期 (1-3)	163	99.97	100.05	2.53	0.30	0.32	0.32	2.52	2.51	2.52	27
中期 (3-7)	180	99.63	99.77	4.74	0.49	0.58	0.57	4.68	4.66	4.68	35
長期 (7-)	365	93.40	93.53	9.90	0.56	1.33	1.28	9.37	9.31	9.36	62
長期 (7-11)	265	94.37	94.43	7.92	0.43	1.21	1.18	7.79	7.74	7.79	67
超長期 (11-)	100	90.82	91.14	15.15	0.91	1.64	1.56	13.72	13.60	13.66	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11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	97.42	97.64	6.44	0.56	0.88	0.87	6.10	6.07	6.10	49
短期 (1-3)	85	99.76	99.86	1.96	0.29	0.35	0.35	1.95	1.95	1.95	34
中期 (3-7)	85	98.29	98.38	5.27	0.42	0.72	0.71	5.19	5.17	5.19	44
長期 (7-)	150	95.60	95.95	9.64	0.79	1.29	1.26	9.08	9.02	9.07	62
長期 (7-11)	125	96.58	96.90	8.33	0.72	1.18	1.16	8.06	8.01	8.06	61
超長期 (11-)	25	90.73	91.21	16.18	1.13	1.89	1.80	14.51	14.37	14.44	63
ゴム製品	330	98.80	98.88	4.61	0.39	0.62	0.61	4.53	4.52	4.53	39
短期 (1-3)	70	99.73	99.77	2.45	0.26	0.37	0.37	2.45	2.44	2.45	33
中期 (3-7)	225	98.85	98.92	4.68	0.38	0.61	0.61	4.63	4.62	4.63	39
長期 (7-)	35	96.62	96.83	8.46	0.70	1.15	1.13	8.19	8.15	8.19	58
長期 (7-11)	35	96.62	96.83	8.46	0.70	1.15	1.13	8.19	8.15	8.19	58
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
ガラス・土石製品	255	97.03	97.18	6.10	0.46	0.84	0.82	5.74	5.71	5.74	48
短期 (1-3)	73	99.62	99.67	2.28	0.23	0.39	0.39	2.27	2.27	2.27	36
中期 (3-7)	90	98.49	98.57	4.44	0.36	0.69	0.68	4.40	4.39	4.40	48
長期 (7-)	92	93.57	93.85	10.72	0.75	1.36	1.31	10.01	9.94	10.00	58
長期 (7-11)	67	97.08	97.39	8.79	0.74	1.12	1.11	8.49	8.44	8.48	52
超長期 (11-)	25	84.10	84.33	15.92	0.80	2.11	1.94	14.75	14.61	14.72	77
鉄鋼	543	99.43	99.57	3.69	0.45	0.56	0.55	3.61	3.60	3.61	40
短期 (1-3)	275	99.89	99.97	1.96	0.34	0.37	0.37	1.95	1.95	1.95	35
中期 (3-7)	225	99.08	99.26	4.80	0.51	0.68	0.67	4.73	4.71	4.73	44
長期 (7-)	43	98.37	98.62	8.90	0.94	1.15	1.14	8.53	8.48	8.52	54
長期 (7-11)	43	98.37	98.62	8.90	0.94	1.15	1.14	8.53	8.48	8.52	54
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
非鉄金属	355	98.68	98.81	4.73	0.38	0.64	0.63	4.63	4.61	4.63	40
短期 (1-3)	90	99.51	99.56	2.09	0.15	0.38	0.37	2.09	2.08	2.09	35
中期 (3-7)	195	98.90	99.02	4.40	0.37	0.62	0.61	4.35	4.34	4.35	41
長期 (7-)	70	96.99	97.25	9.06	0.67	1.06	1.04	8.77	8.72	8.77	43
長期 (7-11)	70	96.99	97.25	9.06	0.67	1.06	1.04	8.77	8.72	8.77	43
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
金属製品	155	99.00	99.11	3.95	0.36	0.57	0.57	3.89	3.87	3.89	40
短期 (1-3)	50	99.66	99.73	2.05	0.19	0.35	0.35	2.04	2.04	2.04	32
中期 (3-7)	96	98.92	99.04	4.49	0.41	0.63	0.63	4.44	4.42	4.44	42
長期 (7-)	9	96.23	96.40	8.74	0.70	1.18	1.16	8.47	8.42	8.47	58
長期 (7-11)	9	96.23	96.40	8.74	0.70	1.18	1.16	8.47	8.42	8.47	58
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
機械	1,323	98.56	98.66	4.66	0.39	0.66	0.65	4.56	4.54	4.56	43
短期 (1-3)	390	99.63	99.68	2.12	0.26	0.42	0.42	2.11	2.10	2.11	39
中期 (3-7)	690	98.59	98.68	4.67	0.38	0.66	0.65	4.61	4.60	4.61	43
長期 (7-)	243	96.77	96.94	8.69	0.64	1.06	1.05	8.44	8.40	8.44	46
長期 (7-11)	243	96.77	96.94	8.69	0.64	1.06	1.05	8.44	8.40	8.44	46
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
電気機器	1,975	98.93	99.06	4.31	0.48	0.66	0.65	4.22	4.20	4.22	45
短期 (1-3)	730	99.92	100.01	2.09	0.38	0.38	0.38	2.08	2.08	2.08	36
中期 (3-7)	1,030	98.62	98.74	4.94	0.46	0.73	0.72	4.87	4.85	4.87	48
長期 (7-)	215	97.10	97.36	8.87	0.87	1.26	1.25	8.51	8.46	8.51	65
長期 (7-11)	215	97.10	97.36	8.87	0.87	1.26	1.25	8.51	8.46	8.51	65
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
輸送用機器	1,223	98.19	98.32	4.51	0.36	0.64	0.63	4.34	4.32	4.34	41
短期 (1-3)	540	99.63	99.73	2.05	0.30	0.46	0.46	2.04	2.04	2.04	44
中期 (3-7)	429	98.89	99.01	4.26	0.33	0.58	0.57	4.22	4.21	4.22	39
長期 (7-)	254	93.97	94.17	10.18	0.52	1.15	1.11	9.74	9.68	9.73	41
長期 (7-11)	164	96.46	96.65	8.27	0.44	0.92	0.91	8.10	8.06	8.10	36
超長期 (11-)	90	89.42	89.66	13.68	0.67	1.60	1.52	12.96	12.87	12.95	52

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11月末、12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	305	97.27	97.48	6.70	0.55	0.91	0.90	6.36	6.33	6.36	50
短期 (1-3)	70	99.60	99.66	2.16	0.20	0.38	0.38	2.15	2.15	2.15	35
中期 (3-7)	85	98.29	98.38	5.27	0.42	0.72	0.71	5.19	5.17	5.19	44
長期 (7-)	150	95.60	95.95	9.64	0.79	1.29	1.26	9.08	9.02	9.07	62
長期 (7-11)	125	96.58	96.90	8.33	0.72	1.18	1.16	8.06	8.01	8.06	61
超長期 (11-)	25	90.73	91.21	16.18	1.13	1.89	1.80	14.51	14.37	14.44	63
ゴム製品	330	98.80	98.88	4.61	0.39	0.62	0.61	4.53	4.52	4.53	39
短期 (1-3)	70	99.73	99.77	2.45	0.26	0.37	0.37	2.45	2.44	2.45	33
中期 (3-7)	225	98.85	98.92	4.68	0.38	0.61	0.61	4.63	4.62	4.63	39
長期 (7-)	35	96.62	96.83	8.46	0.70	1.15	1.13	8.19	8.15	8.19	58
長期 (7-11)	35	96.62	96.83	8.46	0.70	1.15	1.13	8.19	8.15	8.19	58
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
ガラス・土石製品	255	97.03	97.18	6.10	0.46	0.84	0.82	5.74	5.71	5.74	48
短期 (1-3)	73	99.62	99.67	2.28	0.23	0.39	0.39	2.27	2.27	2.27	36
中期 (3-7)	105	98.08	98.18	4.81	0.37	0.75	0.74	4.75	4.73	4.75	51
長期 (7-)	77	93.17	93.47	11.44	0.81	1.41	1.35	10.63	10.56	10.62	56
長期 (7-11)	52	97.51	97.84	9.30	0.82	1.12	1.11	8.94	8.89	8.93	47
超長期 (11-)	25	84.10	84.33	15.92	0.80	2.11	1.94	14.75	14.61	14.72	77
鉄鋼	518	99.41	99.55	3.81	0.46	0.56	0.56	3.74	3.73	3.74	40
短期 (1-3)	250	99.88	99.96	2.05	0.34	0.36	0.36	2.04	2.04	2.04	34
中期 (3-7)	225	99.08	99.26	4.80	0.51	0.68	0.67	4.73	4.71	4.73	44
長期 (7-)	43	98.37	98.62	8.90	0.94	1.15	1.14	8.53	8.48	8.52	54
長期 (7-11)	43	98.37	98.62	8.90	0.94	1.15	1.14	8.53	8.48	8.52	54
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
非鉄金属	335	98.61	98.75	4.95	0.39	0.66	0.65	4.85	4.83	4.85	40
短期 (1-3)	90	99.45	99.53	2.54	0.20	0.42	0.42	2.53	2.52	2.53	37
中期 (3-7)	175	98.83	98.94	4.56	0.37	0.63	0.62	4.51	4.49	4.51	41
長期 (7-)	70	96.99	97.25	9.06	0.67	1.06	1.04	8.77	8.72	8.77	43
長期 (7-11)	70	96.99	97.25	9.06	0.67	1.06	1.04	8.77	8.72	8.77	43
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
金属製品	165	99.08	99.18	4.00	0.37	0.57	0.57	3.94	3.93	3.94	39
短期 (1-3)	60	99.64	99.72	2.22	0.22	0.38	0.38	2.21	2.20	2.21	34
中期 (3-7)	96	98.99	99.11	4.68	0.44	0.63	0.63	4.62	4.61	4.62	41
長期 (7-)	9	96.23	96.40	8.74	0.70	1.18	1.16	8.47	8.42	8.47	58
長期 (7-11)	9	96.23	96.40	8.74	0.70	1.18	1.16	8.47	8.42	8.47	58
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
機械	1,323	98.56	98.66	4.66	0.39	0.66	0.65	4.56	4.54	4.56	43
短期 (1-3)	405	99.60	99.66	2.15	0.25	0.43	0.43	2.14	2.14	2.14	40
中期 (3-7)	675	98.58	98.68	4.71	0.38	0.66	0.65	4.65	4.63	4.65	43
長期 (7-)	243	96.77	96.94	8.69	0.64	1.06	1.05	8.44	8.40	8.44	46
長期 (7-11)	243	96.77	96.94	8.69	0.64	1.06	1.05	8.44	8.40	8.44	46
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
電気機器	1,960	98.92	99.05	4.34	0.48	0.66	0.66	4.24	4.23	4.24	45
短期 (1-3)	745	99.88	99.97	2.15	0.38	0.39	0.39	2.14	2.14	2.14	36
中期 (3-7)	1,030	98.50	98.63	5.05	0.47	0.75	0.74	4.98	4.96	4.98	49
長期 (7-)	185	97.41	97.68	9.16	0.95	1.29	1.27	8.76	8.70	8.75	65
長期 (7-11)	185	97.41	97.68	9.16	0.95	1.29	1.27	8.76	8.70	8.75	65
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
輸送用機器	1,203	98.18	98.30	4.68	0.37	0.65	0.64	4.50	4.48	4.50	41
短期 (1-3)	525	99.59	99.69	2.18	0.31	0.47	0.47	2.17	2.16	2.17	44
中期 (3-7)	414	98.90	99.02	4.35	0.33	0.58	0.57	4.31	4.29	4.31	38
長期 (7-)	264	94.22	94.43	10.17	0.55	1.15	1.11	9.72	9.67	9.72	41
長期 (7-11)	174	96.71	96.89	8.36	0.48	0.93	0.92	8.17	8.14	8.17	37
超長期 (11-)	90	89.42	89.66	13.68	0.67	1.60	1.52	12.96	12.87	12.95	52

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11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	215	98.45	98.57	4.63	0.47	0.76	0.75	4.50	4.48	4.50	52
短期 (1-3)	85	99.77	99.87	1.71	0.25	0.38	0.38	1.71	1.71	1.71	38
中期 (3-7)	85	97.82	97.96	5.49	0.48	0.88	0.87	5.40	5.38	5.40	58
長期 (7-)	45	97.14	97.27	8.52	0.86	1.25	1.23	8.20	8.15	8.20	67
長期 (7-11)	45	97.14	97.27	8.52	0.86	1.25	1.23	8.20	8.15	8.20	67
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
その他製品	205	96.53	96.67	7.07	0.47	0.82	0.80	6.64	6.61	6.63	39
短期 (1-3)	40	99.76	99.86	1.95	0.37	0.50	0.50	1.94	1.93	1.94	48
中期 (3-7)	105	98.94	99.11	5.48	0.42	0.64	0.63	5.41	5.39	5.41	34
長期 (7-)	60	90.15	90.29	13.27	0.61	1.43	1.35	12.48	12.39	12.46	40
長期 (7-11)	15	97.60	97.73	7.76	0.55	0.88	0.87	7.60	7.57	7.60	38
超長期 (11-)	45	87.66	87.80	15.10	0.63	1.63	1.53	14.29	14.18	14.26	41
電気・ガス業	12,378	95.73	95.89	7.97	0.72	1.05	1.02	7.06	7.01	7.04	57
短期 (1-3)	2,594	100.08	100.20	1.95	0.46	0.38	0.38	1.94	1.94	1.94	37
中期 (3-7)	4,490	99.51	99.67	4.82	0.71	0.80	0.80	4.72	4.70	4.72	57
長期 (7-)	5,294	90.40	90.59	13.59	0.85	1.65	1.56	12.01	11.91	11.96	68
長期 (7-11)	2,537	96.18	96.32	8.59	0.76	1.27	1.25	8.30	8.24	8.29	68
超長期 (11-)	2,758	85.10	85.31	18.18	0.93	2.04	1.88	15.86	15.71	15.78	68
陸運業	6,127	93.18	93.40	13.36	0.96	1.19	1.12	10.53	10.45	10.44	42
短期 (1-3)	850	100.58	100.73	1.92	0.58	0.33	0.33	1.91	1.91	1.91	32
中期 (3-7)	1,584	102.22	102.47	5.11	1.13	0.64	0.65	4.96	4.95	4.96	39
長期 (7-)	3,693	87.60	87.83	19.53	0.98	1.69	1.56	15.59	15.45	15.44	46
長期 (7-11)	1,082	100.08	100.34	8.72	1.04	1.05	1.04	8.32	8.28	8.32	47
超長期 (11-)	2,611	82.43	82.65	24.00	0.96	2.01	1.82	19.25	19.06	19.02	46
海運業	96	100.14	100.45	5.08	0.93	0.81	0.81	4.91	4.89	4.91	55
短期 (1-3)	25	101.95	102.49	2.41	1.26	0.49	0.50	2.37	2.37	2.37	45
中期 (3-7)	51	98.78	98.94	4.96	0.53	0.78	0.78	4.89	4.87	4.89	53
長期 (7-)	20	101.36	101.77	8.71	1.52	1.28	1.28	8.15	8.10	8.14	72
長期 (7-11)	20	101.36	101.77	8.71	1.52	1.28	1.28	8.15	8.10	8.14	72
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
空運業	245	93.24	93.45	7.74	0.70	1.40	1.33	6.96	6.90	6.95	88
短期 (1-3)	80	99.65	99.86	2.39	0.60	0.78	0.78	2.37	2.36	2.37	74
中期 (3-7)	60	97.04	97.15	4.67	0.43	1.03	1.02	4.61	4.58	4.61	80
長期 (7-)	105	86.18	86.45	13.57	0.92	2.18	2.02	12.52	12.39	12.49	105
長期 (7-11)	20	97.82	98.36	9.55	1.20	1.46	1.45	8.99	8.93	8.98	79
超長期 (11-)	85	83.44	83.64	14.51	0.86	2.38	2.18	13.49	13.35	13.46	112
倉庫・運輸関連業	166	96.52	96.67	6.00	0.51	0.94	0.92	5.67	5.64	5.67	59
短期 (1-3)	44	100.07	100.20	1.48	0.45	0.40	0.40	1.47	1.47	1.47	41
中期 (3-7)	85	96.88	97.00	5.71	0.42	0.97	0.95	5.62	5.60	5.62	65
長期 (7-)	37	91.41	91.64	12.14	0.80	1.60	1.53	11.34	11.25	11.33	68
長期 (7-11)	17	96.48	96.73	8.46	0.88	1.40	1.37	8.14	8.08	8.13	82
超長期 (11-)	20	87.22	87.44	15.17	0.72	1.79	1.67	14.27	14.15	14.24	55
情報・通信業	2,125	97.23	97.45	4.82	0.77	1.19	1.16	4.48	4.45	4.48	93
短期 (1-3)	883	99.50	99.66	2.21	0.56	0.76	0.76	2.19	2.19	2.19	73
中期 (3-7)	825	98.23	98.46	4.79	0.76	1.11	1.10	4.69	4.67	4.69	87
長期 (7-)	418	90.43	90.75	10.40	1.22	2.34	2.22	9.34	9.23	9.32	153
長期 (7-11)	300	93.04	93.33	8.51	1.02	1.99	1.92	8.09	8.01	8.08	136
超長期 (11-)	118	83.76	84.16	15.23	1.73	3.35	3.08	12.90	12.70	12.83	202
卸売業	1,211	98.72	98.95	6.42	0.85	0.87	0.86	6.04	6.01	6.03	49
短期 (1-3)	238	100.56	100.79	1.85	0.71	0.41	0.42	1.84	1.83	1.84	41
中期 (3-7)	568	100.38	100.57	5.08	0.83	0.74	0.74	4.96	4.95	4.96	48
長期 (7-)	405	95.30	95.60	11.00	0.95	1.34	1.30	10.22	10.15	10.21	55
長期 (7-11)	250	99.29	99.61	8.59	1.02	1.10	1.10	8.21	8.17	8.21	53
超長期 (11-)	155	88.87	89.12	14.87	0.83	1.77	1.67	13.85	13.74	13.82	58

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11月末、12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	205	98.41	98.53	5.00	0.53	0.81	0.80	4.86	4.84	4.86	55
短期 (1-3)	65	99.73	99.83	1.93	0.27	0.40	0.40	1.92	1.92	1.92	39
中期 (3-7)	105	97.95	98.10	5.58	0.54	0.90	0.89	5.48	5.45	5.48	59
長期 (7-)	35	97.31	97.42	8.96	0.97	1.32	1.30	8.58	8.52	8.57	70
長期 (7-11)	35	97.31	97.42	8.96	0.97	1.32	1.30	8.58	8.52	8.57	70
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
その他製品	205	96.53	96.67	7.07	0.47	0.82	0.80	6.64	6.61	6.63	39
短期 (1-3)	50	99.56	99.64	2.16	0.32	0.50	0.50	2.15	2.14	2.15	47
中期 (3-7)	95	98.96	99.15	5.74	0.46	0.65	0.64	5.66	5.64	5.66	33
長期 (7-)	60	90.15	90.29	13.27	0.61	1.43	1.35	12.48	12.39	12.46	40
長期 (7-11)	15	97.60	97.73	7.76	0.55	0.88	0.87	7.60	7.57	7.60	38
超長期 (11-)	45	87.66	87.80	15.10	0.63	1.63	1.53	14.29	14.18	14.26	41
電気・ガス業	12,430	95.75	95.91	8.08	0.73	1.07	1.03	7.16	7.11	7.14	58
短期 (1-3)	2,584	100.02	100.13	2.05	0.44	0.39	0.39	2.04	2.03	2.04	37
中期 (3-7)	4,488	99.47	99.63	4.90	0.72	0.81	0.81	4.80	4.78	4.80	57
長期 (7-)	5,358	90.59	90.77	13.64	0.88	1.66	1.57	12.05	11.95	12.01	69
長期 (7-11)	2,575	96.29	96.44	8.70	0.80	1.29	1.27	8.38	8.33	8.38	69
超長期 (11-)	2,784	85.31	85.53	18.21	0.95	2.04	1.89	15.88	15.72	15.79	68
陸運業	6,120	93.17	93.39	13.62	0.98	1.21	1.14	10.74	10.66	10.66	42
短期 (1-3)	820	100.65	100.82	2.06	0.61	0.34	0.34	2.05	2.04	2.05	32
中期 (3-7)	1,569	102.29	102.54	5.21	1.15	0.65	0.66	5.05	5.04	5.05	40
長期 (7-)	3,731	87.68	87.91	19.69	0.99	1.70	1.57	15.73	15.59	15.57	46
長期 (7-11)	1,073	99.96	100.22	8.80	1.03	1.05	1.05	8.40	8.36	8.40	47
超長期 (11-)	2,658	82.73	82.95	24.09	0.98	2.01	1.83	19.30	19.12	19.07	46
海運業	96	100.14	100.45	5.08	0.93	0.81	0.81	4.91	4.89	4.91	55
短期 (1-3)	25	101.95	102.49	2.41	1.26	0.49	0.50	2.37	2.37	2.37	45
中期 (3-7)	51	98.78	98.94	4.96	0.53	0.78	0.78	4.89	4.87	4.89	53
長期 (7-)	20	101.36	101.77	8.71	1.52	1.28	1.28	8.15	8.10	8.14	72
長期 (7-11)	20	101.36	101.77	8.71	1.52	1.28	1.28	8.15	8.10	8.14	72
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
空運業	235	92.97	93.19	8.02	0.72	1.43	1.36	7.23	7.17	7.22	89
短期 (1-3)	80	99.58	99.81	2.64	0.64	0.81	0.81	2.61	2.60	2.61	75
中期 (3-7)	50	96.67	96.76	5.00	0.43	1.07	1.06	4.93	4.90	4.93	81
長期 (7-)	105	86.18	86.45	13.57	0.92	2.18	2.02	12.52	12.39	12.49	105
長期 (7-11)	20	97.82	98.36	9.55	1.20	1.46	1.45	8.99	8.93	8.98	79
超長期 (11-)	85	83.44	83.64	14.51	0.86	2.38	2.18	13.49	13.35	13.46	112
倉庫・運輸関連業	158	96.35	96.50	6.25	0.52	0.98	0.96	5.92	5.88	5.92	60
短期 (1-3)	36	100.10	100.24	1.58	0.50	0.43	0.43	1.57	1.57	1.57	43
中期 (3-7)	85	96.88	97.00	5.71	0.42	0.97	0.95	5.62	5.60	5.62	65
長期 (7-)	37	91.41	91.64	12.14	0.80	1.60	1.53	11.34	11.25	11.33	68
長期 (7-11)	17	96.48	96.73	8.46	0.88	1.40	1.37	8.14	8.08	8.13	82
超長期 (11-)	20	87.22	87.44	15.17	0.72	1.79	1.67	14.27	14.15	14.24	55
情報・通信業	2,100	97.20	97.41	4.87	0.77	1.20	1.17	4.52	4.49	4.52	94
短期 (1-3)	868	99.48	99.64	2.26	0.57	0.78	0.77	2.24	2.23	2.24	74
中期 (3-7)	830	98.17	98.40	4.86	0.76	1.12	1.11	4.75	4.73	4.75	87
長期 (7-)	403	90.26	90.58	10.53	1.24	2.38	2.26	9.44	9.33	9.42	156
長期 (7-11)	285	92.95	93.23	8.59	1.04	2.02	1.95	8.15	8.07	8.15	139
超長期 (11-)	118	83.76	84.16	15.23	1.73	3.35	3.08	12.90	12.70	12.83	202
卸売業	1,186	98.69	98.93	6.54	0.86	0.88	0.86	6.14	6.11	6.14	49
短期 (1-3)	213	100.65	100.89	1.95	0.76	0.42	0.42	1.93	1.93	1.93	40
中期 (3-7)	568	100.38	100.57	5.08	0.83	0.74	0.74	4.96	4.95	4.96	48
長期 (7-)	405	95.30	95.60	11.00	0.95	1.34	1.30	10.22	10.15	10.21	55
長期 (7-11)	250	99.29	99.61	8.59	1.02	1.10	1.10	8.21	8.17	8.21	53
超長期 (11-)	155	88.87	89.12	14.87	0.83	1.77	1.67	13.85	13.74	13.82	58

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 (4/4) (2023年11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	98.89	99.06	3.86	0.48	0.61	0.61	3.73	3.71	3.72	45
短期 (1-3)	480	100.02	100.20	2.03	0.43	0.38	0.38	2.02	2.01	2.02	36
中期 (3-7)	331	98.88	99.03	4.35	0.45	0.71	0.70	4.31	4.29	4.31	51
長期 (7-)	104	93.65	93.91	10.79	0.77	1.46	1.41	10.19	10.12	10.18	66
長期 (7-11)	64	95.34	95.52	8.46	0.70	1.34	1.31	8.19	8.14	8.19	75
超長期 (11-)	40	90.93	91.32	14.51	0.88	1.66	1.58	13.54	13.44	13.51	52
銀行業	1,565	101.03	101.32	3.55	1.17	0.83	0.84	3.46	3.44	3.46	70
短期 (1-3)	776	101.09	101.38	2.05	1.15	0.70	0.70	2.03	2.02	2.03	68
中期 (3-7)	755	100.90	101.18	4.89	1.17	0.95	0.96	4.73	4.71	4.73	72
長期 (7-)	34	102.63	103.19	8.26	1.60	1.16	1.18	7.74	7.70	7.74	65
長期 (7-11)	34	102.63	103.19	8.26	1.60	1.16	1.18	7.74	7.70	7.74	65
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
証券、商品先物取引業	1,035	99.83	100.13	2.58	0.90	0.89	0.89	2.54	2.53	2.54	83
短期 (1-3)	784	100.03	100.33	2.10	0.90	0.83	0.83	2.07	2.07	2.07	81
中期 (3-7)	247	99.29	99.62	4.00	0.88	1.07	1.06	3.92	3.90	3.92	90
長期 (7-)	5	94.55	94.76	8.76	0.90	1.61	1.57	8.41	8.35	8.41	99
長期 (7-11)	5	94.55	94.76	8.76	0.90	1.61	1.57	8.41	8.35	8.41	99
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
保険業	335	99.05	99.09	4.28	0.38	0.58	0.58	4.20	4.19	4.20	39
短期 (1-3)	155	99.33	99.34	2.92	0.19	0.43	0.43	2.91	2.90	2.91	35
中期 (3-7)	130	99.65	99.70	4.14	0.45	0.54	0.54	4.11	4.09	4.11	36
長期 (7-)	50	96.62	96.71	8.87	0.75	1.17	1.15	8.59	8.54	8.58	56
長期 (7-11)	50	96.62	96.71	8.87	0.75	1.17	1.15	8.59	8.54	8.58	56
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
その他金融業	5,656	98.56	98.68	4.04	0.37	0.67	0.66	3.93	3.92	3.93	49
短期 (1-3)	2,642	99.62	99.70	2.05	0.25	0.46	0.46	2.04	2.04	2.04	44
中期 (3-7)	2,359	98.49	98.63	4.81	0.43	0.74	0.74	4.75	4.73	4.75	50
長期 (7-)	655	94.56	94.77	9.28	0.65	1.30	1.26	8.89	8.83	8.88	63
長期 (7-11)	577	95.47	95.68	8.52	0.61	1.22	1.18	8.29	8.24	8.28	61
超長期 (11-)	78	87.85	88.06	14.94	0.96	2.00	1.88	13.76	13.63	13.73	78
不動産業	2,643	96.61	96.80	7.93	0.69	0.96	0.93	7.00	6.96	6.98	49
短期 (1-3)	491	99.94	100.06	1.87	0.42	0.41	0.41	1.86	1.86	1.86	40
中期 (3-7)	1,034	99.12	99.26	4.73	0.55	0.70	0.69	4.66	4.65	4.66	47
長期 (7-)	1,118	92.83	93.09	13.55	0.94	1.47	1.40	11.73	11.64	11.68	55
長期 (7-11)	615	98.45	98.72	8.76	0.91	1.12	1.11	8.40	8.35	8.40	53
超長期 (11-)	503	85.96	86.21	19.42	0.97	1.96	1.82	16.39	16.24	16.27	59
サービス業	862	88.45	88.69	4.95	0.55	2.86	2.53	4.33	4.26	4.33	231
短期 (1-3)	337	98.01	98.12	1.80	0.28	1.66	1.63	1.80	1.79	1.80	162
中期 (3-7)	310	93.35	93.51	4.90	0.44	2.22	2.06	4.87	4.83	4.87	182
長期 (7-)	215	66.41	66.94	9.94	1.12	6.90	5.55	9.07	8.83	9.06	488
長期 (7-11)	165	67.81	68.30	8.84	1.02	6.86	5.57	8.24	8.01	8.23	498
超長期 (11-)	50	61.77	62.46	13.58	1.45	7.06	5.51	12.08	11.77	12.03	451
財投機関債	20,758	98.11	98.32	9.63	0.76	0.75	0.73	8.22	8.17	8.17	20
短期 (1-3)	5,452	100.19	100.29	2.02	0.30	0.20	0.20	2.02	2.01	2.02	18
中期 (3-7)	6,444	101.12	101.31	4.62	0.67	0.41	0.42	4.54	4.53	4.54	20
長期 (7-)	8,863	94.64	94.94	17.96	1.11	1.37	1.32	15.11	15.00	15.00	22
長期 (7-11)	2,430	101.61	101.91	8.54	0.98	0.79	0.79	8.19	8.15	8.18	23
超長期 (11-)	6,433	92.00	92.31	21.51	1.16	1.61	1.55	18.00	17.86	17.84	22

出所:NFRC

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

事業債 業種別・ポートフォリオ指標 (4/4) (2023年11月末、12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	895	98.86	99.04	3.93	0.48	0.62	0.61	3.79	3.77	3.78	44
短期 (1-3)	475	100.00	100.17	2.10	0.43	0.38	0.38	2.09	2.08	2.09	36
中期 (3-7)	316	98.87	99.02	4.42	0.46	0.71	0.71	4.37	4.35	4.37	51
長期 (7-)	104	93.65	93.91	10.79	0.77	1.46	1.41	10.19	10.12	10.18	66
長期 (7-11)	64	95.34	95.52	8.46	0.70	1.34	1.31	8.19	8.14	8.19	75
超長期 (11-)	40	90.93	91.32	14.51	0.88	1.66	1.58	13.54	13.44	13.51	52
銀行業	1,525	101.05	101.34	3.62	1.18	0.84	0.84	3.52	3.50	3.52	70
短期 (1-3)	796	101.29	101.62	2.18	1.24	0.72	0.73	2.15	2.14	2.15	70
中期 (3-7)	695	100.70	100.93	5.04	1.10	0.95	0.96	4.89	4.87	4.89	70
長期 (7-)	34	102.63	103.19	8.26	1.60	1.16	1.18	7.74	7.70	7.74	65
長期 (7-11)	34	102.63	103.19	8.26	1.60	1.16	1.18	7.74	7.70	7.74	65
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
証券、商品先物取引業	940	99.83	100.12	2.73	0.91	0.89	0.89	2.69	2.68	2.69	82
短期 (1-3)	739	100.02	100.31	2.30	0.92	0.85	0.85	2.27	2.26	2.27	81
中期 (3-7)	197	99.23	99.54	4.24	0.85	1.04	1.04	4.16	4.13	4.16	85
長期 (7-)	5	94.55	94.76	8.76	0.90	1.61	1.57	8.41	8.35	8.41	99
長期 (7-11)	5	94.55	94.76	8.76	0.90	1.61	1.57	8.41	8.35	8.41	99
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
保険業	335	99.05	99.09	4.28	0.38	0.58	0.58	4.20	4.19	4.20	39
短期 (1-3)	155	99.33	99.34	2.92	0.19	0.43	0.43	2.91	2.90	2.91	35
中期 (3-7)	130	99.65	99.70	4.14	0.45	0.54	0.54	4.11	4.09	4.11	36
長期 (7-)	50	96.62	96.71	8.87	0.75	1.17	1.15	8.59	8.54	8.58	56
長期 (7-11)	50	96.62	96.71	8.87	0.75	1.17	1.15	8.59	8.54	8.58	56
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
その他金融業	5,668	98.61	98.73	4.15	0.38	0.65	0.64	4.04	4.03	4.04	46
短期 (1-3)	2,702	99.53	99.61	2.22	0.26	0.45	0.45	2.21	2.21	2.21	42
中期 (3-7)	2,322	98.66	98.80	4.97	0.45	0.71	0.70	4.90	4.88	4.90	45
長期 (7-)	645	94.54	94.75	9.32	0.65	1.31	1.26	8.92	8.86	8.92	63
長期 (7-11)	567	95.46	95.67	8.54	0.61	1.22	1.18	8.31	8.26	8.31	62
超長期 (11-)	78	87.85	88.06	14.94	0.96	2.00	1.88	13.76	13.63	13.73	78
不動産業	2,653	96.62	96.81	7.95	0.69	0.96	0.93	7.02	6.97	7.00	49
短期 (1-3)	491	99.91	100.02	1.91	0.41	0.41	0.41	1.90	1.90	1.90	40
中期 (3-7)	1,048	99.23	99.38	4.77	0.57	0.70	0.70	4.70	4.68	4.70	47
長期 (7-)	1,114	92.72	92.98	13.59	0.93	1.47	1.41	11.77	11.68	11.72	55
長期 (7-11)	611	98.28	98.55	8.80	0.89	1.12	1.11	8.44	8.40	8.44	53
超長期 (11-)	503	85.96	86.21	19.42	0.97	1.96	1.82	16.39	16.24	16.27	59
サービス業	813	88.15	88.38	5.31	0.56	2.57	2.23	4.68	4.61	4.68	198
短期 (1-3)	317	96.53	96.63	2.20	0.27	1.56	1.47	2.17	2.15	2.17	144
中期 (3-7)	286	95.36	95.49	5.30	0.44	1.41	1.31	5.23	5.20	5.23	104
長期 (7-)	210	65.68	66.23	10.01	1.14	7.12	5.72	9.14	8.90	9.13	504
長期 (7-11)	160	66.91	67.41	8.90	1.04	7.13	5.78	8.30	8.06	8.29	519
超長期 (11-)	50	61.77	62.46	13.58	1.45	7.06	5.51	12.08	11.77	12.03	451
財投機関債	20,594	98.10	98.31	9.76	0.77	0.76	0.74	8.34	8.29	8.29	20
短期 (1-3)	5,487	100.20	100.30	2.18	0.31	0.20	0.21	2.17	2.17	2.17	18
中期 (3-7)	6,257	101.20	101.39	4.75	0.69	0.43	0.43	4.66	4.65	4.66	20
長期 (7-)	8,850	94.60	94.90	18.01	1.11	1.37	1.33	15.17	15.05	15.05	22
長期 (7-11)	2,490	101.66	101.97	8.70	0.99	0.80	0.81	8.33	8.30	8.32	23
超長期 (11-)	6,360	91.83	92.13	21.66	1.15	1.62	1.56	18.13	17.98	17.96	22

出所:NFRC

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

事業債 円建外債 格付別・ポートフォリオ指標 (2023年11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	72,738	97.26	97.45	7.46	0.69	0.89	0.87	6.52	6.48	6.49	48
短期 (1-3)	21,756	99.98	100.11	2.03	0.45	0.46	0.46	2.02	2.01	2.02	44
中期 (3-7)	26,891	99.64	99.82	4.71	0.65	0.71	0.71	4.63	4.61	4.63	49
長期 (7-)	24,091	92.14	92.39	15.43	0.97	1.54	1.46	13.20	13.10	13.12	50
長期 (7-11)	10,305	97.52	97.76	8.59	0.85	1.18	1.15	8.26	8.21	8.26	58
超長期 (11-)	13,786	88.11	88.38	20.54	1.06	1.84	1.72	17.29	17.13	17.14	44
AAA~A 格	71,622	97.24	97.42	7.51	0.69	0.89	0.86	6.56	6.52	6.54	47
短期 (1-3)	21,152	99.98	100.12	2.03	0.44	0.44	0.44	2.02	2.01	2.02	42
中期 (3-7)	26,499	99.66	99.83	4.71	0.64	0.70	0.70	4.63	4.62	4.63	48
長期 (7-)	23,972	92.14	92.39	15.45	0.97	1.54	1.46	13.22	13.11	13.14	50
長期 (7-11)	10,229	97.54	97.77	8.59	0.85	1.18	1.15	8.26	8.22	8.26	58
超長期 (11-)	13,743	88.11	88.38	20.56	1.06	1.83	1.72	17.30	17.15	17.15	44
AAA~AA 格	49,632	97.20	97.38	8.42	0.68	0.81	0.79	7.21	7.17	7.18	34
短期 (1-3)	13,783	100.08	100.18	2.06	0.37	0.32	0.32	2.05	2.04	2.05	30
中期 (3-7)	17,442	100.19	100.36	4.72	0.63	0.58	0.58	4.64	4.63	4.64	35
長期 (7-)	18,408	92.21	92.46	16.69	0.96	1.46	1.39	14.05	13.94	13.95	37
長期 (7-11)	7,051	98.78	99.00	8.56	0.82	0.99	0.99	8.25	8.21	8.25	42
超長期 (11-)	11,357	88.13	88.40	21.74	1.05	1.78	1.67	18.08	17.92	17.91	34
AAA 格	10,284	97.97	98.06	5.87	0.34	0.51	0.50	5.16	5.14	5.14	24
短期 (1-3)	3,897	99.78	99.81	2.07	0.13	0.22	0.22	2.07	2.07	2.07	20
中期 (3-7)	4,390	99.36	99.45	4.66	0.34	0.46	0.46	4.61	4.59	4.61	24
長期 (7-)	1,997	91.38	91.59	15.97	0.73	1.26	1.19	13.06	12.97	12.96	30
長期 (7-11)	1,190	97.39	97.53	8.40	0.53	0.87	0.86	8.20	8.17	8.20	30
超長期 (11-)	807	82.53	82.82	27.13	1.02	1.95	1.77	21.50	21.30	21.22	31
AA 格	39,348	97.00	97.21	9.08	0.77	0.89	0.86	7.75	7.70	7.71	37
短期 (1-3)	9,886	100.19	100.33	2.05	0.46	0.36	0.36	2.04	2.03	2.04	33
中期 (3-7)	13,052	100.47	100.67	4.74	0.73	0.62	0.62	4.65	4.64	4.65	39
長期 (7-)	16,411	92.31	92.57	16.78	0.99	1.48	1.41	14.17	14.06	14.07	38
長期 (7-11)	5,862	99.06	99.30	8.59	0.88	1.02	1.01	8.26	8.22	8.26	44
超長期 (11-)	10,550	88.56	88.83	21.32	1.05	1.76	1.66	17.84	17.68	17.68	34
A 格	21,991	97.32	97.52	5.47	0.71	1.06	1.03	5.11	5.07	5.10	75
短期 (1-3)	7,369	99.81	99.99	1.98	0.58	0.68	0.68	1.97	1.96	1.97	66
中期 (3-7)	9,057	98.63	98.81	4.70	0.66	0.95	0.94	4.62	4.60	4.62	72
長期 (7-)	5,564	91.89	92.14	11.35	0.97	1.81	1.71	10.46	10.37	10.44	93
長期 (7-11)	3,178	94.79	95.04	8.66	0.90	1.60	1.52	8.30	8.23	8.29	95
超長期 (11-)	2,387	88.01	88.27	14.93	1.07	2.11	1.97	13.57	13.44	13.53	90
BBB 格	1,116	98.57	98.84	3.77	0.91	1.14	1.13	3.58	3.55	3.57	98
短期 (1-3)	604	99.79	100.07	1.89	0.80	0.88	0.88	1.87	1.86	1.87	87
中期 (3-7)	392	98.53	98.79	4.62	1.04	1.36	1.35	4.50	4.47	4.50	113
長期 (7-)	119	92.53	92.78	10.48	1.02	1.83	1.76	9.67	9.58	9.66	105
長期 (7-11)	76	95.49	95.67	8.07	0.91	1.55	1.51	7.76	7.71	7.76	100
超長期 (11-)	43	87.26	87.61	14.76	1.21	2.38	2.23	13.39	13.24	13.35	116

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11月末、12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	72,292	97.25	97.44	7.59	0.70	0.90	0.87	6.64	6.60	6.62	47
短期 (1-3)	21,679	99.94	100.08	2.17	0.45	0.46	0.46	2.15	2.15	2.15	43
中期 (3-7)	26,511	99.68	99.86	4.82	0.66	0.71	0.71	4.74	4.72	4.74	47
長期 (7-)	24,103	92.16	92.41	15.52	0.98	1.55	1.47	13.28	13.17	13.19	51
長期 (7-11)	10,317	97.59	97.83	8.69	0.86	1.19	1.16	8.35	8.30	8.34	58
超長期 (11-)	13,786	88.09	88.35	20.63	1.06	1.85	1.73	17.36	17.21	17.21	44
AAA～A 格	71,284	97.24	97.42	7.64	0.70	0.89	0.87	6.68	6.64	6.65	46
短期 (1-3)	21,165	99.95	100.08	2.17	0.45	0.45	0.45	2.15	2.15	2.15	42
中期 (3-7)	26,135	99.70	99.87	4.83	0.66	0.70	0.70	4.74	4.72	4.74	47
長期 (7-)	23,984	92.16	92.41	15.54	0.98	1.55	1.47	13.29	13.19	13.21	50
長期 (7-11)	10,241	97.61	97.84	8.69	0.86	1.18	1.16	8.35	8.30	8.35	58
超長期 (11-)	13,743	88.09	88.36	20.65	1.06	1.84	1.73	17.37	17.22	17.22	44
AAA～AA 格	50,056	97.21	97.40	8.48	0.69	0.82	0.80	7.27	7.23	7.24	35
短期 (1-3)	14,050	100.07	100.18	2.17	0.38	0.33	0.34	2.16	2.15	2.16	31
中期 (3-7)	17,621	100.17	100.34	4.83	0.65	0.60	0.60	4.75	4.73	4.75	37
長期 (7-)	18,384	92.19	92.44	16.80	0.97	1.46	1.39	14.14	14.03	14.04	37
長期 (7-11)	7,008	98.72	98.94	8.65	0.82	1.00	0.99	8.33	8.29	8.33	42
超長期 (11-)	11,376	88.17	88.44	21.82	1.06	1.78	1.67	18.14	17.98	17.97	34
AAA 格	10,462	98.01	98.10	5.91	0.35	0.52	0.50	5.21	5.19	5.19	24
短期 (1-3)	4,131	99.75	99.79	2.21	0.13	0.23	0.23	2.21	2.20	2.21	20
中期 (3-7)	4,305	99.40	99.49	4.77	0.37	0.47	0.47	4.72	4.71	4.72	24
長期 (7-)	2,027	91.52	91.72	15.88	0.73	1.26	1.18	13.00	12.91	12.90	30
長期 (7-11)	1,220	97.46	97.60	8.44	0.53	0.87	0.86	8.24	8.20	8.23	30
超長期 (11-)	807	82.53	82.82	27.13	1.02	1.95	1.77	21.50	21.30	21.22	31
AA 格	39,594	97.00	97.21	9.16	0.78	0.91	0.88	7.82	7.77	7.78	38
短期 (1-3)	9,920	100.21	100.34	2.15	0.48	0.38	0.38	2.14	2.13	2.14	35
中期 (3-7)	13,317	100.42	100.62	4.85	0.74	0.64	0.64	4.76	4.74	4.75	40
長期 (7-)	16,357	92.28	92.54	16.91	1.00	1.49	1.42	14.28	14.17	14.18	38
長期 (7-11)	5,788	98.98	99.22	8.69	0.88	1.03	1.02	8.35	8.31	8.35	44
超長期 (11-)	10,569	88.61	88.87	21.42	1.06	1.77	1.66	17.90	17.74	17.74	34
A 格	21,229	97.28	97.48	5.67	0.73	1.06	1.03	5.29	5.25	5.28	73
短期 (1-3)	7,115	99.69	99.87	2.16	0.59	0.67	0.67	2.15	2.14	2.15	64
中期 (3-7)	8,514	98.73	98.90	4.82	0.66	0.92	0.91	4.73	4.70	4.73	68
長期 (7-)	5,600	92.03	92.28	11.42	1.00	1.82	1.72	10.52	10.43	10.50	93
長期 (7-11)	3,233	95.21	95.47	8.79	0.95	1.60	1.53	8.40	8.33	8.39	94
超長期 (11-)	2,367	87.69	87.93	15.02	1.06	2.14	2.00	13.66	13.53	13.62	92
BBB 格	1,008	98.42	98.67	4.06	0.91	1.17	1.15	3.85	3.83	3.85	98
短期 (1-3)	513	99.72	99.97	2.11	0.77	0.87	0.87	2.09	2.08	2.09	84
中期 (3-7)	375	98.51	98.76	4.70	1.07	1.39	1.38	4.57	4.54	4.57	115
長期 (7-)	119	92.53	92.78	10.48	1.02	1.83	1.76	9.67	9.58	9.66	105
長期 (7-11)	76	95.49	95.67	8.07	0.91	1.55	1.51	7.76	7.71	7.76	100
超長期 (11-)	43	87.26	87.61	14.76	1.21	2.38	2.23	13.39	13.24	13.35	116

出所:NFRG

- 格付は、格付会社4社の最高格付をもとに NFRG で分類

事業債 最高格付別・ポートフォリオ指標 (2023年11月末)

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
AAA~AA格	48,551	97.16	97.34	8.52	0.68	0.81	0.78	7.29	7.25	7.26	33
短期(1-3)	13,344	100.09	100.20	2.05	0.36	0.30	0.30	2.04	2.04	2.04	28
中期(3-7)	16,857	100.23	100.40	4.73	0.63	0.56	0.56	4.65	4.64	4.65	33
長期(7-)	18,350	92.20	92.45	16.71	0.96	1.45	1.39	14.07	13.96	13.97	37
長期(7-11)	6,998	98.80	99.02	8.55	0.82	0.99	0.98	8.25	8.21	8.24	42
超長期(11-)	11,352	88.13	88.40	21.74	1.05	1.78	1.66	18.08	17.93	17.92	34
AAA~A格	68,673	97.16	97.34	7.67	0.68	0.87	0.85	6.69	6.65	6.66	44
短期(1-3)	19,907	99.98	100.10	2.03	0.40	0.40	0.40	2.02	2.02	2.02	38
中期(3-7)	25,042	99.73	99.90	4.74	0.63	0.67	0.67	4.66	4.64	4.66	44
長期(7-)	23,725	92.09	92.34	15.49	0.96	1.53	1.45	13.25	13.15	13.17	49
長期(7-11)	10,096	97.57	97.80	8.59	0.84	1.17	1.14	8.26	8.22	8.26	57
超長期(11-)	13,629	88.03	88.30	20.61	1.04	1.83	1.71	17.35	17.20	17.20	42
AAA~BBB格	69,317	97.17	97.36	7.64	0.68	0.87	0.85	6.66	6.62	6.64	44
短期(1-3)	20,196	99.97	100.09	2.03	0.40	0.41	0.41	2.02	2.02	2.02	39
中期(3-7)	25,333	99.71	99.88	4.74	0.63	0.68	0.67	4.66	4.64	4.66	45
長期(7-)	23,787	92.09	92.34	15.48	0.96	1.53	1.45	13.24	13.14	13.16	49
長期(7-11)	10,138	97.56	97.79	8.58	0.84	1.17	1.14	8.26	8.21	8.26	57
超長期(11-)	13,649	88.03	88.29	20.60	1.04	1.83	1.71	17.35	17.19	17.20	43
AAA~BB格	69,317	97.17	97.36	7.64	0.68	0.87	0.85	6.66	6.62	6.64	44
短期(1-3)	20,196	99.97	100.09	2.03	0.40	0.41	0.41	2.02	2.02	2.02	39
中期(3-7)	25,333	99.71	99.88	4.74	0.63	0.68	0.67	4.66	4.64	4.66	45
長期(7-)	23,787	92.09	92.34	15.48	0.96	1.53	1.45	13.24	13.14	13.16	49
長期(7-11)	10,138	97.56	97.79	8.58	0.84	1.17	1.14	8.26	8.21	8.26	57
超長期(11-)	13,649	88.03	88.29	20.60	1.04	1.83	1.71	17.35	17.19	17.20	43
AAA格	10,284	97.97	98.06	5.87	0.34	0.51	0.50	5.16	5.14	5.14	24
短期(1-3)	3,897	99.78	99.81	2.07	0.13	0.22	0.22	2.07	2.07	2.07	20
中期(3-7)	4,390	99.36	99.45	4.66	0.34	0.46	0.46	4.61	4.59	4.61	24
長期(7-)	1,997	91.38	91.59	15.97	0.73	1.26	1.19	13.06	12.97	12.96	30
長期(7-11)	1,190	97.39	97.53	8.40	0.53	0.87	0.86	8.20	8.17	8.20	30
超長期(11-)	807	82.53	82.82	27.13	1.02	1.95	1.77	21.50	21.30	21.22	31
AA格	38,267	96.94	97.15	9.24	0.77	0.89	0.86	7.87	7.82	7.83	36
短期(1-3)	9,447	100.22	100.36	2.04	0.45	0.34	0.34	2.03	2.03	2.03	32
中期(3-7)	12,467	100.54	100.73	4.76	0.72	0.59	0.59	4.67	4.66	4.67	37
長期(7-)	16,353	92.30	92.56	16.80	0.99	1.48	1.41	14.19	14.08	14.09	38
長期(7-11)	5,808	99.08	99.33	8.59	0.88	1.01	1.01	8.26	8.22	8.25	44
超長期(11-)	10,545	88.56	88.83	21.33	1.05	1.76	1.66	17.84	17.68	17.68	34
A格	20,122	97.18	97.36	5.61	0.66	1.03	1.00	5.23	5.20	5.23	70
短期(1-3)	6,563	99.75	99.89	1.99	0.49	0.61	0.61	1.98	1.97	1.98	59
中期(3-7)	8,184	98.70	98.87	4.76	0.63	0.90	0.89	4.67	4.65	4.67	66
長期(7-)	5,375	91.72	91.97	11.34	0.94	1.78	1.68	10.47	10.38	10.45	90
長期(7-11)	3,099	94.80	95.04	8.66	0.89	1.58	1.51	8.30	8.23	8.29	94
超長期(11-)	2,277	87.53	87.78	14.98	1.00	2.08	1.93	13.67	13.54	13.63	85
BBB格	643	98.30	98.53	3.95	0.77	1.10	1.09	3.78	3.75	3.78	93
短期(1-3)	290	99.65	99.83	2.05	0.56	0.73	0.73	2.03	2.03	2.03	71
中期(3-7)	292	98.24	98.52	4.48	0.99	1.38	1.37	4.37	4.34	4.37	116
長期(7-)	62	92.28	92.53	10.28	0.78	1.60	1.53	9.59	9.51	9.58	84
長期(7-11)	42	95.34	95.57	7.83	0.70	1.36	1.33	7.60	7.55	7.60	83
超長期(11-)	20	85.84	86.16	15.41	0.93	2.15	2.00	14.22	14.08	14.18	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11月末、12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	48,808	97.16	97.34	8.60	0.69	0.82	0.79	7.37	7.32	7.33	34
短期 (1-3)	13,546	100.09	100.20	2.16	0.37	0.32	0.32	2.15	2.15	2.15	29
中期 (3-7)	16,940	100.21	100.38	4.85	0.64	0.58	0.58	4.76	4.75	4.76	34
長期 (7-)	18,322	92.18	92.43	16.82	0.97	1.46	1.39	14.16	14.05	14.06	37
長期 (7-11)	6,950	98.73	98.96	8.64	0.82	0.99	0.99	8.33	8.29	8.33	41
超長期 (11-)	11,372	88.17	88.44	21.82	1.06	1.78	1.67	18.14	17.98	17.97	34
AAA~A 格	68,285	97.16	97.34	7.80	0.68	0.88	0.85	6.81	6.77	6.78	43
短期 (1-3)	19,928	99.94	100.06	2.16	0.40	0.41	0.41	2.15	2.15	2.15	38
中期 (3-7)	24,619	99.77	99.94	4.86	0.64	0.67	0.66	4.77	4.75	4.77	43
長期 (7-)	23,738	92.11	92.36	15.59	0.97	1.54	1.46	13.33	13.22	13.25	49
長期 (7-11)	10,109	97.64	97.87	8.69	0.86	1.17	1.15	8.35	8.30	8.35	57
超長期 (11-)	13,629	88.01	88.27	20.71	1.05	1.84	1.72	17.42	17.27	17.28	43
AAA~BBB 格	68,908	97.17	97.35	7.77	0.69	0.88	0.85	6.78	6.74	6.75	44
短期 (1-3)	20,214	99.94	100.05	2.16	0.41	0.41	0.41	2.15	2.15	2.15	38
中期 (3-7)	24,894	99.76	99.92	4.85	0.64	0.67	0.67	4.77	4.75	4.77	44
長期 (7-)	23,800	92.11	92.36	15.57	0.97	1.54	1.46	13.32	13.21	13.24	49
長期 (7-11)	10,151	97.63	97.86	8.68	0.86	1.18	1.15	8.35	8.30	8.34	57
超長期 (11-)	13,649	88.01	88.27	20.70	1.05	1.84	1.72	17.42	17.27	17.27	43
AAA~BB 格	68,908	97.17	97.35	7.77	0.69	0.88	0.85	6.78	6.74	6.75	44
短期 (1-3)	20,214	99.94	100.05	2.16	0.41	0.41	0.41	2.15	2.15	2.15	38
中期 (3-7)	24,894	99.76	99.92	4.85	0.64	0.67	0.67	4.77	4.75	4.77	44
長期 (7-)	23,800	92.11	92.36	15.57	0.97	1.54	1.46	13.32	13.21	13.24	49
長期 (7-11)	10,151	97.63	97.86	8.68	0.86	1.18	1.15	8.35	8.30	8.34	57
超長期 (11-)	13,649	88.01	88.27	20.70	1.05	1.84	1.72	17.42	17.27	17.27	43
AAA 格	10,462	98.01	98.10	5.91	0.35	0.52	0.50	5.21	5.19	5.19	24
短期 (1-3)	4,131	99.75	99.79	2.21	0.13	0.23	0.23	2.21	2.20	2.21	20
中期 (3-7)	4,305	99.40	99.49	4.77	0.37	0.47	0.47	4.72	4.71	4.72	24
長期 (7-)	2,027	91.52	91.72	15.88	0.73	1.26	1.18	13.00	12.91	12.90	30
長期 (7-11)	1,220	97.46	97.60	8.44	0.53	0.87	0.86	8.24	8.20	8.23	30
超長期 (11-)	807	82.53	82.82	27.13	1.02	1.95	1.77	21.50	21.30	21.22	31
AA 格	38,346	96.93	97.14	9.33	0.78	0.90	0.87	7.96	7.91	7.92	37
短期 (1-3)	9,416	100.24	100.37	2.14	0.47	0.36	0.36	2.13	2.13	2.13	33
中期 (3-7)	12,635	100.49	100.68	4.88	0.73	0.62	0.62	4.78	4.76	4.78	38
長期 (7-)	16,295	92.26	92.52	16.94	1.00	1.49	1.42	14.30	14.19	14.20	38
長期 (7-11)	5,730	99.01	99.25	8.69	0.88	1.02	1.02	8.35	8.31	8.35	44
超長期 (11-)	10,565	88.60	88.87	21.42	1.06	1.77	1.66	17.90	17.75	17.74	34
A 格	19,477	97.15	97.33	5.80	0.68	1.02	0.99	5.41	5.38	5.41	68
短期 (1-3)	6,381	99.62	99.76	2.17	0.48	0.60	0.60	2.15	2.15	2.15	57
中期 (3-7)	7,679	98.81	98.97	4.88	0.63	0.86	0.85	4.79	4.77	4.79	61
長期 (7-)	5,416	91.88	92.12	11.40	0.96	1.79	1.69	10.52	10.43	10.50	91
長期 (7-11)	3,160	95.23	95.48	8.78	0.94	1.59	1.51	8.40	8.33	8.39	93
超長期 (11-)	2,257	87.18	87.41	15.07	0.99	2.11	1.96	13.77	13.64	13.73	87
BBB 格	623	98.25	98.49	4.04	0.79	1.12	1.11	3.87	3.84	3.87	94
短期 (1-3)	287	99.61	99.80	2.18	0.56	0.74	0.74	2.16	2.15	2.16	71
中期 (3-7)	275	98.19	98.46	4.57	1.02	1.42	1.40	4.46	4.43	4.46	119
長期 (7-)	62	92.28	92.53	10.28	0.78	1.60	1.53	9.59	9.51	9.58	84
長期 (7-11)	42	95.34	95.57	7.83	0.70	1.36	1.33	7.60	7.55	7.60	83
超長期 (11-)	20	85.84	86.16	15.41	0.93	2.15	2.00	14.22	14.08	14.18	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11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	9,299	96.32	96.46	8.02	0.55	0.77	0.74	6.70	6.66	6.67	35
短期(1-3)	2,711	100.02	100.12	2.03	0.34	0.30	0.30	2.02	2.02	2.02	28
中期(3-7)	3,722	99.51	99.64	4.66	0.49	0.58	0.58	4.60	4.59	4.60	36
長期(7-)	2,866	88.68	88.88	18.03	0.83	1.54	1.43	14.75	14.63	14.62	40
長期(7-11)	1,095	97.32	97.51	8.72	0.66	1.01	1.00	8.45	8.41	8.45	42
超長期(11-)	1,771	83.33	83.55	23.79	0.92	1.91	1.75	19.29	19.11	19.07	38
AAA~A格	65,071	97.14	97.32	7.77	0.67	0.86	0.84	6.76	6.72	6.73	43
短期(1-3)	18,665	99.98	100.10	2.03	0.39	0.39	0.39	2.02	2.01	2.02	37
中期(3-7)	23,523	99.76	99.92	4.72	0.61	0.65	0.65	4.64	4.63	4.64	42
長期(7-)	22,883	92.14	92.39	15.58	0.96	1.52	1.45	13.31	13.20	13.23	48
長期(7-11)	9,654	97.62	97.85	8.58	0.84	1.16	1.13	8.26	8.21	8.25	57
超長期(11-)	13,229	88.14	88.41	20.69	1.05	1.82	1.70	17.39	17.24	17.24	41
AAA~BBB格	69,077	97.16	97.34	7.64	0.67	0.87	0.84	6.67	6.62	6.64	44
短期(1-3)	20,196	99.97	100.09	2.03	0.40	0.41	0.41	2.02	2.02	2.02	39
中期(3-7)	25,118	99.69	99.86	4.73	0.62	0.67	0.66	4.65	4.64	4.65	44
長期(7-)	23,762	92.09	92.34	15.48	0.96	1.53	1.45	13.24	13.14	13.16	49
長期(7-11)	10,138	97.56	97.79	8.58	0.84	1.17	1.14	8.26	8.21	8.26	57
超長期(11-)	13,624	88.02	88.29	20.61	1.04	1.82	1.71	17.35	17.20	17.21	42
AAA~BB格	69,317	97.17	97.36	7.64	0.68	0.87	0.85	6.66	6.62	6.64	44
短期(1-3)	20,196	99.97	100.09	2.03	0.40	0.41	0.41	2.02	2.02	2.02	39
中期(3-7)	25,333	99.71	99.88	4.74	0.63	0.68	0.67	4.66	4.64	4.66	45
長期(7-)	23,787	92.09	92.34	15.48	0.96	1.53	1.45	13.24	13.14	13.16	49
長期(7-11)	10,138	97.56	97.79	8.58	0.84	1.17	1.14	8.26	8.21	8.26	57
超長期(11-)	13,649	88.03	88.29	20.60	1.04	1.83	1.71	17.35	17.19	17.20	43
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	96.32	96.46	8.02	0.55	0.77	0.74	6.70	6.66	6.67	35
短期(1-3)	2,711	100.02	100.12	2.03	0.34	0.30	0.30	2.02	2.02	2.02	28
中期(3-7)	3,722	99.51	99.64	4.66	0.49	0.58	0.58	4.60	4.59	4.60	36
長期(7-)	2,866	88.68	88.88	18.03	0.83	1.54	1.43	14.75	14.63	14.62	40
長期(7-11)	1,095	97.32	97.51	8.72	0.66	1.01	1.00	8.45	8.41	8.45	42
超長期(11-)	1,771	83.33	83.55	23.79	0.92	1.91	1.75	19.29	19.11	19.07	38
A格	55,772	97.28	97.47	7.73	0.69	0.88	0.85	6.77	6.73	6.74	44
短期(1-3)	15,955	99.97	100.09	2.03	0.40	0.41	0.41	2.02	2.01	2.02	39
中期(3-7)	19,801	99.80	99.98	4.73	0.64	0.66	0.66	4.65	4.64	4.65	43
長期(7-)	20,017	92.64	92.90	15.23	0.98	1.52	1.45	13.11	13.01	13.03	49
長期(7-11)	8,559	97.66	97.90	8.56	0.86	1.18	1.15	8.23	8.18	8.23	58
超長期(11-)	11,458	88.88	89.16	20.21	1.06	1.80	1.69	17.12	16.97	16.98	42
BBB格	4,005	97.44	97.61	5.57	0.67	0.96	0.94	5.11	5.08	5.10	66
短期(1-3)	1,531	99.89	100.05	2.07	0.53	0.59	0.58	2.06	2.05	2.06	56
中期(3-7)	1,595	98.74	98.91	4.89	0.68	0.96	0.95	4.80	4.78	4.80	71
長期(7-)	880	90.80	91.00	12.88	0.88	1.67	1.58	11.55	11.45	11.51	73
長期(7-11)	485	96.38	96.57	8.68	0.86	1.34	1.30	8.35	8.29	8.34	73
超長期(11-)	395	83.95	84.17	18.03	0.90	2.15	1.97	16.05	15.89	15.97	73
BB格	240	101.18	101.61	6.49	2.26	1.91	1.92	5.85	5.79	5.84	156
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	215	102.12	102.59	5.33	2.25	1.80	1.81	5.03	4.98	5.03	154
長期(7-)	25	93.16	93.17	16.49	2.37	2.99	2.89	13.63	13.43	13.53	172
長期(7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期(11-)	25	93.16	93.17	16.49	2.37	2.99	2.89	13.63	13.43	13.53	172
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11月末、12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	9,935	96.63	96.78	7.82	0.60	0.79	0.76	6.57	6.53	6.54	38
短期(1-3)	2,983	100.14	100.27	2.10	0.44	0.36	0.36	2.09	2.08	2.09	34
中期(3-7)	4,080	99.59	99.72	4.82	0.56	0.64	0.63	4.75	4.73	4.75	40
長期(7-)	2,872	88.77	88.98	18.02	0.84	1.54	1.44	14.73	14.61	14.60	40
長期(7-11)	1,121	97.51	97.71	8.78	0.71	1.03	1.02	8.49	8.45	8.49	43
超長期(11-)	1,751	83.17	83.39	23.93	0.93	1.92	1.76	19.40	19.22	19.19	38
AAA~A格	64,718	97.12	97.30	7.90	0.68	0.87	0.84	6.88	6.84	6.85	42
短期(1-3)	18,753	99.95	100.06	2.17	0.40	0.40	0.40	2.16	2.15	2.15	37
中期(3-7)	23,035	99.79	99.95	4.84	0.62	0.65	0.65	4.76	4.74	4.76	41
長期(7-)	22,931	92.12	92.37	15.67	0.97	1.53	1.46	13.38	13.28	13.30	48
長期(7-11)	9,648	97.67	97.90	8.67	0.85	1.17	1.14	8.34	8.29	8.34	57
超長期(11-)	13,283	88.09	88.35	20.75	1.05	1.83	1.71	17.45	17.29	17.30	42
AAA~BBB格	68,668	97.15	97.33	7.77	0.68	0.87	0.85	6.79	6.74	6.76	43
短期(1-3)	20,214	99.94	100.05	2.16	0.41	0.41	0.41	2.15	2.15	2.15	38
中期(3-7)	24,679	99.74	99.90	4.85	0.63	0.66	0.66	4.77	4.75	4.76	43
長期(7-)	23,775	92.11	92.36	15.57	0.97	1.54	1.46	13.32	13.21	13.24	49
長期(7-11)	10,151	97.63	97.86	8.68	0.86	1.18	1.15	8.35	8.30	8.34	57
超長期(11-)	13,624	88.00	88.26	20.71	1.05	1.83	1.72	17.43	17.27	17.28	43
AAA~BB格	68,908	97.17	97.35	7.77	0.69	0.88	0.85	6.78	6.74	6.75	44
短期(1-3)	20,214	99.94	100.05	2.16	0.41	0.41	0.41	2.15	2.15	2.15	38
中期(3-7)	24,894	99.76	99.92	4.85	0.64	0.67	0.67	4.77	4.75	4.77	44
長期(7-)	23,800	92.11	92.36	15.57	0.97	1.54	1.46	13.32	13.21	13.24	49
長期(7-11)	10,151	97.63	97.86	8.68	0.86	1.18	1.15	8.35	8.30	8.34	57
超長期(11-)	13,649	88.01	88.27	20.70	1.05	1.84	1.72	17.42	17.27	17.27	43
AAA格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA格	9,935	96.63	96.78	7.82	0.60	0.79	0.76	6.57	6.53	6.54	38
短期(1-3)	2,983	100.14	100.27	2.10	0.44	0.36	0.36	2.09	2.08	2.09	34
中期(3-7)	4,080	99.59	99.72	4.82	0.56	0.64	0.63	4.75	4.73	4.75	40
長期(7-)	2,872	88.77	88.98	18.02	0.84	1.54	1.44	14.73	14.61	14.60	40
長期(7-11)	1,121	97.51	97.71	8.78	0.71	1.03	1.02	8.49	8.45	8.49	43
超長期(11-)	1,751	83.17	83.39	23.93	0.93	1.92	1.76	19.40	19.22	19.19	38
A格	54,783	97.21	97.39	7.92	0.69	0.89	0.86	6.94	6.90	6.91	43
短期(1-3)	15,770	99.91	100.03	2.18	0.39	0.41	0.41	2.17	2.16	2.17	38
中期(3-7)	18,955	99.83	100.00	4.84	0.64	0.65	0.65	4.76	4.74	4.76	41
長期(7-)	20,058	92.60	92.86	15.33	0.99	1.53	1.46	13.20	13.10	13.12	50
長期(7-11)	8,527	97.69	97.93	8.66	0.87	1.19	1.16	8.32	8.27	8.31	58
超長期(11-)	11,532	88.84	89.11	20.27	1.07	1.81	1.70	17.17	17.02	17.03	42
BBB格	3,950	97.74	97.91	5.64	0.69	0.92	0.90	5.19	5.16	5.18	61
短期(1-3)	1,462	99.78	99.94	2.14	0.54	0.56	0.56	2.13	2.12	2.13	53
中期(3-7)	1,644	98.96	99.13	5.00	0.69	0.90	0.89	4.91	4.88	4.91	64
長期(7-)	845	91.84	92.05	12.94	0.94	1.63	1.54	11.55	11.46	11.51	69
長期(7-11)	504	96.89	97.08	8.89	0.93	1.34	1.31	8.53	8.47	8.52	71
超長期(11-)	341	84.38	84.61	18.92	0.95	2.11	1.94	16.68	16.51	16.58	65
BB格	240	101.18	101.61	6.49	2.26	1.91	1.92	5.85	5.79	5.84	156
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	215	102.12	102.59	5.33	2.25	1.80	1.81	5.03	4.98	5.03	154
長期(7-)	25	93.16	93.17	16.49	2.37	2.99	2.89	13.63	13.43	13.53	172
長期(7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期(11-)	25	93.16	93.17	16.49	2.37	2.99	2.89	13.63	13.43	13.53	172
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11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	36,379	97.21	97.41	9.29	0.71	0.79	0.77	7.81	7.76	7.77	28
短期 (1-3)	9,561	100.07	100.16	2.03	0.29	0.25	0.25	2.03	2.02	2.03	23
中期 (3-7)	12,127	100.70	100.87	4.68	0.66	0.50	0.50	4.60	4.59	4.60	28
長期 (7-)	14,691	92.47	92.75	17.81	1.03	1.44	1.37	14.76	14.65	14.65	31
長期 (7-11)	4,971	100.08	100.35	8.66	0.91	0.91	0.91	8.31	8.28	8.31	34
超長期 (11-)	9,720	88.58	88.87	22.49	1.09	1.75	1.64	18.49	18.33	18.31	30
AAA~A 格	62,456	97.21	97.39	7.89	0.68	0.85	0.82	6.85	6.81	6.82	40
短期 (1-3)	17,869	100.02	100.13	2.04	0.38	0.36	0.36	2.03	2.02	2.03	34
中期 (3-7)	22,374	99.96	100.12	4.73	0.64	0.64	0.64	4.65	4.63	4.65	41
長期 (7-)	22,213	92.20	92.45	15.79	0.96	1.50	1.43	13.45	13.34	13.36	45
長期 (7-11)	9,199	98.06	98.29	8.59	0.83	1.09	1.08	8.27	8.22	8.26	51
超長期 (11-)	13,014	88.05	88.31	20.89	1.05	1.82	1.70	17.53	17.37	17.38	41
AAA~BBB 格	63,237	97.20	97.38	7.86	0.68	0.85	0.83	6.82	6.78	6.79	41
短期 (1-3)	18,187	100.00	100.12	2.04	0.38	0.37	0.37	2.03	2.02	2.03	35
中期 (3-7)	22,684	99.92	100.09	4.73	0.65	0.65	0.65	4.64	4.63	4.64	42
長期 (7-)	22,366	92.16	92.41	15.76	0.96	1.50	1.43	13.43	13.33	13.35	46
長期 (7-11)	9,267	98.01	98.23	8.58	0.83	1.10	1.09	8.26	8.22	8.26	52
超長期 (11-)	13,099	88.03	88.29	20.85	1.05	1.82	1.71	17.50	17.35	17.35	41
AAA~BB 格	63,237	97.20	97.38	7.86	0.68	0.85	0.83	6.82	6.78	6.79	41
短期 (1-3)	18,187	100.00	100.12	2.04	0.38	0.37	0.37	2.03	2.02	2.03	35
中期 (3-7)	22,684	99.92	100.09	4.73	0.65	0.65	0.65	4.64	4.63	4.64	42
長期 (7-)	22,366	92.16	92.41	15.76	0.96	1.50	1.43	13.43	13.33	13.35	46
長期 (7-11)	9,267	98.01	98.23	8.58	0.83	1.10	1.09	8.26	8.22	8.26	52
超長期 (11-)	13,099	88.03	88.29	20.85	1.05	1.82	1.71	17.50	17.35	17.35	41
AAA 格	755	98.62	98.70	4.32	0.23	0.47	0.47	4.22	4.20	4.21	27
短期 (1-3)	320	99.62	99.65	2.12	0.11	0.27	0.27	2.12	2.12	2.12	25
中期 (3-7)	275	99.22	99.31	4.05	0.26	0.45	0.44	4.03	4.02	4.03	28
長期 (7-)	160	95.57	95.76	9.18	0.44	0.95	0.93	8.92	8.87	8.91	31
長期 (7-11)	130	96.78	96.96	8.33	0.43	0.87	0.85	8.16	8.12	8.16	30
超長期 (11-)	30	90.34	90.56	12.84	0.45	1.33	1.27	12.43	12.36	12.43	32
AA 格	35,624	97.18	97.38	9.39	0.72	0.80	0.77	7.89	7.84	7.84	28
短期 (1-3)	9,241	100.09	100.18	2.03	0.30	0.25	0.25	2.02	2.02	2.02	23
中期 (3-7)	11,852	100.73	100.91	4.69	0.67	0.50	0.50	4.61	4.60	4.61	28
長期 (7-)	14,531	92.44	92.72	17.91	1.04	1.45	1.38	14.83	14.71	14.71	31
長期 (7-11)	4,841	100.17	100.44	8.67	0.93	0.91	0.91	8.32	8.28	8.31	34
超長期 (11-)	9,690	88.58	88.86	22.52	1.09	1.75	1.64	18.51	18.35	18.32	30
A 格	26,076	97.22	97.38	5.95	0.64	0.92	0.90	5.50	5.47	5.50	58
短期 (1-3)	8,308	99.95	100.09	2.04	0.49	0.49	0.49	2.03	2.03	2.03	47
中期 (3-7)	10,247	99.08	99.24	4.79	0.63	0.81	0.80	4.70	4.68	4.70	57
長期 (7-)	7,522	91.66	91.85	11.85	0.82	1.61	1.54	10.86	10.77	10.83	74
長期 (7-11)	4,228	95.69	95.87	8.50	0.74	1.31	1.29	8.21	8.16	8.21	73
超長期 (11-)	3,294	86.47	86.69	16.16	0.93	2.03	1.89	14.62	14.48	14.56	75
BBB 格	781	96.01	96.22	4.85	0.66	1.46	1.41	4.52	4.48	4.52	118
短期 (1-3)	319	99.25	99.42	2.02	0.54	1.13	1.13	2.01	2.00	2.01	111
中期 (3-7)	310	97.13	97.37	4.47	0.72	1.46	1.43	4.39	4.36	4.39	122
長期 (7-)	153	86.99	87.23	11.53	0.79	2.23	2.04	10.76	10.65	10.75	124
長期 (7-11)	68	90.10	90.34	7.85	0.68	2.14	1.95	7.62	7.54	7.61	146
超長期 (11-)	85	84.51	84.75	14.48	0.88	2.30	2.12	13.45	13.31	13.42	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	96.92	97.10	5.34	0.63	1.09	1.04	5.03	4.99	5.02	76
短期 (1-3)	2,009	99.72	99.87	1.98	0.56	0.74	0.74	1.97	1.96	1.97	72
中期 (3-7)	2,650	97.97	98.12	4.85	0.50	0.93	0.91	4.78	4.76	4.78	67
長期 (7-)	1,421	90.98	91.28	11.00	0.96	1.96	1.77	10.25	10.16	10.23	102
長期 (7-11)	871	92.82	93.12	8.61	0.95	1.93	1.75	8.22	8.14	8.21	118
超長期 (11-)	550	88.08	88.37	14.80	0.98	1.99	1.82	13.63	13.51	13.60	75

出所:NFRC

- 格付は、R&Iの格付をもとにNFRCで分類

事業債 R&I 格付別・ポートフォリオ指標 (2023年11月末、12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	37,020	97.30	97.49	9.30	0.74	0.81	0.78	7.84	7.79	7.79	29
短期 (1-3)	9,998	100.15	100.25	2.17	0.35	0.28	0.28	2.16	2.16	2.16	25
中期 (3-7)	12,315	100.76	100.94	4.82	0.70	0.53	0.53	4.73	4.72	4.73	30
長期 (7-)	14,707	92.46	92.73	17.90	1.03	1.45	1.38	14.84	14.72	14.72	31
長期 (7-11)	4,968	99.99	100.25	8.74	0.91	0.92	0.92	8.39	8.35	8.39	34
超長期 (11-)	9,739	88.62	88.90	22.58	1.10	1.75	1.65	18.55	18.39	18.36	30
AAA~A 格	62,295	97.19	97.37	8.02	0.69	0.86	0.83	6.96	6.92	6.93	41
短期 (1-3)	17,979	100.01	100.12	2.17	0.39	0.37	0.37	2.16	2.15	2.16	34
中期 (3-7)	21,990	99.96	100.13	4.84	0.66	0.65	0.65	4.75	4.74	4.75	41
長期 (7-)	22,326	92.20	92.45	15.87	0.97	1.51	1.44	13.52	13.41	13.43	46
長期 (7-11)	9,207	98.05	98.27	8.68	0.84	1.10	1.09	8.35	8.30	8.35	51
超長期 (11-)	13,119	88.09	88.36	20.92	1.06	1.83	1.71	17.55	17.40	17.40	41
AAA~BBB 格	62,911	97.19	97.37	7.99	0.69	0.86	0.84	6.94	6.89	6.91	41
短期 (1-3)	18,248	99.99	100.10	2.17	0.39	0.38	0.38	2.16	2.15	2.16	35
中期 (3-7)	22,249	99.94	100.11	4.84	0.66	0.65	0.65	4.75	4.74	4.75	42
長期 (7-)	22,414	92.19	92.43	15.85	0.97	1.51	1.44	13.50	13.39	13.41	46
長期 (7-11)	9,275	97.99	98.21	8.67	0.84	1.11	1.10	8.35	8.30	8.34	52
超長期 (11-)	13,139	88.09	88.36	20.92	1.06	1.83	1.71	17.55	17.39	17.39	41
AAA~BB 格	62,911	97.19	97.37	7.99	0.69	0.86	0.84	6.94	6.89	6.91	41
短期 (1-3)	18,248	99.99	100.10	2.17	0.39	0.38	0.38	2.16	2.15	2.16	35
中期 (3-7)	22,249	99.94	100.11	4.84	0.66	0.65	0.65	4.75	4.74	4.75	42
長期 (7-)	22,414	92.19	92.43	15.85	0.97	1.51	1.44	13.50	13.39	13.41	46
長期 (7-11)	9,275	97.99	98.21	8.67	0.84	1.11	1.10	8.35	8.30	8.34	52
超長期 (11-)	13,139	88.09	88.36	20.92	1.06	1.83	1.71	17.55	17.39	17.39	41
AAA 格	915	98.90	98.98	4.24	0.27	0.47	0.46	4.15	4.13	4.15	27
短期 (1-3)	400	99.73	99.75	2.27	0.16	0.28	0.28	2.27	2.26	2.27	25
中期 (3-7)	355	99.47	99.55	4.23	0.33	0.46	0.46	4.20	4.19	4.20	28
長期 (7-)	160	95.57	95.76	9.18	0.44	0.95	0.93	8.92	8.87	8.91	31
長期 (7-11)	130	96.78	96.96	8.33	0.43	0.87	0.85	8.16	8.12	8.16	30
超長期 (11-)	30	90.34	90.56	12.84	0.45	1.33	1.27	12.43	12.36	12.43	32
AA 格	36,105	97.26	97.46	9.43	0.75	0.82	0.79	7.93	7.88	7.88	29
短期 (1-3)	9,598	100.17	100.28	2.17	0.36	0.28	0.28	2.16	2.15	2.16	25
中期 (3-7)	11,960	100.79	100.98	4.83	0.71	0.53	0.53	4.74	4.73	4.74	30
長期 (7-)	14,547	92.43	92.70	18.00	1.04	1.45	1.39	14.91	14.79	14.79	31
長期 (7-11)	4,838	100.07	100.34	8.75	0.92	0.92	0.92	8.40	8.36	8.39	34
超長期 (11-)	9,709	88.61	88.90	22.61	1.10	1.75	1.65	18.57	18.41	18.38	30
A 格	25,275	97.04	97.20	6.15	0.62	0.93	0.91	5.68	5.65	5.68	58
短期 (1-3)	7,980	99.82	99.95	2.16	0.43	0.48	0.48	2.15	2.14	2.15	45
中期 (3-7)	9,676	98.95	99.10	4.87	0.60	0.80	0.80	4.79	4.77	4.79	56
長期 (7-)	7,619	91.70	91.89	11.95	0.84	1.62	1.55	10.94	10.85	10.92	74
長期 (7-11)	4,239	95.78	95.95	8.60	0.76	1.32	1.30	8.30	8.24	8.29	73
超長期 (11-)	3,380	86.58	86.80	16.16	0.94	2.04	1.90	14.61	14.47	14.56	76
BBB 格	616	97.02	97.24	4.30	0.68	1.26	1.22	4.11	4.08	4.11	103
短期 (1-3)	270	98.57	98.75	2.26	0.56	1.08	1.06	2.24	2.22	2.24	102
中期 (3-7)	259	98.10	98.34	4.64	0.79	1.19	1.17	4.54	4.51	4.54	95
長期 (7-)	88	89.13	89.39	9.57	0.74	2.14	1.96	9.06	8.97	9.05	133
長期 (7-11)	68	90.10	90.34	7.85	0.68	2.14	1.95	7.62	7.54	7.61	146
超長期 (11-)	20	85.84	86.16	15.41	0.93	2.15	2.00	14.22	14.08	14.18	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	5,997	96.93	97.12	5.47	0.64	1.05	1.00	5.15	5.12	5.15	71
短期 (1-3)	1,966	99.46	99.62	2.14	0.57	0.73	0.71	2.12	2.11	2.12	69
中期 (3-7)	2,645	98.23	98.37	4.99	0.51	0.85	0.83	4.91	4.89	4.91	58
長期 (7-)	1,386	90.86	91.16	11.13	0.98	1.98	1.80	10.35	10.26	10.34	103
長期 (7-11)	876	93.81	94.15	8.82	1.06	1.92	1.74	8.38	8.31	8.38	115
超長期 (11-)	510	85.80	86.04	15.09	0.85	2.11	1.90	14.06	13.93	14.02	80

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11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	27,506	97.38	97.51	6.25	0.49	0.72	0.70	5.62	5.59	5.60	38
短期 (1-3)	9,147	99.97	100.07	2.05	0.33	0.33	0.33	2.05	2.04	2.05	31
中期 (3-7)	10,838	99.29	99.41	4.69	0.46	0.59	0.59	4.63	4.62	4.63	37
長期 (7-)	7,521	91.47	91.66	13.59	0.74	1.42	1.35	11.91	11.82	11.85	50
長期 (7-11)	4,152	96.61	96.77	8.43	0.61	1.07	1.05	8.20	8.16	8.20	49
超長期 (11-)	3,369	85.13	85.36	19.95	0.89	1.92	1.77	17.09	16.93	16.96	50
AAA~A 格	39,903	97.14	97.29	6.13	0.56	0.85	0.83	5.57	5.53	5.56	51
短期 (1-3)	12,885	99.87	99.98	2.05	0.37	0.44	0.43	2.04	2.03	2.04	41
中期 (3-7)	15,787	99.08	99.22	4.73	0.53	0.72	0.71	4.65	4.64	4.65	49
長期 (7-)	11,231	91.27	91.48	12.77	0.80	1.59	1.50	11.38	11.29	11.34	67
長期 (7-11)	6,312	95.55	95.74	8.50	0.71	1.30	1.25	8.22	8.17	8.22	69
超長期 (11-)	4,919	85.79	86.02	18.25	0.93	2.00	1.85	15.89	15.74	15.79	65
AAA~BBB 格	40,319	97.15	97.30	6.10	0.56	0.86	0.83	5.55	5.52	5.54	52
短期 (1-3)	13,077	99.87	99.97	2.05	0.38	0.44	0.44	2.04	2.03	2.04	42
中期 (3-7)	15,965	99.07	99.21	4.72	0.54	0.73	0.72	4.65	4.63	4.65	50
長期 (7-)	11,278	91.27	91.48	12.76	0.81	1.59	1.50	11.38	11.29	11.34	67
長期 (7-11)	6,339	95.55	95.74	8.50	0.71	1.30	1.25	8.22	8.17	8.22	69
超長期 (11-)	4,939	85.79	86.02	18.24	0.93	2.00	1.85	15.88	15.74	15.79	65
AAA~BB 格	40,319	97.15	97.30	6.10	0.56	0.86	0.83	5.55	5.52	5.54	52
短期 (1-3)	13,077	99.87	99.97	2.05	0.38	0.44	0.44	2.04	2.03	2.04	42
中期 (3-7)	15,965	99.07	99.21	4.72	0.54	0.73	0.72	4.65	4.63	4.65	50
長期 (7-)	11,278	91.27	91.48	12.76	0.81	1.59	1.50	11.38	11.29	11.34	67
長期 (7-11)	6,339	95.55	95.74	8.50	0.71	1.30	1.25	8.22	8.17	8.22	69
超長期 (11-)	4,939	85.79	86.02	18.24	0.93	2.00	1.85	15.88	15.74	15.79	65
AAA 格	9,939	97.91	98.01	5.98	0.34	0.52	0.51	5.25	5.22	5.23	24
短期 (1-3)	3,687	99.78	99.82	2.08	0.13	0.22	0.22	2.07	2.07	2.07	20
中期 (3-7)	4,255	99.36	99.45	4.68	0.34	0.46	0.46	4.63	4.62	4.63	24
長期 (7-)	1,997	91.38	91.59	15.97	0.73	1.26	1.19	13.06	12.97	12.96	30
長期 (7-11)	1,190	97.39	97.53	8.40	0.53	0.87	0.86	8.20	8.17	8.20	30
超長期 (11-)	807	82.53	82.82	27.13	1.02	1.95	1.77	21.50	21.30	21.22	31
AA 格	17,568	97.08	97.23	6.40	0.58	0.83	0.80	5.83	5.80	5.82	46
短期 (1-3)	5,460	100.10	100.23	2.04	0.47	0.40	0.40	2.03	2.02	2.03	38
中期 (3-7)	6,583	99.25	99.38	4.70	0.54	0.68	0.68	4.63	4.62	4.63	45
長期 (7-)	5,524	91.50	91.69	12.73	0.74	1.48	1.41	11.49	11.40	11.45	56
長期 (7-11)	2,962	96.30	96.46	8.44	0.65	1.15	1.13	8.20	8.15	8.20	57
超長期 (11-)	2,562	85.95	86.16	17.68	0.85	1.91	1.77	15.75	15.61	15.67	56
A 格	12,397	96.61	96.80	5.85	0.70	1.16	1.12	5.45	5.41	5.45	81
短期 (1-3)	3,738	99.63	99.76	2.03	0.48	0.69	0.69	2.02	2.02	2.02	67
中期 (3-7)	4,949	98.63	98.81	4.80	0.69	1.00	0.98	4.70	4.68	4.70	75
長期 (7-)	3,710	90.87	91.13	11.11	0.94	1.92	1.80	10.31	10.22	10.29	103
長期 (7-11)	2,160	93.50	93.75	8.64	0.89	1.76	1.65	8.27	8.20	8.27	108
超長期 (11-)	1,550	87.21	87.46	14.56	1.02	2.17	2.01	13.36	13.22	13.32	95
BBB 格	417	98.09	98.35	4.05	0.83	1.19	1.17	3.83	3.81	3.83	100
短期 (1-3)	192	99.65	99.83	1.93	0.52	0.70	0.70	1.91	1.91	1.91	68
中期 (3-7)	178	98.11	98.44	4.48	1.17	1.60	1.59	4.35	4.31	4.35	138
長期 (7-)	47	91.62	91.90	11.11	0.85	1.67	1.59	10.28	10.20	10.27	84
長期 (7-11)	27	95.90	96.15	7.93	0.78	1.35	1.32	7.67	7.62	7.67	82
超長期 (11-)	20	85.84	86.16	15.41	0.93	2.15	2.00	14.22	14.08	14.18	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	97.21	97.44	9.77	0.84	0.90	0.87	8.21	8.16	8.16	34
短期 (1-3)	7,119	100.17	100.31	2.00	0.45	0.35	0.35	1.99	1.99	1.99	34
中期 (3-7)	9,369	100.80	101.02	4.77	0.78	0.59	0.59	4.67	4.65	4.67	37
長期 (7-)	12,510	92.83	93.12	17.93	1.09	1.48	1.41	14.90	14.78	14.78	33
長期 (7-11)	3,799	100.92	101.22	8.72	1.07	0.96	0.96	8.32	8.28	8.31	39
超長期 (11-)	8,710	89.30	89.58	21.94	1.11	1.73	1.63	18.14	17.99	17.97	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11月末、12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	27,823	97.39	97.52	6.30	0.50	0.73	0.71	5.68	5.65	5.66	39
短期 (1-3)	9,433	99.94	100.04	2.15	0.33	0.35	0.35	2.14	2.14	2.14	32
中期 (3-7)	10,883	99.25	99.37	4.82	0.48	0.62	0.62	4.76	4.74	4.75	38
長期 (7-)	7,508	91.49	91.68	13.65	0.74	1.42	1.35	11.96	11.87	11.91	49
長期 (7-11)	4,143	96.66	96.81	8.50	0.62	1.07	1.05	8.26	8.22	8.26	49
超長期 (11-)	3,365	85.12	85.36	20.00	0.89	1.92	1.77	17.13	16.97	17.00	50
AAA~A 格	39,759	97.14	97.29	6.23	0.57	0.85	0.83	5.66	5.63	5.65	50
短期 (1-3)	13,012	99.80	99.90	2.16	0.37	0.43	0.43	2.15	2.15	2.15	40
中期 (3-7)	15,491	99.13	99.27	4.84	0.55	0.71	0.71	4.76	4.74	4.76	47
長期 (7-)	11,256	91.34	91.55	12.83	0.82	1.59	1.50	11.43	11.34	11.39	67
長期 (7-11)	6,311	95.62	95.81	8.58	0.72	1.30	1.26	8.29	8.24	8.29	69
超長期 (11-)	4,945	85.88	86.12	18.27	0.94	2.00	1.85	15.90	15.75	15.80	65
AAA~BBB 格	40,156	97.15	97.30	6.21	0.57	0.86	0.83	5.64	5.61	5.63	51
短期 (1-3)	13,194	99.80	99.90	2.16	0.37	0.44	0.44	2.15	2.15	2.15	41
中期 (3-7)	15,659	99.12	99.26	4.83	0.56	0.72	0.72	4.75	4.74	4.75	48
長期 (7-)	11,303	91.34	91.55	12.83	0.82	1.59	1.50	11.43	11.34	11.39	67
長期 (7-11)	6,338	95.62	95.81	8.57	0.72	1.30	1.26	8.29	8.23	8.28	69
超長期 (11-)	4,965	85.88	86.12	18.26	0.94	2.00	1.85	15.89	15.74	15.80	65
AAA~BB 格	40,156	97.15	97.30	6.21	0.57	0.86	0.83	5.64	5.61	5.63	51
短期 (1-3)	13,194	99.80	99.90	2.16	0.37	0.44	0.44	2.15	2.15	2.15	41
中期 (3-7)	15,659	99.12	99.26	4.83	0.56	0.72	0.72	4.75	4.74	4.75	48
長期 (7-)	11,303	91.34	91.55	12.83	0.82	1.59	1.50	11.43	11.34	11.39	67
長期 (7-11)	6,338	95.62	95.81	8.57	0.72	1.30	1.26	8.29	8.23	8.28	69
超長期 (11-)	4,965	85.88	86.12	18.26	0.94	2.00	1.85	15.89	15.74	15.80	65
AAA 格	9,957	97.92	98.02	6.05	0.35	0.53	0.51	5.32	5.30	5.30	24
短期 (1-3)	3,841	99.75	99.79	2.21	0.13	0.23	0.23	2.20	2.20	2.20	20
中期 (3-7)	4,090	99.38	99.47	4.80	0.37	0.47	0.47	4.74	4.73	4.74	24
長期 (7-)	2,027	91.52	91.72	15.88	0.73	1.26	1.18	13.00	12.91	12.90	30
長期 (7-11)	1,220	97.46	97.60	8.44	0.53	0.87	0.86	8.24	8.20	8.23	30
超長期 (11-)	807	82.53	82.82	27.13	1.02	1.95	1.77	21.50	21.30	21.22	31
AA 格	17,866	97.09	97.25	6.44	0.59	0.84	0.82	5.88	5.84	5.87	47
短期 (1-3)	5,592	100.07	100.21	2.12	0.48	0.43	0.43	2.10	2.10	2.10	40
中期 (3-7)	6,793	99.17	99.31	4.84	0.56	0.71	0.71	4.76	4.74	4.76	47
長期 (7-)	5,481	91.48	91.66	12.83	0.75	1.49	1.41	11.58	11.49	11.54	56
長期 (7-11)	2,923	96.32	96.48	8.52	0.66	1.15	1.13	8.27	8.23	8.27	57
超長期 (11-)	2,558	85.94	86.15	17.75	0.85	1.91	1.78	15.81	15.66	15.73	56
A 格	11,936	96.57	96.76	6.05	0.72	1.14	1.10	5.63	5.59	5.62	77
短期 (1-3)	3,580	99.43	99.55	2.19	0.47	0.67	0.66	2.18	2.17	2.18	63
中期 (3-7)	4,609	98.84	99.02	4.86	0.70	0.93	0.92	4.77	4.74	4.77	68
長期 (7-)	3,748	91.05	91.30	11.19	0.97	1.93	1.81	10.37	10.27	10.35	104
長期 (7-11)	2,168	93.64	93.89	8.73	0.92	1.77	1.67	8.34	8.27	8.34	109
超長期 (11-)	1,580	87.50	87.75	14.57	1.05	2.17	2.01	13.35	13.21	13.31	96
BBB 格	397	98.00	98.26	4.20	0.86	1.22	1.20	3.98	3.95	3.98	102
短期 (1-3)	182	99.61	99.79	2.09	0.53	0.71	0.71	2.07	2.06	2.07	69
中期 (3-7)	168	98.05	98.39	4.56	1.22	1.65	1.64	4.43	4.39	4.43	143
長期 (7-)	47	91.62	91.90	11.11	0.85	1.67	1.59	10.28	10.20	10.27	84
長期 (7-11)	27	95.90	96.15	7.93	0.78	1.35	1.32	7.67	7.62	7.67	82
超長期 (11-)	20	85.84	86.16	15.41	0.93	2.15	2.00	14.22	14.08	14.18	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	28,752	97.19	97.42	9.95	0.85	0.91	0.88	8.37	8.31	8.32	34
短期 (1-3)	7,020	100.19	100.34	2.17	0.47	0.37	0.37	2.15	2.15	2.15	34
中期 (3-7)	9,235	100.84	101.05	4.89	0.79	0.60	0.60	4.79	4.77	4.79	36
長期 (7-)	12,498	92.81	93.09	18.06	1.10	1.49	1.42	15.00	14.88	14.88	33
長期 (7-11)	3,813	100.97	101.27	8.87	1.08	0.97	0.98	8.45	8.40	8.44	38
超長期 (11-)	8,684	89.22	89.50	22.09	1.11	1.74	1.64	18.26	18.10	18.08	31

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11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	22,773	97.91	98.10	8.81	0.73	0.79	0.77	7.57	7.53	7.53	29
短期 (1-3)	6,331	100.17	100.27	2.04	0.36	0.26	0.27	2.03	2.03	2.03	24
中期 (3-7)	7,474	100.59	100.74	4.57	0.63	0.49	0.49	4.49	4.48	4.49	28
長期 (7-)	8,968	94.09	94.37	17.12	1.09	1.44	1.39	14.47	14.36	14.36	33
長期 (7-11)	3,052	99.49	99.71	8.63	0.86	0.95	0.95	8.31	8.27	8.31	38
超長期 (11-)	5,916	91.30	91.61	21.50	1.20	1.72	1.64	17.92	17.77	17.76	31
AAA~BBB 格	25,490	97.88	98.07	8.55	0.73	0.80	0.78	7.39	7.34	7.35	32
短期 (1-3)	7,110	100.15	100.25	2.04	0.36	0.27	0.27	2.03	2.03	2.03	25
中期 (3-7)	8,715	100.46	100.62	4.65	0.66	0.55	0.55	4.57	4.56	4.57	34
長期 (7-)	9,665	93.89	94.16	16.86	1.08	1.45	1.40	14.29	14.18	14.19	36
長期 (7-11)	3,424	99.28	99.49	8.65	0.86	0.98	0.97	8.33	8.29	8.32	40
超長期 (11-)	6,241	90.94	91.24	21.37	1.19	1.74	1.66	17.86	17.71	17.70	33
AAA~BB 格	25,490	97.88	98.07	8.55	0.73	0.80	0.78	7.39	7.34	7.35	32
短期 (1-3)	7,110	100.15	100.25	2.04	0.36	0.27	0.27	2.03	2.03	2.03	25
中期 (3-7)	8,715	100.46	100.62	4.65	0.66	0.55	0.55	4.57	4.56	4.57	34
長期 (7-)	9,665	93.89	94.16	16.86	1.08	1.45	1.40	14.29	14.18	14.19	36
長期 (7-11)	3,424	99.28	99.49	8.65	0.86	0.98	0.97	8.33	8.29	8.32	40
超長期 (11-)	6,241	90.94	91.24	21.37	1.19	1.74	1.66	17.86	17.71	17.70	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	97.91	98.10	8.81	0.73	0.79	0.77	7.57	7.53	7.53	29
短期 (1-3)	6,331	100.17	100.27	2.04	0.36	0.26	0.27	2.03	2.03	2.03	24
中期 (3-7)	7,474	100.59	100.74	4.57	0.63	0.49	0.49	4.49	4.48	4.49	28
長期 (7-)	8,968	94.09	94.37	17.12	1.09	1.44	1.39	14.47	14.36	14.36	33
長期 (7-11)	3,052	99.49	99.71	8.63	0.86	0.95	0.95	8.31	8.27	8.31	38
超長期 (11-)	5,916	91.30	91.61	21.50	1.20	1.72	1.64	17.92	17.77	17.76	31
BBB 格	2,718	97.64	97.80	6.41	0.74	0.92	0.90	5.82	5.78	5.80	56
短期 (1-3)	780	100.00	100.09	2.03	0.38	0.34	0.34	2.02	2.01	2.02	32
中期 (3-7)	1,241	99.68	99.87	5.16	0.86	0.92	0.92	5.04	5.01	5.04	66
長期 (7-)	697	91.36	91.55	13.55	0.95	1.63	1.55	11.97	11.87	11.93	66
長期 (7-11)	372	97.52	97.70	8.81	0.89	1.21	1.19	8.46	8.41	8.45	61
超長期 (11-)	325	84.31	84.52	18.97	1.02	2.19	2.02	16.63	16.46	16.52	73
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	96.76	96.94	7.10	0.64	0.92	0.89	6.24	6.20	6.22	52
短期 (1-3)	13,086	99.88	100.01	2.03	0.43	0.48	0.48	2.02	2.01	2.02	46
中期 (3-7)	16,619	99.32	99.50	4.79	0.61	0.74	0.74	4.70	4.69	4.70	51
長期 (7-)	14,122	90.86	91.10	14.53	0.88	1.58	1.49	12.50	12.40	12.44	59
長期 (7-11)	6,714	96.68	96.93	8.55	0.83	1.27	1.23	8.22	8.17	8.22	66
超長期 (11-)	7,408	85.58	85.81	19.96	0.92	1.91	1.76	16.88	16.73	16.75	51

出所:NFRFC

- 格付は、Moody's の格付をもとに NFRFC で分類

事業債 Moody's 格付別・ポートフォリオ指標 (2023年11月末、12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	22,794	97.91	98.10	8.89	0.74	0.79	0.77	7.65	7.60	7.61	29
短期 (1-3)	6,498	100.13	100.23	2.18	0.35	0.27	0.27	2.17	2.17	2.17	24
中期 (3-7)	7,329	100.60	100.76	4.69	0.65	0.51	0.51	4.61	4.60	4.61	29
長期 (7-)	8,967	94.11	94.39	17.19	1.09	1.44	1.39	14.52	14.41	14.42	33
長期 (7-11)	3,092	99.76	99.98	8.75	0.89	0.95	0.95	8.41	8.37	8.41	37
超長期 (11-)	5,875	91.14	91.44	21.62	1.20	1.73	1.65	18.04	17.88	17.87	31
AAA~BBB 格	25,641	97.90	98.08	8.63	0.74	0.81	0.79	7.46	7.41	7.42	32
短期 (1-3)	7,268	100.12	100.21	2.17	0.35	0.28	0.28	2.16	2.15	2.16	25
中期 (3-7)	8,680	100.45	100.61	4.77	0.68	0.57	0.57	4.68	4.67	4.68	34
長期 (7-)	9,694	93.95	94.22	16.92	1.09	1.46	1.40	14.34	14.23	14.24	36
長期 (7-11)	3,483	99.57	99.79	8.79	0.90	0.98	0.98	8.44	8.40	8.44	39
超長期 (11-)	6,211	90.80	91.09	21.49	1.19	1.75	1.67	17.97	17.82	17.81	33
AAA~BB 格	25,641	97.90	98.08	8.63	0.74	0.81	0.79	7.46	7.41	7.42	32
短期 (1-3)	7,268	100.12	100.21	2.17	0.35	0.28	0.28	2.16	2.15	2.16	25
中期 (3-7)	8,680	100.45	100.61	4.77	0.68	0.57	0.57	4.68	4.67	4.68	34
長期 (7-)	9,694	93.95	94.22	16.92	1.09	1.46	1.40	14.34	14.23	14.24	36
長期 (7-11)	3,483	99.57	99.79	8.79	0.90	0.98	0.98	8.44	8.40	8.44	39
超長期 (11-)	6,211	90.80	91.09	21.49	1.19	1.75	1.67	17.97	17.82	17.81	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	22,794	97.91	98.10	8.89	0.74	0.79	0.77	7.65	7.60	7.61	29
短期 (1-3)	6,498	100.13	100.23	2.18	0.35	0.27	0.27	2.17	2.17	2.17	24
中期 (3-7)	7,329	100.60	100.76	4.69	0.65	0.51	0.51	4.61	4.60	4.61	29
長期 (7-)	8,967	94.11	94.39	17.19	1.09	1.44	1.39	14.52	14.41	14.42	33
長期 (7-11)	3,092	99.76	99.98	8.75	0.89	0.95	0.95	8.41	8.37	8.41	37
超長期 (11-)	5,875	91.14	91.44	21.62	1.20	1.73	1.65	18.04	17.88	17.87	31
BBB 格	2,848	97.77	97.93	6.52	0.76	0.92	0.91	5.92	5.89	5.91	56
短期 (1-3)	770	100.00	100.09	2.04	0.38	0.34	0.34	2.03	2.03	2.03	32
中期 (3-7)	1,351	99.63	99.81	5.21	0.84	0.91	0.91	5.08	5.06	5.08	64
長期 (7-)	727	91.95	92.14	13.71	1.01	1.63	1.55	12.09	11.99	12.04	65
長期 (7-11)	391	98.12	98.29	9.08	0.98	1.22	1.21	8.68	8.63	8.67	59
超長期 (11-)	336	84.77	84.98	19.10	1.06	2.19	2.02	16.69	16.52	16.58	73
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	43,267	96.74	96.92	7.26	0.65	0.92	0.89	6.38	6.34	6.35	51
短期 (1-3)	12,946	99.83	99.96	2.16	0.44	0.49	0.49	2.15	2.14	2.15	46
中期 (3-7)	16,214	99.39	99.55	4.90	0.62	0.73	0.73	4.81	4.79	4.81	49
長期 (7-)	14,106	90.85	91.08	14.64	0.89	1.59	1.50	12.59	12.49	12.52	59
長期 (7-11)	6,668	96.62	96.85	8.63	0.84	1.28	1.24	8.30	8.25	8.29	67
超長期 (11-)	7,438	85.68	85.91	20.04	0.93	1.91	1.76	16.93	16.78	16.80	51

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11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	87.72	87.97	18.45	0.95	1.50	1.37	14.59	14.47	14.47	38
短期 (1-3)	30	102.32	102.85	2.14	1.52	0.28	0.28	2.11	2.11	2.11	26
中期 (3-7)	90	99.72	99.99	5.15	0.69	0.58	0.57	5.05	5.03	5.05	32
長期 (7-)	680	85.49	85.73	20.93	0.96	1.71	1.56	16.73	16.58	16.58	40
長期 (7-11)	222	100.91	101.12	8.97	1.05	0.97	0.98	8.55	8.51	8.55	38
超長期 (11-)	458	78.01	78.26	26.74	0.92	2.17	1.92	21.84	21.63	21.62	41
AAA~A 格	16,183	96.42	96.62	9.30	0.71	0.83	0.80	7.83	7.78	7.79	30
短期 (1-3)	3,713	100.15	100.26	2.03	0.35	0.26	0.26	2.02	2.02	2.02	24
中期 (3-7)	5,452	100.42	100.62	4.93	0.67	0.54	0.54	4.84	4.82	4.84	30
長期 (7-)	7,018	91.33	91.59	16.55	0.93	1.41	1.33	13.75	13.65	13.66	35
長期 (7-11)	2,924	100.26	100.53	8.56	0.95	0.93	0.93	8.21	8.17	8.20	36
超長期 (11-)	4,094	84.94	85.19	22.26	0.91	1.81	1.66	18.42	18.26	18.25	33
AAA~BBB 格	16,946	96.56	96.77	9.06	0.71	0.82	0.79	7.64	7.59	7.60	31
短期 (1-3)	4,129	100.16	100.28	2.04	0.39	0.28	0.28	2.03	2.03	2.03	26
中期 (3-7)	5,714	100.39	100.59	4.92	0.67	0.55	0.55	4.82	4.81	4.82	31
長期 (7-)	7,103	91.39	91.65	16.47	0.93	1.41	1.33	13.69	13.59	13.60	35
長期 (7-11)	2,999	100.19	100.47	8.57	0.95	0.93	0.93	8.21	8.18	8.21	37
超長期 (11-)	4,104	84.96	85.21	22.24	0.91	1.81	1.66	18.41	18.25	18.24	33
AAA~BB 格	17,186	96.63	96.84	9.02	0.73	0.84	0.81	7.61	7.56	7.58	33
短期 (1-3)	4,129	100.16	100.28	2.04	0.39	0.28	0.28	2.03	2.03	2.03	26
中期 (3-7)	5,929	100.46	100.66	4.93	0.73	0.60	0.60	4.83	4.81	4.83	36
長期 (7-)	7,128	91.40	91.65	16.47	0.93	1.41	1.33	13.69	13.59	13.60	36
長期 (7-11)	2,999	100.19	100.47	8.57	0.95	0.93	0.93	8.21	8.18	8.21	37
超長期 (11-)	4,129	85.01	85.25	22.21	0.91	1.82	1.67	18.38	18.22	18.21	34
AAA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA 格	800	87.72	87.97	18.45	0.95	1.50	1.37	14.59	14.47	14.47	38
短期 (1-3)	30	102.32	102.85	2.14	1.52	0.28	0.28	2.11	2.11	2.11	26
中期 (3-7)	90	99.72	99.99	5.15	0.69	0.58	0.57	5.05	5.03	5.05	32
長期 (7-)	680	85.49	85.73	20.93	0.96	1.71	1.56	16.73	16.58	16.58	40
長期 (7-11)	222	100.91	101.12	8.97	1.05	0.97	0.98	8.55	8.51	8.55	38
超長期 (11-)	458	78.01	78.26	26.74	0.92	2.17	1.92	21.84	21.63	21.62	41
A 格	15,383	96.87	97.07	8.83	0.70	0.80	0.77	7.51	7.47	7.48	30
短期 (1-3)	3,683	100.13	100.24	2.03	0.34	0.26	0.26	2.02	2.02	2.02	24
中期 (3-7)	5,362	100.43	100.63	4.93	0.67	0.54	0.54	4.83	4.82	4.83	30
長期 (7-)	6,338	91.95	92.21	16.08	0.92	1.38	1.30	13.46	13.35	13.37	34
長期 (7-11)	2,702	100.21	100.49	8.53	0.95	0.92	0.92	8.18	8.14	8.18	36
超長期 (11-)	3,636	85.82	86.07	21.70	0.90	1.77	1.64	18.03	17.88	17.87	32
BBB 格	763	99.71	99.93	3.81	0.74	0.67	0.67	3.70	3.68	3.70	51
短期 (1-3)	417	100.25	100.49	2.17	0.73	0.51	0.51	2.15	2.14	2.15	48
中期 (3-7)	262	99.80	100.01	4.60	0.69	0.74	0.73	4.53	4.51	4.53	52
長期 (7-)	85	96.72	96.91	9.42	0.90	1.29	1.26	8.96	8.90	8.95	63
長期 (7-11)	75	97.55	97.77	8.80	0.91	1.23	1.22	8.44	8.39	8.44	63
超長期 (11-)	10	90.48	90.49	13.98	0.88	1.73	1.65	13.13	13.03	13.11	62
BB 格	240	101.18	101.61	6.49	2.26	1.91	1.92	5.85	5.79	5.84	156
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	215	102.12	102.59	5.33	2.25	1.80	1.81	5.03	4.98	5.03	154
長期 (7-)	25	93.16	93.17	16.49	2.37	2.99	2.89	13.63	13.43	13.53	172
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	25	93.16	93.17	16.49	2.37	2.99	2.89	13.63	13.43	13.53	172
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	97.35	97.53	7.18	0.66	0.89	0.86	6.35	6.31	6.33	48
短期 (1-3)	16,067	99.93	100.04	2.03	0.41	0.44	0.44	2.02	2.01	2.02	42
中期 (3-7)	19,405	99.49	99.64	4.68	0.60	0.70	0.70	4.60	4.59	4.60	48
長期 (7-)	16,660	92.39	92.64	15.06	0.97	1.58	1.50	13.06	12.95	12.98	55
長期 (7-11)	7,139	96.45	96.67	8.59	0.79	1.27	1.23	8.28	8.23	8.28	66
超長期 (11-)	9,520	89.34	89.61	19.91	1.10	1.83	1.73	16.92	16.77	16.78	46

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11月末、12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	87.72	87.97	18.45	0.95	1.50	1.37	14.59	14.47	14.47	38
短期 (1-3)	30	102.32	102.85	2.14	1.52	0.28	0.28	2.11	2.11	2.11	26
中期 (3-7)	100	99.36	99.61	5.34	0.64	0.60	0.59	5.23	5.22	5.23	32
長期 (7-)	670	85.33	85.57	21.14	0.97	1.73	1.57	16.89	16.74	16.74	40
長期 (7-11)	212	101.14	101.35	9.06	1.09	0.98	0.99	8.62	8.58	8.62	38
超長期 (11-)	458	78.01	78.26	26.74	0.92	2.17	1.92	21.84	21.63	21.62	41
AAA~A 格	16,200	96.42	96.62	9.43	0.72	0.84	0.81	7.94	7.89	7.90	31
短期 (1-3)	3,721	100.19	100.30	2.18	0.36	0.27	0.27	2.17	2.17	2.17	24
中期 (3-7)	5,510	100.45	100.64	5.04	0.69	0.56	0.56	4.94	4.93	4.94	31
長期 (7-)	6,969	91.22	91.48	16.77	0.93	1.42	1.34	13.92	13.82	13.83	35
長期 (7-11)	2,845	100.13	100.40	8.67	0.94	0.93	0.93	8.31	8.27	8.30	36
超長期 (11-)	4,124	85.08	85.33	22.36	0.92	1.82	1.67	18.48	18.32	18.31	33
AAA~BBB 格	16,953	96.56	96.77	9.18	0.72	0.83	0.80	7.75	7.70	7.71	31
短期 (1-3)	4,127	100.19	100.32	2.18	0.40	0.29	0.29	2.17	2.17	2.17	26
中期 (3-7)	5,772	100.42	100.61	5.02	0.69	0.57	0.57	4.92	4.91	4.92	32
長期 (7-)	7,054	91.29	91.55	16.68	0.93	1.42	1.34	13.86	13.75	13.76	35
長期 (7-11)	2,920	100.07	100.33	8.67	0.94	0.94	0.94	8.31	8.27	8.31	37
超長期 (11-)	4,134	85.09	85.34	22.34	0.92	1.82	1.67	18.47	18.31	18.30	34
AAA~BB 格	17,193	96.63	96.83	9.14	0.74	0.85	0.82	7.72	7.67	7.68	33
短期 (1-3)	4,127	100.19	100.32	2.18	0.40	0.29	0.29	2.17	2.17	2.17	26
中期 (3-7)	5,987	100.48	100.68	5.03	0.74	0.61	0.61	4.93	4.91	4.93	36
長期 (7-)	7,079	91.30	91.55	16.68	0.93	1.43	1.34	13.86	13.75	13.76	35
長期 (7-11)	2,920	100.07	100.33	8.67	0.94	0.94	0.94	8.31	8.27	8.31	37
超長期 (11-)	4,159	85.14	85.39	22.30	0.93	1.83	1.68	18.44	18.27	18.26	34
AAA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA 格	800	87.72	87.97	18.45	0.95	1.50	1.37	14.59	14.47	14.47	38
短期 (1-3)	30	102.32	102.85	2.14	1.52	0.28	0.28	2.11	2.11	2.11	26
中期 (3-7)	100	99.36	99.61	5.34	0.64	0.60	0.59	5.23	5.22	5.23	32
長期 (7-)	670	85.33	85.57	21.14	0.97	1.73	1.57	16.89	16.74	16.74	40
長期 (7-11)	212	101.14	101.35	9.06	1.09	0.98	0.99	8.62	8.58	8.62	38
超長期 (11-)	458	78.01	78.26	26.74	0.92	2.17	1.92	21.84	21.63	21.62	41
A 格	15,400	96.87	97.07	8.96	0.70	0.81	0.78	7.63	7.58	7.59	30
短期 (1-3)	3,691	100.17	100.28	2.18	0.35	0.27	0.27	2.17	2.17	2.17	24
中期 (3-7)	5,410	100.47	100.66	5.04	0.69	0.56	0.56	4.94	4.92	4.94	31
長期 (7-)	6,299	91.85	92.11	16.30	0.92	1.39	1.32	13.63	13.53	13.54	34
長期 (7-11)	2,633	100.05	100.32	8.63	0.93	0.93	0.93	8.28	8.24	8.28	36
超長期 (11-)	3,666	85.96	86.21	21.81	0.92	1.78	1.64	18.10	17.94	17.93	33
BBB 格	753	99.70	99.93	3.84	0.74	0.68	0.67	3.73	3.72	3.73	51
短期 (1-3)	407	100.26	100.50	2.20	0.75	0.52	0.52	2.18	2.17	2.18	49
中期 (3-7)	262	99.80	100.01	4.60	0.69	0.74	0.73	4.53	4.51	4.53	52
長期 (7-)	85	96.72	96.91	9.42	0.90	1.29	1.26	8.96	8.90	8.95	63
長期 (7-11)	75	97.55	97.77	8.80	0.91	1.23	1.22	8.44	8.39	8.44	63
超長期 (11-)	10	90.48	90.49	13.98	0.88	1.73	1.65	13.13	13.03	13.11	62
BB 格	240	101.18	101.61	6.49	2.26	1.91	1.92	5.85	5.79	5.84	156
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	215	102.12	102.59	5.33	2.25	1.80	1.81	5.03	4.98	5.03	154
長期 (7-)	25	93.16	93.17	16.49	2.37	2.99	2.89	13.63	13.43	13.53	172
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	25	93.16	93.17	16.49	2.37	2.99	2.89	13.63	13.43	13.53	172
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	51,715	97.35	97.52	7.31	0.67	0.89	0.86	6.47	6.43	6.45	47
短期 (1-3)	16,087	99.87	99.99	2.16	0.41	0.44	0.44	2.15	2.14	2.15	41
中期 (3-7)	18,907	99.53	99.68	4.80	0.61	0.69	0.69	4.72	4.70	4.72	46
長期 (7-)	16,722	92.46	92.70	15.10	0.98	1.58	1.51	13.09	12.99	13.02	55
長期 (7-11)	7,231	96.65	96.87	8.69	0.82	1.27	1.24	8.36	8.31	8.36	66
超長期 (11-)	9,490	89.26	89.53	19.99	1.10	1.84	1.74	16.99	16.84	16.86	46

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11月末)

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
AAA~AA格	1,081	99.09	99.33	3.73	0.77	0.99	0.99	3.63	3.61	3.63	84
短期(1-3)	439	99.58	99.75	2.22	0.60	0.77	0.77	2.21	2.20	2.21	74
中期(3-7)	584	99.03	99.30	4.31	0.87	1.10	1.09	4.23	4.20	4.23	90
長期(7-)	58	95.94	96.30	9.28	1.15	1.68	1.65	8.71	8.64	8.70	102
長期(7-11)	54	96.15	96.48	8.84	1.08	1.61	1.58	8.42	8.35	8.41	99
超長期(11-)	4	93.26	94.00	14.84	1.99	2.63	2.54	12.59	12.43	12.52	150
AAA~A格	2,949	98.94	99.26	3.89	1.07	1.28	1.27	3.70	3.68	3.70	111
短期(1-3)	1,245	100.07	100.42	2.02	1.10	1.07	1.07	2.00	1.99	2.00	105
中期(3-7)	1,457	98.40	98.67	4.24	0.90	1.29	1.28	4.15	4.12	4.15	109
長期(7-)	247	96.44	96.83	11.22	1.85	2.30	2.25	9.95	9.83	9.92	148
長期(7-11)	133	95.21	95.59	8.88	1.29	1.94	1.90	8.35	8.27	8.34	131
超長期(11-)	114	97.86	98.26	13.95	2.50	2.71	2.66	11.75	11.59	11.69	168
AAA~BBB格	3,421	98.94	99.26	3.84	1.07	1.27	1.26	3.65	3.62	3.65	110
短期(1-3)	1,560	100.04	100.39	1.97	1.09	1.06	1.06	1.94	1.93	1.94	105
中期(3-7)	1,558	98.47	98.73	4.29	0.92	1.29	1.28	4.20	4.17	4.20	109
長期(7-)	304	95.76	96.12	11.12	1.74	2.26	2.21	9.91	9.80	9.88	144
長期(7-11)	167	95.31	95.64	8.77	1.26	1.91	1.86	8.27	8.19	8.26	128
超長期(11-)	137	96.31	96.71	13.99	2.33	2.69	2.62	11.89	11.74	11.83	164
AAA~BB格	3,421	98.94	99.26	3.84	1.07	1.27	1.26	3.65	3.62	3.65	110
短期(1-3)	1,560	100.04	100.39	1.97	1.09	1.06	1.06	1.94	1.93	1.94	105
中期(3-7)	1,558	98.47	98.73	4.29	0.92	1.29	1.28	4.20	4.17	4.20	109
長期(7-)	304	95.76	96.12	11.12	1.74	2.26	2.21	9.91	9.80	9.88	144
長期(7-11)	167	95.31	95.64	8.77	1.26	1.91	1.86	8.27	8.19	8.26	128
超長期(11-)	137	96.31	96.71	13.99	2.33	2.69	2.62	11.89	11.74	11.83	164
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	99.09	99.33	3.73	0.77	0.99	0.99	3.63	3.61	3.63	84
短期(1-3)	439	99.58	99.75	2.22	0.60	0.77	0.77	2.21	2.20	2.21	74
中期(3-7)	584	99.03	99.30	4.31	0.87	1.10	1.09	4.23	4.20	4.23	90
長期(7-)	58	95.94	96.30	9.28	1.15	1.68	1.65	8.71	8.64	8.70	102
長期(7-11)	54	96.15	96.48	8.84	1.08	1.61	1.58	8.42	8.35	8.41	99
超長期(11-)	4	93.26	94.00	14.84	1.99	2.63	2.54	12.59	12.43	12.52	150
A格	1,868	98.86	99.22	3.98	1.24	1.44	1.43	3.74	3.71	3.74	126
短期(1-3)	806	100.33	100.79	1.91	1.38	1.23	1.24	1.89	1.87	1.89	122
中期(3-7)	873	97.99	98.25	4.19	0.93	1.42	1.40	4.10	4.07	4.10	123
長期(7-)	189	96.59	96.99	11.82	2.06	2.49	2.44	10.32	10.19	10.28	162
長期(7-11)	79	94.58	95.00	8.90	1.43	2.17	2.12	8.30	8.21	8.29	153
超長期(11-)	110	98.03	98.42	13.91	2.52	2.71	2.66	11.72	11.56	11.66	169
BBB格	472	98.95	99.26	3.52	1.09	1.20	1.19	3.30	3.28	3.30	105
短期(1-3)	315	99.92	100.28	1.74	1.03	1.02	1.02	1.72	1.72	1.72	102
中期(3-7)	101	99.39	99.58	5.03	1.19	1.31	1.30	4.87	4.84	4.87	105
長期(7-)	57	92.81	93.04	10.69	1.28	2.08	2.00	9.76	9.66	9.74	128
長期(7-11)	34	95.67	95.80	8.37	1.16	1.78	1.74	7.96	7.89	7.96	120
超長期(11-)	23	88.51	88.88	14.19	1.45	2.57	2.43	12.68	12.53	12.64	141
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11月末、12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	1,248	99.24	99.47	3.80	0.81	1.00	0.99	3.70	3.68	3.70	84
短期(1-3)	504	99.64	99.80	2.31	0.63	0.78	0.78	2.29	2.28	2.29	74
中期(3-7)	682	99.22	99.48	4.39	0.92	1.10	1.10	4.30	4.28	4.30	90
長期(7-)	62	96.29	96.64	9.32	1.18	1.67	1.64	8.74	8.67	8.73	101
長期(7-11)	58	96.51	96.83	8.92	1.13	1.60	1.58	8.47	8.41	8.47	98
超長期(11-)	4	93.26	94.00	14.84	1.99	2.63	2.54	12.59	12.43	12.52	150
AAA~A 格	3,000	98.99	99.30	4.02	1.09	1.28	1.27	3.83	3.80	3.83	110
短期(1-3)	1,238	100.05	100.40	2.20	1.13	1.08	1.09	2.17	2.16	2.17	105
中期(3-7)	1,516	98.51	98.78	4.33	0.93	1.28	1.28	4.23	4.20	4.23	108
長期(7-)	246	96.53	96.92	11.30	1.86	2.29	2.25	10.00	9.89	9.97	147
長期(7-11)	131	95.39	95.75	8.99	1.30	1.92	1.88	8.45	8.37	8.44	128
超長期(11-)	114	97.86	98.26	13.95	2.50	2.71	2.66	11.75	11.59	11.69	168
AAA~BBB 格	3,384	98.95	99.26	4.03	1.09	1.28	1.27	3.83	3.80	3.83	110
短期(1-3)	1,465	100.02	100.37	2.17	1.11	1.08	1.08	2.14	2.13	2.14	105
中期(3-7)	1,617	98.57	98.83	4.37	0.95	1.29	1.28	4.27	4.24	4.27	108
長期(7-)	303	95.83	96.19	11.18	1.75	2.25	2.20	9.96	9.85	9.93	143
長期(7-11)	166	95.44	95.76	8.86	1.27	1.89	1.85	8.35	8.27	8.34	126
超長期(11-)	137	96.31	96.71	13.99	2.33	2.69	2.62	11.89	11.74	11.83	164
AAA~BB 格	3,384	98.95	99.26	4.03	1.09	1.28	1.27	3.83	3.80	3.83	110
短期(1-3)	1,465	100.02	100.37	2.17	1.11	1.08	1.08	2.14	2.13	2.14	105
中期(3-7)	1,617	98.57	98.83	4.37	0.95	1.29	1.28	4.27	4.24	4.27	108
長期(7-)	303	95.83	96.19	11.18	1.75	2.25	2.20	9.96	9.85	9.93	143
長期(7-11)	166	95.44	95.76	8.86	1.27	1.89	1.85	8.35	8.27	8.34	126
超長期(11-)	137	96.31	96.71	13.99	2.33	2.69	2.62	11.89	11.74	11.83	164
AAA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA 格	1,248	99.24	99.47	3.80	0.81	1.00	0.99	3.70	3.68	3.70	84
短期(1-3)	504	99.64	99.80	2.31	0.63	0.78	0.78	2.29	2.28	2.29	74
中期(3-7)	682	99.22	99.48	4.39	0.92	1.10	1.10	4.30	4.28	4.30	90
長期(7-)	62	96.29	96.64	9.32	1.18	1.67	1.64	8.74	8.67	8.73	101
長期(7-11)	58	96.51	96.83	8.92	1.13	1.60	1.58	8.47	8.41	8.47	98
超長期(11-)	4	93.26	94.00	14.84	1.99	2.63	2.54	12.59	12.43	12.52	150
A 格	1,752	98.80	99.17	4.18	1.29	1.49	1.48	3.93	3.89	3.92	129
短期(1-3)	734	100.34	100.81	2.12	1.48	1.29	1.30	2.09	2.07	2.09	127
中期(3-7)	835	97.94	98.21	4.27	0.94	1.44	1.42	4.17	4.14	4.17	124
長期(7-)	184	96.62	97.02	11.96	2.09	2.50	2.45	10.43	10.30	10.39	162
長期(7-11)	73	94.50	94.90	9.04	1.44	2.18	2.13	8.42	8.34	8.42	153
超長期(11-)	110	98.03	98.42	13.91	2.52	2.71	2.66	11.72	11.56	11.66	169
BBB 格	384	98.70	98.97	4.09	1.10	1.25	1.23	3.83	3.80	3.83	106
短期(1-3)	227	99.87	100.19	2.02	1.02	1.02	1.02	1.99	1.98	1.99	100
中期(3-7)	101	99.39	99.58	5.03	1.19	1.31	1.30	4.87	4.84	4.87	105
長期(7-)	57	92.81	93.04	10.69	1.28	2.08	2.00	9.76	9.66	9.74	128
長期(7-11)	34	95.67	95.80	8.37	1.16	1.78	1.74	7.96	7.89	7.96	120
超長期(11-)	23	88.51	88.88	14.19	1.45	2.57	2.43	12.68	12.53	12.64	141
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11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	284	99.48	99.69	3.38	0.71	0.84	0.84	3.31	3.29	3.31	71
短期(1-3)	155	100.03	100.25	2.08	0.72	0.75	0.75	2.06	2.05	2.06	73
中期(3-7)	115	99.07	99.26	4.47	0.67	0.90	0.89	4.40	4.38	4.40	69
長期(7-)	14	96.72	96.94	8.95	0.94	1.39	1.37	8.59	8.53	8.58	77
長期(7-11)	14	96.72	96.94	8.95	0.94	1.39	1.37	8.59	8.53	8.58	77
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AAA~A格	1,730	99.57	99.86	3.67	0.99	1.09	1.09	3.55	3.52	3.54	94
短期(1-3)	882	100.17	100.48	2.13	1.04	0.96	0.97	2.10	2.09	2.10	94
中期(3-7)	726	98.74	99.01	4.34	0.82	1.12	1.11	4.25	4.23	4.25	92
長期(7-)	123	100.28	100.51	10.83	1.70	1.82	1.83	9.81	9.72	9.78	108
長期(7-11)	73	95.15	95.46	8.68	0.94	1.61	1.57	8.31	8.25	8.31	100
超長期(11-)	50	107.74	107.85	13.96	2.81	2.09	2.17	11.74	11.61	11.68	119
AAA~BBB格	3,421	98.94	99.26	3.84	1.07	1.27	1.26	3.65	3.62	3.65	110
短期(1-3)	1,560	100.04	100.39	1.97	1.09	1.06	1.06	1.94	1.93	1.94	105
中期(3-7)	1,558	98.47	98.73	4.29	0.92	1.29	1.28	4.20	4.17	4.20	109
長期(7-)	304	95.76	96.12	11.12	1.74	2.26	2.21	9.91	9.80	9.88	144
長期(7-11)	167	95.31	95.64	8.77	1.26	1.91	1.86	8.27	8.19	8.26	128
超長期(11-)	137	96.31	96.71	13.99	2.33	2.69	2.62	11.89	11.74	11.83	164
AAA~BB格	3,421	98.94	99.26	3.84	1.07	1.27	1.26	3.65	3.62	3.65	110
短期(1-3)	1,560	100.04	100.39	1.97	1.09	1.06	1.06	1.94	1.93	1.94	105
中期(3-7)	1,558	98.47	98.73	4.29	0.92	1.29	1.28	4.20	4.17	4.20	109
長期(7-)	304	95.76	96.12	11.12	1.74	2.26	2.21	9.91	9.80	9.88	144
長期(7-11)	167	95.31	95.64	8.77	1.26	1.91	1.86	8.27	8.19	8.26	128
超長期(11-)	137	96.31	96.71	13.99	2.33	2.69	2.62	11.89	11.74	11.83	164
AAA格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA格	284	99.48	99.69	3.38	0.71	0.84	0.84	3.31	3.29	3.31	71
短期(1-3)	155	100.03	100.25	2.08	0.72	0.75	0.75	2.06	2.05	2.06	73
中期(3-7)	115	99.07	99.26	4.47	0.67	0.90	0.89	4.40	4.38	4.40	69
長期(7-)	14	96.72	96.94	8.95	0.94	1.39	1.37	8.59	8.53	8.58	77
長期(7-11)	14	96.72	96.94	8.95	0.94	1.39	1.37	8.59	8.53	8.58	77
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
A格	1,446	99.59	99.90	3.73	1.05	1.14	1.14	3.59	3.57	3.59	99
短期(1-3)	727	100.20	100.53	2.14	1.11	1.01	1.01	2.11	2.10	2.11	99
中期(3-7)	611	98.67	98.96	4.31	0.84	1.16	1.15	4.22	4.20	4.22	96
長期(7-)	109	100.73	100.96	11.07	1.80	1.87	1.89	9.96	9.86	9.93	112
長期(7-11)	59	94.78	95.11	8.62	0.95	1.66	1.62	8.25	8.18	8.24	105
超長期(11-)	50	107.74	107.85	13.96	2.81	2.09	2.17	11.74	11.61	11.68	119
BBB格	1,691	98.30	98.64	4.01	1.15	1.45	1.44	3.76	3.72	3.75	127
短期(1-3)	678	99.87	100.28	1.76	1.15	1.19	1.19	1.74	1.73	1.74	118
中期(3-7)	832	98.23	98.49	4.25	1.01	1.44	1.43	4.15	4.12	4.15	124
長期(7-)	181	92.69	93.14	11.32	1.77	2.58	2.48	9.99	9.86	9.96	171
長期(7-11)	94	95.43	95.77	8.84	1.51	2.13	2.09	8.23	8.15	8.23	151
超長期(11-)	87	89.73	90.30	14.00	2.05	3.10	2.94	12.00	11.82	11.94	195
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11月末、12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	99.48	99.69	3.38	0.71	0.84	0.84	3.31	3.29	3.31	71
短期(1-3)	155	100.03	100.25	2.08	0.72	0.75	0.75	2.06	2.05	2.06	73
中期(3-7)	115	99.07	99.26	4.47	0.67	0.90	0.89	4.40	4.38	4.40	69
長期(7-)	14	96.72	96.94	8.95	0.94	1.39	1.37	8.59	8.53	8.58	77
長期(7-11)	14	96.72	96.94	8.95	0.94	1.39	1.37	8.59	8.53	8.58	77
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AAA~A 格	1,827	99.63	99.91	3.82	1.02	1.09	1.09	3.70	3.67	3.69	94
短期(1-3)	902	100.14	100.44	2.29	1.05	0.97	0.97	2.26	2.25	2.26	93
中期(3-7)	804	98.93	99.20	4.46	0.88	1.13	1.12	4.37	4.34	4.37	92
長期(7-)	122	100.51	100.72	10.97	1.72	1.81	1.82	9.92	9.83	9.89	105
長期(7-11)	72	95.46	95.75	8.88	0.96	1.58	1.54	8.49	8.43	8.49	95
超長期(11-)	50	107.74	107.85	13.96	2.81	2.09	2.17	11.74	11.61	11.68	119
AAA~BBB 格	3,384	98.95	99.26	4.03	1.09	1.28	1.27	3.83	3.80	3.83	110
短期(1-3)	1,465	100.02	100.37	2.17	1.11	1.08	1.08	2.14	2.13	2.14	105
中期(3-7)	1,617	98.57	98.83	4.37	0.95	1.29	1.28	4.27	4.24	4.27	108
長期(7-)	303	95.83	96.19	11.18	1.75	2.25	2.20	9.96	9.85	9.93	143
長期(7-11)	166	95.44	95.76	8.86	1.27	1.89	1.85	8.35	8.27	8.34	126
超長期(11-)	137	96.31	96.71	13.99	2.33	2.69	2.62	11.89	11.74	11.83	164
AAA~BB 格	3,384	98.95	99.26	4.03	1.09	1.28	1.27	3.83	3.80	3.83	110
短期(1-3)	1,465	100.02	100.37	2.17	1.11	1.08	1.08	2.14	2.13	2.14	105
中期(3-7)	1,617	98.57	98.83	4.37	0.95	1.29	1.28	4.27	4.24	4.27	108
長期(7-)	303	95.83	96.19	11.18	1.75	2.25	2.20	9.96	9.85	9.93	143
長期(7-11)	166	95.44	95.76	8.86	1.27	1.89	1.85	8.35	8.27	8.34	126
超長期(11-)	137	96.31	96.71	13.99	2.33	2.69	2.62	11.89	11.74	11.83	164
AAA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA 格	284	99.48	99.69	3.38	0.71	0.84	0.84	3.31	3.29	3.31	71
短期(1-3)	155	100.03	100.25	2.08	0.72	0.75	0.75	2.06	2.05	2.06	73
中期(3-7)	115	99.07	99.26	4.47	0.67	0.90	0.89	4.40	4.38	4.40	69
長期(7-)	14	96.72	96.94	8.95	0.94	1.39	1.37	8.59	8.53	8.58	77
長期(7-11)	14	96.72	96.94	8.95	0.94	1.39	1.37	8.59	8.53	8.58	77
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
A 格	1,544	99.66	99.95	3.91	1.08	1.14	1.14	3.77	3.74	3.76	98
短期(1-3)	747	100.16	100.48	2.34	1.12	1.01	1.01	2.31	2.29	2.31	97
中期(3-7)	689	98.91	99.18	4.46	0.92	1.17	1.16	4.36	4.34	4.36	96
長期(7-)	108	100.99	101.20	11.23	1.82	1.86	1.87	10.08	9.99	10.05	109
長期(7-11)	58	95.17	95.46	8.87	0.97	1.62	1.59	8.47	8.40	8.47	99
超長期(11-)	50	107.74	107.85	13.96	2.81	2.09	2.17	11.74	11.61	11.68	119
BBB 格	1,557	98.16	98.49	4.27	1.17	1.50	1.48	4.00	3.96	3.99	129
短期(1-3)	562	99.84	100.26	1.97	1.22	1.25	1.25	1.95	1.93	1.95	123
中期(3-7)	813	98.21	98.46	4.28	1.01	1.44	1.43	4.18	4.15	4.18	124
長期(7-)	181	92.69	93.14	11.32	1.77	2.58	2.48	9.99	9.86	9.96	171
長期(7-11)	94	95.43	95.77	8.84	1.51	2.13	2.09	8.23	8.15	8.23	151
超長期(11-)	87	89.73	90.30	14.00	2.05	3.10	2.94	12.00	11.82	11.94	195
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11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	100.18	100.53	1.87	0.91	0.93	0.93	1.85	1.84	1.85	92
短期 (1-3)	60	100.18	100.53	1.87	0.91	0.93	0.93	1.85	1.84	1.85	92
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AAA~A 格	865	99.00	99.46	3.20	1.22	1.38	1.38	3.10	3.08	3.10	127
短期 (1-3)	417	100.33	100.99	1.80	1.56	1.35	1.35	1.76	1.75	1.76	134
中期 (3-7)	419	98.06	98.34	4.19	0.90	1.39	1.38	4.10	4.07	4.10	120
長期 (7-)	29	93.46	93.75	8.93	0.96	1.83	1.77	8.53	8.45	8.52	117
長期 (7-11)	29	93.46	93.75	8.93	0.96	1.83	1.77	8.53	8.45	8.52	117
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AAA~BBB 格	914	98.87	99.33	3.23	1.20	1.38	1.37	3.11	3.09	3.11	126
短期 (1-3)	454	100.27	100.90	1.73	1.48	1.31	1.31	1.70	1.69	1.70	131
中期 (3-7)	419	98.06	98.34	4.19	0.90	1.39	1.38	4.10	4.07	4.10	120
長期 (7-)	41	91.66	92.04	10.08	1.06	2.05	1.96	9.41	9.32	9.40	127
長期 (7-11)	29	93.46	93.75	8.93	0.96	1.83	1.77	8.53	8.45	8.52	117
超長期 (11-)	11	87.04	87.67	13.02	1.32	2.66	2.49	11.83	11.69	11.80	155
AAA~BB 格	914	98.87	99.33	3.23	1.20	1.38	1.37	3.11	3.09	3.11	126
短期 (1-3)	454	100.27	100.90	1.73	1.48	1.31	1.31	1.70	1.69	1.70	131
中期 (3-7)	419	98.06	98.34	4.19	0.90	1.39	1.38	4.10	4.07	4.10	120
長期 (7-)	41	91.66	92.04	10.08	1.06	2.05	1.96	9.41	9.32	9.40	127
長期 (7-11)	29	93.46	93.75	8.93	0.96	1.83	1.77	8.53	8.45	8.52	117
超長期 (11-)	11	87.04	87.67	13.02	1.32	2.66	2.49	11.83	11.69	11.80	155
AAA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA 格	60	100.18	100.53	1.87	0.91	0.93	0.93	1.85	1.84	1.85	92
短期 (1-3)	60	100.18	100.53	1.87	0.91	0.93	0.93	1.85	1.84	1.85	92
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
A 格	805	98.91	99.38	3.29	1.25	1.42	1.41	3.19	3.17	3.19	130
短期 (1-3)	357	100.35	101.06	1.78	1.67	1.42	1.42	1.75	1.74	1.75	142
中期 (3-7)	419	98.06	98.34	4.19	0.90	1.39	1.38	4.10	4.07	4.10	120
長期 (7-)	29	93.46	93.75	8.93	0.96	1.83	1.77	8.53	8.45	8.52	117
長期 (7-11)	29	93.46	93.75	8.93	0.96	1.83	1.77	8.53	8.45	8.52	117
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
BBB 格	49	96.67	97.00	3.84	0.71	1.27	1.23	3.31	3.28	3.31	107
短期 (1-3)	37	99.62	99.86	1.02	0.52	0.90	0.90	1.02	1.02	1.02	94
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	11	87.04	87.67	13.02	1.32	2.66	2.49	11.83	11.69	11.80	155
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	11	87.04	87.67	13.02	1.32	2.66	2.49	11.83	11.69	11.80	155
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	98.97	99.23	4.06	1.02	1.23	1.22	3.85	3.82	3.84	104
短期 (1-3)	1,105	99.94	100.19	2.06	0.93	0.96	0.96	2.04	2.03	2.04	94
中期 (3-7)	1,139	98.62	98.88	4.33	0.93	1.25	1.24	4.23	4.20	4.23	105
長期 (7-)	263	96.39	96.75	11.29	1.85	2.29	2.24	9.99	9.87	9.95	147
長期 (7-11)	138	95.70	96.03	8.74	1.33	1.92	1.88	8.22	8.14	8.21	131
超長期 (11-)	126	97.15	97.53	14.08	2.42	2.69	2.63	11.89	11.74	11.84	165

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11月末、12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	100.18	100.53	1.87	0.91	0.93	0.93	1.85	1.84	1.85	92
短期 (1-3)	60	100.18	100.53	1.87	0.91	0.93	0.93	1.85	1.84	1.85	92
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AAA~A 格	805	98.95	99.43	3.36	1.28	1.43	1.42	3.25	3.23	3.25	130
短期 (1-3)	401	100.24	100.93	2.05	1.63	1.41	1.41	2.01	1.99	2.01	139
中期 (3-7)	375	97.99	98.27	4.33	0.94	1.42	1.41	4.23	4.20	4.23	122
長期 (7-)	29	93.46	93.75	8.93	0.96	1.83	1.77	8.53	8.45	8.52	117
長期 (7-11)	29	93.46	93.75	8.93	0.96	1.83	1.77	8.53	8.45	8.52	117
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AAA~BBB 格	816	98.78	99.27	3.49	1.28	1.45	1.44	3.36	3.33	3.36	131
短期 (1-3)	401	100.24	100.93	2.05	1.63	1.41	1.41	2.01	1.99	2.01	139
中期 (3-7)	375	97.99	98.27	4.33	0.94	1.42	1.41	4.23	4.20	4.23	122
長期 (7-)	41	91.66	92.04	10.08	1.06	2.05	1.96	9.41	9.32	9.40	127
長期 (7-11)	29	93.46	93.75	8.93	0.96	1.83	1.77	8.53	8.45	8.52	117
超長期 (11-)	11	87.04	87.67	13.02	1.32	2.66	2.49	11.83	11.69	11.80	155
AAA~BB 格	816	98.78	99.27	3.49	1.28	1.45	1.44	3.36	3.33	3.36	131
短期 (1-3)	401	100.24	100.93	2.05	1.63	1.41	1.41	2.01	1.99	2.01	139
中期 (3-7)	375	97.99	98.27	4.33	0.94	1.42	1.41	4.23	4.20	4.23	122
長期 (7-)	41	91.66	92.04	10.08	1.06	2.05	1.96	9.41	9.32	9.40	127
長期 (7-11)	29	93.46	93.75	8.93	0.96	1.83	1.77	8.53	8.45	8.52	117
超長期 (11-)	11	87.04	87.67	13.02	1.32	2.66	2.49	11.83	11.69	11.80	155
AAA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA 格	60	100.18	100.53	1.87	0.91	0.93	0.93	1.85	1.84	1.85	92
短期 (1-3)	60	100.18	100.53	1.87	0.91	0.93	0.93	1.85	1.84	1.85	92
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
A 格	745	98.85	99.34	3.48	1.31	1.47	1.46	3.37	3.34	3.37	134
短期 (1-3)	341	100.25	100.99	2.08	1.76	1.49	1.50	2.04	2.02	2.04	147
中期 (3-7)	375	97.99	98.27	4.33	0.94	1.42	1.41	4.23	4.20	4.23	122
長期 (7-)	29	93.46	93.75	8.93	0.96	1.83	1.77	8.53	8.45	8.52	117
長期 (7-11)	29	93.46	93.75	8.93	0.96	1.83	1.77	8.53	8.45	8.52	117
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
BBB 格	11	87.04	87.67	13.02	1.32	2.66	2.49	11.83	11.69	11.80	155
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	11	87.04	87.67	13.02	1.32	2.66	2.49	11.83	11.69	11.80	155
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	11	87.04	87.67	13.02	1.32	2.66	2.49	11.83	11.69	11.80	155
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	2,568	99.01	99.26	4.20	1.03	1.22	1.22	3.98	3.95	3.98	103
短期 (1-3)	1,064	99.94	100.16	2.22	0.92	0.95	0.95	2.19	2.18	2.19	92
中期 (3-7)	1,242	98.74	99.00	4.38	0.95	1.24	1.24	4.28	4.26	4.28	104
長期 (7-)	262	96.48	96.83	11.35	1.86	2.28	2.24	10.04	9.92	10.01	146
長期 (7-11)	137	95.87	96.19	8.84	1.34	1.91	1.87	8.31	8.23	8.30	128
超長期 (11-)	126	97.15	97.53	14.08	2.42	2.69	2.63	11.89	11.74	11.84	165

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11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	99.16	99.52	4.01	1.06	1.21	1.21	3.84	3.81	3.84	104
短期(1-3)	39	99.49	99.65	2.02	0.64	0.88	0.87	2.01	2.00	2.01	85
中期(3-7)	163	99.63	100.02	3.70	1.11	1.20	1.19	3.61	3.59	3.61	106
長期(7-)	22	95.09	95.59	9.71	1.36	1.98	1.93	8.91	8.82	8.89	128
長期(7-11)	18	95.51	95.96	8.52	1.21	1.83	1.79	8.06	7.99	8.06	124
超長期(11-)	4	93.26	94.00	14.84	1.99	2.63	2.54	12.59	12.43	12.52	150
AAA~A格	1,073	99.17	99.54	4.46	1.39	1.46	1.44	4.11	4.07	4.10	124
短期(1-3)	430	100.79	101.24	1.87	1.49	1.15	1.16	1.84	1.83	1.84	114
中期(3-7)	477	98.58	98.86	4.09	1.03	1.36	1.35	3.99	3.96	3.99	118
長期(7-)	167	96.69	97.12	12.20	2.16	2.55	2.50	10.57	10.43	10.53	165
長期(7-11)	62	95.28	95.75	8.94	1.60	2.24	2.20	8.27	8.18	8.26	161
超長期(11-)	104	97.54	97.93	14.16	2.49	2.72	2.67	11.91	11.75	11.85	168
AAA~BBB格	1,074	99.17	99.53	4.46	1.39	1.46	1.45	4.11	4.07	4.10	124
短期(1-3)	430	100.79	101.24	1.87	1.49	1.15	1.16	1.84	1.83	1.84	114
中期(3-7)	478	98.56	98.84	4.09	1.03	1.36	1.35	3.99	3.96	3.99	118
長期(7-)	167	96.69	97.12	12.20	2.16	2.55	2.50	10.57	10.43	10.53	165
長期(7-11)	62	95.28	95.75	8.94	1.60	2.24	2.20	8.27	8.18	8.26	161
超長期(11-)	104	97.54	97.93	14.16	2.49	2.72	2.67	11.91	11.75	11.85	168
AAA~BB格	1,074	99.17	99.53	4.46	1.39	1.46	1.45	4.11	4.07	4.10	124
短期(1-3)	430	100.79	101.24	1.87	1.49	1.15	1.16	1.84	1.83	1.84	114
中期(3-7)	478	98.56	98.84	4.09	1.03	1.36	1.35	3.99	3.96	3.99	118
長期(7-)	167	96.69	97.12	12.20	2.16	2.55	2.50	10.57	10.43	10.53	165
長期(7-11)	62	95.28	95.75	8.94	1.60	2.24	2.20	8.27	8.18	8.26	161
超長期(11-)	104	97.54	97.93	14.16	2.49	2.72	2.67	11.91	11.75	11.85	168
AAA格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA格	224	99.16	99.52	4.01	1.06	1.21	1.21	3.84	3.81	3.84	104
短期(1-3)	39	99.49	99.65	2.02	0.64	0.88	0.87	2.01	2.00	2.01	85
中期(3-7)	163	99.63	100.02	3.70	1.11	1.20	1.19	3.61	3.59	3.61	106
長期(7-)	22	95.09	95.59	9.71	1.36	1.98	1.93	8.91	8.82	8.89	128
長期(7-11)	18	95.51	95.96	8.52	1.21	1.83	1.79	8.06	7.99	8.06	124
超長期(11-)	4	93.26	94.00	14.84	1.99	2.63	2.54	12.59	12.43	12.52	150
A格	849	99.18	99.55	4.58	1.48	1.52	1.51	4.18	4.14	4.17	129
短期(1-3)	391	100.92	101.40	1.85	1.58	1.18	1.18	1.82	1.81	1.82	117
中期(3-7)	314	98.03	98.25	4.29	0.99	1.45	1.43	4.18	4.15	4.18	125
長期(7-)	144	96.94	97.35	12.59	2.28	2.63	2.58	10.82	10.68	10.77	171
長期(7-11)	44	95.18	95.66	9.11	1.75	2.41	2.36	8.36	8.26	8.35	176
超長期(11-)	100	97.72	98.10	14.13	2.51	2.73	2.67	11.88	11.72	11.82	168
BBB格	1	93.10	93.31	5.81	1.05	2.40	2.33	5.63	5.56	5.63	201
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	1	93.10	93.31	5.81	1.05	2.40	2.33	5.63	5.56	5.63	201
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	98.84	99.13	3.55	0.92	1.18	1.17	3.44	3.41	3.44	104
短期(1-3)	1,130	99.75	100.07	2.01	0.93	1.03	1.03	1.98	1.97	1.98	101
中期(3-7)	1,080	98.42	98.68	4.38	0.87	1.26	1.25	4.29	4.26	4.29	105
長期(7-)	137	94.62	94.91	9.81	1.24	1.90	1.85	9.10	9.01	9.09	119
長期(7-11)	104	95.32	95.57	8.67	1.06	1.70	1.67	8.27	8.20	8.26	109
超長期(11-)	33	92.37	92.80	13.46	1.82	2.56	2.47	11.84	11.69	11.80	151

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11月末、12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	99.16	99.52	4.01	1.06	1.21	1.21	3.84	3.81	3.84	104
短期 (1-3)	39	99.49	99.65	2.02	0.64	0.88	0.87	2.01	2.00	2.01	85
中期 (3-7)	163	99.63	100.02	3.70	1.11	1.20	1.19	3.61	3.59	3.61	106
長期 (7-)	22	95.09	95.59	9.71	1.36	1.98	1.93	8.91	8.82	8.89	128
長期 (7-11)	18	95.51	95.96	8.52	1.21	1.83	1.79	8.06	7.99	8.06	124
超長期 (11-)	4	93.26	94.00	14.84	1.99	2.63	2.54	12.59	12.43	12.52	150
AAA~A 格	1,023	99.15	99.52	4.63	1.44	1.49	1.48	4.26	4.22	4.25	126
短期 (1-3)	380	100.93	101.41	1.98	1.63	1.21	1.21	1.95	1.94	1.95	119
中期 (3-7)	477	98.58	98.86	4.09	1.03	1.36	1.35	3.99	3.96	3.99	118
長期 (7-)	167	96.69	97.12	12.20	2.16	2.55	2.50	10.57	10.43	10.53	165
長期 (7-11)	62	95.28	95.75	8.94	1.60	2.24	2.20	8.27	8.18	8.26	161
超長期 (11-)	104	97.54	97.93	14.16	2.49	2.72	2.67	11.91	11.75	11.85	168
AAA~BBB 格	1,024	99.14	99.51	4.63	1.44	1.49	1.48	4.26	4.22	4.25	126
短期 (1-3)	380	100.93	101.41	1.98	1.63	1.21	1.21	1.95	1.94	1.95	119
中期 (3-7)	478	98.56	98.84	4.09	1.03	1.36	1.35	3.99	3.96	3.99	118
長期 (7-)	167	96.69	97.12	12.20	2.16	2.55	2.50	10.57	10.43	10.53	165
長期 (7-11)	62	95.28	95.75	8.94	1.60	2.24	2.20	8.27	8.18	8.26	161
超長期 (11-)	104	97.54	97.93	14.16	2.49	2.72	2.67	11.91	11.75	11.85	168
AAA~BB 格	1,024	99.14	99.51	4.63	1.44	1.49	1.48	4.26	4.22	4.25	126
短期 (1-3)	380	100.93	101.41	1.98	1.63	1.21	1.21	1.95	1.94	1.95	119
中期 (3-7)	478	98.56	98.84	4.09	1.03	1.36	1.35	3.99	3.96	3.99	118
長期 (7-)	167	96.69	97.12	12.20	2.16	2.55	2.50	10.57	10.43	10.53	165
長期 (7-11)	62	95.28	95.75	8.94	1.60	2.24	2.20	8.27	8.18	8.26	161
超長期 (11-)	104	97.54	97.93	14.16	2.49	2.72	2.67	11.91	11.75	11.85	168
AAA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA 格	224	99.16	99.52	4.01	1.06	1.21	1.21	3.84	3.81	3.84	104
短期 (1-3)	39	99.49	99.65	2.02	0.64	0.88	0.87	2.01	2.00	2.01	85
中期 (3-7)	163	99.63	100.02	3.70	1.11	1.20	1.19	3.61	3.59	3.61	106
長期 (7-)	22	95.09	95.59	9.71	1.36	1.98	1.93	8.91	8.82	8.89	128
長期 (7-11)	18	95.51	95.96	8.52	1.21	1.83	1.79	8.06	7.99	8.06	124
超長期 (11-)	4	93.26	94.00	14.84	1.99	2.63	2.54	12.59	12.43	12.52	150
A 格	799	99.14	99.52	4.80	1.54	1.57	1.56	4.38	4.34	4.37	132
短期 (1-3)	341	101.10	101.61	1.97	1.74	1.24	1.25	1.94	1.93	1.94	123
中期 (3-7)	314	98.03	98.25	4.29	0.99	1.45	1.43	4.18	4.15	4.18	125
長期 (7-)	144	96.94	97.35	12.59	2.28	2.63	2.58	10.82	10.68	10.77	171
長期 (7-11)	44	95.18	95.66	9.11	1.75	2.41	2.36	8.36	8.26	8.35	176
超長期 (11-)	100	97.72	98.10	14.13	2.51	2.73	2.67	11.88	11.72	11.82	168
BBB 格	1	93.10	93.31	5.81	1.05	2.40	2.33	5.63	5.56	5.63	201
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	1	93.10	93.31	5.81	1.05	2.40	2.33	5.63	5.56	5.63	201
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	2,360	98.87	99.15	3.77	0.94	1.18	1.18	3.65	3.62	3.64	103
短期 (1-3)	1,084	99.71	100.01	2.24	0.93	1.03	1.03	2.21	2.20	2.21	100
中期 (3-7)	1,139	98.57	98.82	4.49	0.91	1.25	1.25	4.39	4.36	4.39	104
長期 (7-)	136	94.78	95.06	9.93	1.25	1.89	1.84	9.20	9.11	9.19	117
長期 (7-11)	103	95.54	95.77	8.81	1.07	1.68	1.65	8.39	8.32	8.39	106
超長期 (11-)	33	92.37	92.80	13.46	1.82	2.56	2.47	11.84	11.69	11.80	151

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11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	906	99.04	99.24	3.64	0.70	0.94	0.94	3.56	3.54	3.56	80
短期 (1-3)	434	99.58	99.75	2.23	0.60	0.77	0.77	2.21	2.20	2.21	74
中期 (3-7)	429	98.80	99.03	4.54	0.78	1.06	1.06	4.45	4.43	4.45	85
長期 (7-)	43	95.85	96.11	8.87	0.95	1.51	1.48	8.49	8.43	8.49	88
長期 (7-11)	43	95.85	96.11	8.87	0.95	1.51	1.48	8.49	8.43	8.49	88
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AAA~A 格	1,763	99.41	99.64	3.80	0.90	1.08	1.07	3.67	3.64	3.66	92
短期 (1-3)	841	99.99	100.20	2.17	0.84	0.88	0.88	2.14	2.13	2.14	85
中期 (3-7)	784	98.67	98.94	4.31	0.83	1.15	1.14	4.22	4.20	4.22	95
長期 (7-)	139	100.02	100.26	10.85	1.75	1.89	1.89	9.80	9.71	9.78	114
長期 (7-11)	79	94.95	95.24	8.74	0.96	1.65	1.61	8.36	8.29	8.36	103
超長期 (11-)	60	106.64	106.82	13.60	2.78	2.16	2.22	11.48	11.36	11.43	127
AAA~BBB 格	3,006	98.88	99.15	4.01	0.98	1.20	1.20	3.81	3.78	3.81	102
短期 (1-3)	1,296	99.92	100.16	2.02	0.86	0.91	0.91	2.00	1.99	2.00	89
中期 (3-7)	1,414	98.56	98.84	4.33	0.92	1.26	1.25	4.24	4.21	4.24	106
長期 (7-)	296	95.84	96.20	11.20	1.76	2.26	2.21	9.97	9.85	9.94	144
長期 (7-11)	159	95.43	95.76	8.80	1.27	1.89	1.85	8.29	8.21	8.28	127
超長期 (11-)	137	96.31	96.71	13.99	2.33	2.69	2.62	11.89	11.74	11.83	164
AAA~BB 格	3,006	98.88	99.15	4.01	0.98	1.20	1.20	3.81	3.78	3.81	102
短期 (1-3)	1,296	99.92	100.16	2.02	0.86	0.91	0.91	2.00	1.99	2.00	89
中期 (3-7)	1,414	98.56	98.84	4.33	0.92	1.26	1.25	4.24	4.21	4.24	106
長期 (7-)	296	95.84	96.20	11.20	1.76	2.26	2.21	9.97	9.85	9.94	144
長期 (7-11)	159	95.43	95.76	8.80	1.27	1.89	1.85	8.29	8.21	8.28	127
超長期 (11-)	137	96.31	96.71	13.99	2.33	2.69	2.62	11.89	11.74	11.83	164
AAA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA 格	906	99.04	99.24	3.64	0.70	0.94	0.94	3.56	3.54	3.56	80
短期 (1-3)	434	99.58	99.75	2.23	0.60	0.77	0.77	2.21	2.20	2.21	74
中期 (3-7)	429	98.80	99.03	4.54	0.78	1.06	1.06	4.45	4.43	4.45	85
長期 (7-)	43	95.85	96.11	8.87	0.95	1.51	1.48	8.49	8.43	8.49	88
長期 (7-11)	43	95.85	96.11	8.87	0.95	1.51	1.48	8.49	8.43	8.49	88
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
A 格	858	99.80	100.07	3.97	1.12	1.22	1.22	3.78	3.75	3.78	104
短期 (1-3)	407	100.43	100.68	2.10	1.09	0.99	0.99	2.07	2.06	2.07	97
中期 (3-7)	354	98.52	98.83	4.03	0.88	1.25	1.24	3.95	3.92	3.95	107
長期 (7-)	96	101.87	102.11	11.72	2.11	2.04	2.07	10.35	10.24	10.32	125
長期 (7-11)	36	93.88	94.20	8.58	0.98	1.82	1.77	8.20	8.13	8.20	120
超長期 (11-)	60	106.64	106.82	13.60	2.78	2.16	2.22	11.48	11.36	11.43	127
BBB 格	1,242	98.13	98.45	4.32	1.08	1.39	1.37	4.02	3.98	4.01	118
短期 (1-3)	455	99.79	100.09	1.76	0.89	0.97	0.97	1.74	1.73	1.74	97
中期 (3-7)	630	98.42	98.72	4.36	1.05	1.40	1.39	4.25	4.22	4.25	120
長期 (7-)	157	92.16	92.63	11.51	1.76	2.62	2.51	10.12	9.99	10.09	173
長期 (7-11)	80	95.90	96.27	8.85	1.56	2.13	2.09	8.22	8.13	8.21	150
超長期 (11-)	77	88.25	88.83	14.29	1.97	3.18	3.00	12.27	12.09	12.21	198
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	99.40	100.04	2.57	1.74	1.72	1.72	2.49	2.47	2.49	165
短期 (1-3)	264	100.61	101.54	1.69	2.22	1.79	1.79	1.65	1.64	1.65	179
中期 (3-7)	144	97.53	97.67	3.89	0.90	1.57	1.55	3.81	3.78	3.81	140
長期 (7-)	8	92.72	93.03	8.24	1.15	2.19	2.12	7.84	7.76	7.84	158
長期 (7-11)	8	92.72	93.03	8.24	1.15	2.19	2.12	7.84	7.76	7.84	158
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11月末、12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	1,073	99.22	99.41	3.73	0.76	0.96	0.95	3.65	3.63	3.65	80
短期 (1-3)	499	99.64	99.80	2.31	0.63	0.78	0.78	2.30	2.29	2.30	74
中期 (3-7)	527	99.09	99.30	4.60	0.86	1.07	1.07	4.51	4.48	4.51	86
長期 (7-)	47	96.32	96.58	8.97	1.01	1.51	1.49	8.56	8.49	8.55	88
長期 (7-11)	47	96.32	96.58	8.97	1.01	1.51	1.49	8.56	8.49	8.55	88
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AAA~A 格	1,861	99.47	99.70	3.94	0.94	1.08	1.08	3.81	3.78	3.81	91
短期 (1-3)	881	99.95	100.16	2.35	0.86	0.89	0.89	2.33	2.32	2.33	85
中期 (3-7)	843	98.85	99.11	4.46	0.88	1.15	1.15	4.36	4.34	4.36	94
長期 (7-)	137	100.22	100.45	10.97	1.77	1.87	1.88	9.90	9.81	9.87	112
長期 (7-11)	77	95.24	95.51	8.93	0.98	1.62	1.58	8.53	8.46	8.52	98
超長期 (11-)	60	106.64	106.82	13.60	2.78	2.16	2.22	11.48	11.36	11.43	127
AAA~BBB 格	2,968	98.89	99.15	4.23	1.00	1.22	1.21	4.02	3.99	4.02	102
短期 (1-3)	1,201	99.90	100.11	2.28	0.87	0.92	0.92	2.25	2.24	2.25	88
中期 (3-7)	1,473	98.67	98.94	4.42	0.95	1.26	1.25	4.32	4.29	4.32	105
長期 (7-)	295	95.92	96.27	11.26	1.77	2.26	2.21	10.01	9.90	9.98	143
長期 (7-11)	158	95.58	95.90	8.89	1.28	1.88	1.84	8.37	8.29	8.36	125
超長期 (11-)	137	96.31	96.71	13.99	2.33	2.69	2.62	11.89	11.74	11.83	164
AAA~BB 格	2,968	98.89	99.15	4.23	1.00	1.22	1.21	4.02	3.99	4.02	102
短期 (1-3)	1,201	99.90	100.11	2.28	0.87	0.92	0.92	2.25	2.24	2.25	88
中期 (3-7)	1,473	98.67	98.94	4.42	0.95	1.26	1.25	4.32	4.29	4.32	105
長期 (7-)	295	95.92	96.27	11.26	1.77	2.26	2.21	10.01	9.90	9.98	143
長期 (7-11)	158	95.58	95.90	8.89	1.28	1.88	1.84	8.37	8.29	8.36	125
超長期 (11-)	137	96.31	96.71	13.99	2.33	2.69	2.62	11.89	11.74	11.83	164
AAA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA 格	1,073	99.22	99.41	3.73	0.76	0.96	0.95	3.65	3.63	3.65	80
短期 (1-3)	499	99.64	99.80	2.31	0.63	0.78	0.78	2.30	2.29	2.30	74
中期 (3-7)	527	99.09	99.30	4.60	0.86	1.07	1.07	4.51	4.48	4.51	86
長期 (7-)	47	96.32	96.58	8.97	1.01	1.51	1.49	8.56	8.49	8.55	88
長期 (7-11)	47	96.32	96.58	8.97	1.01	1.51	1.49	8.56	8.49	8.55	88
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
A 格	788	99.82	100.09	4.23	1.18	1.25	1.25	4.02	4.00	4.02	106
短期 (1-3)	382	100.37	100.62	2.40	1.16	1.04	1.04	2.37	2.36	2.37	100
中期 (3-7)	316	98.46	98.78	4.22	0.92	1.28	1.27	4.12	4.10	4.12	109
長期 (7-)	90	102.26	102.47	12.01	2.16	2.05	2.07	10.56	10.45	10.53	123
長期 (7-11)	30	93.55	93.83	8.87	0.93	1.79	1.73	8.48	8.41	8.48	114
超長期 (11-)	60	106.64	106.82	13.60	2.78	2.16	2.22	11.48	11.36	11.43	127
BBB 格	1,108	97.91	98.22	4.71	1.11	1.44	1.42	4.39	4.35	4.38	120
短期 (1-3)	320	99.74	100.00	2.06	0.91	0.99	0.99	2.04	2.03	2.04	96
中期 (3-7)	630	98.42	98.72	4.36	1.05	1.40	1.39	4.25	4.22	4.25	120
長期 (7-)	157	92.16	92.63	11.51	1.76	2.62	2.51	10.12	9.99	10.09	173
長期 (7-11)	80	95.90	96.27	8.85	1.56	2.13	2.09	8.22	8.13	8.21	150
超長期 (11-)	77	88.25	88.83	14.29	1.97	3.18	3.00	12.27	12.09	12.21	198
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	99.40	100.04	2.57	1.74	1.72	1.72	2.49	2.47	2.49	165
短期 (1-3)	264	100.61	101.54	1.69	2.22	1.79	1.79	1.65	1.64	1.65	179
中期 (3-7)	144	97.53	97.67	3.89	0.90	1.57	1.55	3.81	3.78	3.81	140
長期 (7-)	8	92.72	93.03	8.24	1.15	2.19	2.12	7.84	7.76	7.84	158
長期 (7-11)	8	92.72	93.03	8.24	1.15	2.19	2.12	7.84	7.76	7.84	158
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11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	206	99.42	99.63	3.92	0.71	0.81	0.81	3.83	3.81	3.83	64
短期 (1-3)	84	100.33	100.56	2.34	0.77	0.65	0.66	2.32	2.31	2.32	62
中期 (3-7)	108	99.05	99.24	4.51	0.63	0.86	0.86	4.44	4.42	4.43	65
長期 (7-)	14	96.72	96.94	8.95	0.94	1.39	1.37	8.59	8.53	8.58	77
長期 (7-11)	14	96.72	96.94	8.95	0.94	1.39	1.37	8.59	8.53	8.58	77
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AAA~A 格	1,579	99.38	99.62	3.92	0.89	1.08	1.08	3.79	3.76	3.79	91
短期 (1-3)	692	99.99	100.18	2.28	0.83	0.88	0.88	2.26	2.25	2.26	85
中期 (3-7)	767	98.67	98.94	4.30	0.82	1.14	1.13	4.22	4.19	4.22	95
長期 (7-)	121	100.42	100.65	10.88	1.73	1.83	1.84	9.84	9.75	9.81	108
長期 (7-11)	71	95.23	95.54	8.69	0.96	1.61	1.58	8.32	8.26	8.32	100
超長期 (11-)	50	107.74	107.85	13.96	2.81	2.09	2.17	11.74	11.61	11.68	119
AAA~BBB 格	3,206	98.84	99.13	3.97	1.03	1.26	1.26	3.78	3.75	3.77	109
短期 (1-3)	1,359	99.93	100.23	2.02	0.98	1.03	1.03	2.00	1.99	2.00	101
中期 (3-7)	1,545	98.47	98.74	4.29	0.92	1.29	1.28	4.19	4.17	4.19	109
長期 (7-)	302	95.78	96.14	11.15	1.75	2.27	2.21	9.93	9.81	9.90	145
長期 (7-11)	165	95.34	95.68	8.78	1.27	1.91	1.87	8.27	8.20	8.27	129
超長期 (11-)	137	96.31	96.71	13.99	2.33	2.69	2.62	11.89	11.74	11.83	164
AAA~BB 格	3,206	98.84	99.13	3.97	1.03	1.26	1.26	3.78	3.75	3.77	109
短期 (1-3)	1,359	99.93	100.23	2.02	0.98	1.03	1.03	2.00	1.99	2.00	101
中期 (3-7)	1,545	98.47	98.74	4.29	0.92	1.29	1.28	4.19	4.17	4.19	109
長期 (7-)	302	95.78	96.14	11.15	1.75	2.27	2.21	9.93	9.81	9.90	145
長期 (7-11)	165	95.34	95.68	8.78	1.27	1.91	1.87	8.27	8.20	8.27	129
超長期 (11-)	137	96.31	96.71	13.99	2.33	2.69	2.62	11.89	11.74	11.83	164
AAA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA 格	206	99.42	99.63	3.92	0.71	0.81	0.81	3.83	3.81	3.83	64
短期 (1-3)	84	100.33	100.56	2.34	0.77	0.65	0.66	2.32	2.31	2.32	62
中期 (3-7)	108	99.05	99.24	4.51	0.63	0.86	0.86	4.44	4.42	4.43	65
長期 (7-)	14	96.72	96.94	8.95	0.94	1.39	1.37	8.59	8.53	8.58	77
長期 (7-11)	14	96.72	96.94	8.95	0.94	1.39	1.37	8.59	8.53	8.58	77
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
A 格	1,373	99.37	99.62	3.92	0.92	1.12	1.12	3.78	3.76	3.78	95
短期 (1-3)	607	99.94	100.13	2.27	0.84	0.91	0.91	2.25	2.24	2.25	88
中期 (3-7)	659	98.61	98.89	4.27	0.85	1.19	1.18	4.18	4.16	4.18	99
長期 (7-)	107	100.90	101.13	11.13	1.83	1.88	1.90	9.99	9.90	9.96	112
長期 (7-11)	57	94.87	95.21	8.63	0.96	1.67	1.63	8.26	8.19	8.25	106
超長期 (11-)	50	107.74	107.85	13.96	2.81	2.09	2.17	11.74	11.61	11.68	119
BBB 格	1,627	98.31	98.65	4.03	1.15	1.45	1.43	3.77	3.73	3.76	126
短期 (1-3)	667	99.87	100.28	1.75	1.14	1.18	1.18	1.73	1.72	1.73	117
中期 (3-7)	778	98.28	98.53	4.28	1.02	1.43	1.42	4.17	4.14	4.17	124
長期 (7-)	181	92.69	93.14	11.32	1.77	2.58	2.48	9.99	9.86	9.96	171
長期 (7-11)	94	95.43	95.77	8.84	1.51	2.13	2.09	8.23	8.15	8.23	151
超長期 (11-)	87	89.73	90.30	14.00	2.05	3.10	2.94	12.00	11.82	11.94	195
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	100.51	101.20	1.83	1.72	1.31	1.31	1.79	1.78	1.79	130
短期 (1-3)	201	100.75	101.48	1.59	1.78	1.30	1.30	1.56	1.55	1.56	131
中期 (3-7)	13	98.04	98.13	4.65	0.97	1.38	1.37	4.55	4.52	4.55	115
長期 (7-)	2	92.56	92.73	8.18	0.51	1.54	1.48	8.00	7.94	8.00	95
長期 (7-11)	2	92.56	92.73	8.18	0.51	1.54	1.48	8.00	7.94	8.00	95
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11月末、12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	99.42	99.63	3.92	0.71	0.81	0.81	3.83	3.81	3.83	64
短期 (1-3)	84	100.33	100.56	2.34	0.77	0.65	0.66	2.32	2.31	2.32	62
中期 (3-7)	108	99.05	99.24	4.51	0.63	0.86	0.86	4.44	4.42	4.43	65
長期 (7-)	14	96.72	96.94	8.95	0.94	1.39	1.37	8.59	8.53	8.58	77
長期 (7-11)	14	96.72	96.94	8.95	0.94	1.39	1.37	8.59	8.53	8.58	77
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AAA~A 格	1,676	99.46	99.68	4.07	0.93	1.08	1.08	3.94	3.91	3.94	91
短期 (1-3)	712	99.96	100.14	2.49	0.85	0.89	0.89	2.46	2.45	2.46	84
中期 (3-7)	845	98.86	99.13	4.42	0.88	1.15	1.14	4.33	4.30	4.33	95
長期 (7-)	119	100.66	100.87	11.02	1.74	1.81	1.82	9.95	9.86	9.92	106
長期 (7-11)	69	95.55	95.84	8.90	0.98	1.58	1.55	8.51	8.44	8.50	95
超長期 (11-)	50	107.74	107.85	13.96	2.81	2.09	2.17	11.74	11.61	11.68	119
AAA~BBB 格	3,168	98.85	99.13	4.18	1.05	1.28	1.27	3.97	3.95	3.97	108
短期 (1-3)	1,264	99.91	100.19	2.26	1.01	1.04	1.04	2.24	2.22	2.24	101
中期 (3-7)	1,604	98.57	98.83	4.37	0.95	1.29	1.28	4.27	4.24	4.27	108
長期 (7-)	300	95.86	96.22	11.20	1.76	2.26	2.21	9.97	9.86	9.94	144
長期 (7-11)	163	95.48	95.80	8.87	1.28	1.90	1.86	8.35	8.27	8.34	127
超長期 (11-)	137	96.31	96.71	13.99	2.33	2.69	2.62	11.89	11.74	11.83	164
AAA~BB 格	3,168	98.85	99.13	4.18	1.05	1.28	1.27	3.97	3.95	3.97	108
短期 (1-3)	1,264	99.91	100.19	2.26	1.01	1.04	1.04	2.24	2.22	2.24	101
中期 (3-7)	1,604	98.57	98.83	4.37	0.95	1.29	1.28	4.27	4.24	4.27	108
長期 (7-)	300	95.86	96.22	11.20	1.76	2.26	2.21	9.97	9.86	9.94	144
長期 (7-11)	163	95.48	95.80	8.87	1.28	1.90	1.86	8.35	8.27	8.34	127
超長期 (11-)	137	96.31	96.71	13.99	2.33	2.69	2.62	11.89	11.74	11.83	164
AAA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA 格	206	99.42	99.63	3.92	0.71	0.81	0.81	3.83	3.81	3.83	64
短期 (1-3)	84	100.33	100.56	2.34	0.77	0.65	0.66	2.32	2.31	2.32	62
中期 (3-7)	108	99.05	99.24	4.51	0.63	0.86	0.86	4.44	4.42	4.43	65
長期 (7-)	14	96.72	96.94	8.95	0.94	1.39	1.37	8.59	8.53	8.58	77
長期 (7-11)	14	96.72	96.94	8.95	0.94	1.39	1.37	8.59	8.53	8.58	77
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
A 格	1,470	99.46	99.69	4.09	0.96	1.12	1.12	3.95	3.93	3.95	94
短期 (1-3)	627	99.91	100.09	2.51	0.86	0.92	0.92	2.48	2.47	2.48	87
中期 (3-7)	737	98.83	99.11	4.41	0.92	1.19	1.19	4.31	4.29	4.31	99
長期 (7-)	106	101.17	101.38	11.29	1.85	1.86	1.88	10.12	10.03	10.09	109
長期 (7-11)	56	95.27	95.57	8.89	0.99	1.63	1.59	8.49	8.42	8.48	99
超長期 (11-)	50	107.74	107.85	13.96	2.81	2.09	2.17	11.74	11.61	11.68	119
BBB 格	1,492	98.17	98.50	4.30	1.18	1.49	1.48	4.02	3.98	4.01	128
短期 (1-3)	552	99.84	100.26	1.97	1.21	1.24	1.24	1.95	1.93	1.95	122
中期 (3-7)	759	98.25	98.50	4.31	1.02	1.44	1.42	4.20	4.17	4.20	124
長期 (7-)	181	92.69	93.14	11.32	1.77	2.58	2.48	9.99	9.86	9.96	171
長期 (7-11)	94	95.43	95.77	8.84	1.51	2.13	2.09	8.23	8.15	8.23	151
超長期 (11-)	87	89.73	90.30	14.00	2.05	3.10	2.94	12.00	11.82	11.94	195
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	100.51	101.20	1.83	1.72	1.31	1.31	1.79	1.78	1.79	130
短期 (1-3)	201	100.75	101.48	1.59	1.78	1.30	1.30	1.56	1.55	1.56	131
中期 (3-7)	13	98.04	98.13	4.65	0.97	1.38	1.37	4.55	4.52	4.55	115
長期 (7-)	2	92.56	92.73	8.18	0.51	1.54	1.48	8.00	7.94	8.00	95
長期 (7-11)	2	92.56	92.73	8.18	0.51	1.54	1.48	8.00	7.94	8.00	95
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11月末
銘柄数	12,974	14,003	14,825	15,436	15,639	16,117
額面(10億円)	956,369	972,326	1,018,210	1,056,757	1,085,263	1,123,238
時価単価(円)	109.39	108.39	106.48	104.19	101.51	98.79
利含単価(円)	109.53	108.52	106.59	104.30	101.61	99.01
残存年数(年)	9.68	9.84	9.89	10.01	10.16	10.11
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	0.65
複利(%)	0.02	0.08	0.14	0.27	0.43	0.64
Dur(年)	9.29	9.47	9.36	9.31	9.18	8.87
M-Dur	9.28	9.46	9.34	9.29	9.15	8.82
E-Dur	9.26	9.45	9.33	9.29	9.15	8.83
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 10 月の月末営業日から 2023 年 11 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 11 月の月末営業日までの投資収益率（年率換算、%）」を指す。
- 「前年からの投資収益率」は、「2022 年 12 月の月末営業日から 2023 年 11 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 10 月の月末営業日から 2023 年 11 月の月末営業日までの投資収益率（年率換算、%）。
- 2023 年 10 月の月末営業日において、11 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 11 月ポートフォリオの、右ページには 12 月ポートフォリオの、2023 年 11 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 11 月末（暦上）における残存年数（至最終償還日）で区分。ただし 12 月ポートフォリオでは、2023 年 12 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製、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