

NOMURA-BPI

月間投資収益率 (2024年3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 366.739	-1.39	-2.18	0.80	-2.20	-2.05

出所: 野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング(NFRC)

(注) 投資収益率は年率換算(%)

ポートフォリオ指標 (2024年3月末)

	翌月ポート (2024年4月)	当月ポート (2024年3月)	差
額面[兆円]	1133.95	1124.83	9.12
デュレーション[年]	8.95	8.93	0.02
修正デュレーション	8.90	8.88	0.02
時価単価[円]	98.40	98.40	0.00
利含単価[円]	98.51	98.50	0.00
残存年数[年]	10.22	10.21	0.02
利率[%]	0.78	0.78	0.00
単利[%]	0.73	0.73	0.00
複利[%]	0.72	0.72	0.00
Tスプレッド[bp]	4	4	0

出所: NFRC

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

Global Markets Research

2024年4月2日

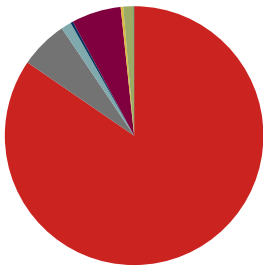
リサーチアナリスト

インデックスプロダクト

インデックス事業部 - NFRC

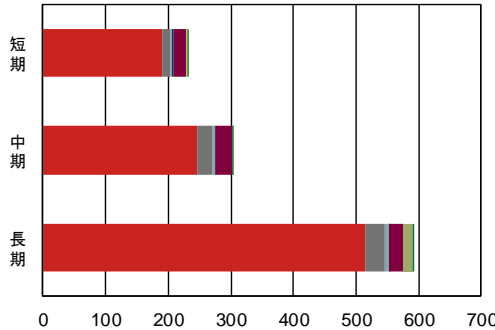
bpi@nfrc.co.jp

銘柄別額面構成 (2024年3月末)



出所: NFRC

残存別額面構成 (2024年3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	84.6%	6.0%	1.3%	0.3%	6.2%	0.3%	1.3%	0.1%
全体	951.21	67.37	14.40	3.46	69.67	3.65	14.37	0.71
短期	190.18	13.10	3.41	1.98	20.30	1.78	-	0.20
中期	245.86	24.05	4.65	1.28	25.59	1.53	-	0.28
長期	515.17	30.21	6.33	0.19	23.78	0.33	14.37	0.22

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 (2024年3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	366.739	-1.39	-2.18	0.80	-2.20	-2.05
国債	377.512	-1.76	-2.58	0.82	-2.47	-2.29
地方債	391.595	0.44	-0.16	0.60	-0.74	-1.12
政保債	367.776	-0.11	-0.81	0.70	-1.52	-1.12
金融債	273.423	0.77	0.54	0.23	-0.22	-0.98
事業債	387.176	1.20	0.49	0.71	-0.55	-0.18
円建外債	391.578	2.31	1.20	1.11	1.66	1.32
MBS	125.336	-0.44	-1.13	0.69	-1.04	-1.63
ABS	113.872	0.82	0.10	0.72	-0.34	-1.06

出所:NFRC

投資収益率は年率換算 (%)

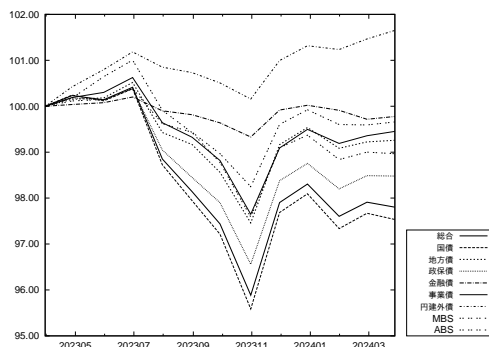
銘柄別・累積投資収益指数の推移

年/月/日	総合	国債	地方債	政保債	金融債	事業債	円建外債	MBS	ABS
2023/03/31	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
2023/11/30	367.118	378.104	391.217	367.399	273.808	385.772	389.052	125.500	113.814
2023/12/29	368.626	379.681	392.689	368.807	274.089	387.346	390.292	125.847	114.174
2024/01/31	365.991	376.748	390.907	366.730	273.788	386.157	389.975	125.176	113.808
2024/02/29	367.144	378.041	391.457	367.807	273.255	386.807	390.861	125.381	113.798
2024/03/01	367.329	378.245	391.578	367.963	273.285	386.932	391.021	125.390	113.817
2024/03/04	367.145	378.027	391.593	367.817	273.335	386.882	391.158	125.356	113.843
2024/03/05	367.398	378.297	391.845	368.042	273.380	387.077	391.364	125.399	113.899
2024/03/06	367.280	378.180	391.662	367.900	273.291	386.931	391.346	125.367	113.840
2024/03/07	366.889	377.749	391.310	367.688	273.216	386.773	391.159	125.260	113.762
2024/03/08	366.505	377.319	391.123	367.359	273.193	386.569	391.153	125.161	113.738
2024/03/11	365.795	376.536	390.634	366.727	273.176	386.182	391.055	124.977	113.662
2024/03/12	365.668	376.398	390.508	366.625	273.161	386.101	391.178	124.933	113.635
2024/03/13	366.033	376.790	390.798	367.033	273.233	386.395	391.306	125.037	113.691
2024/03/14	365.373	376.065	390.301	366.471	273.168	385.997	391.362	124.897	113.591
2024/03/15	365.060	375.719	390.069	366.215	273.148	385.818	391.414	124.841	113.548
2024/03/18	365.944	376.676	390.766	366.963	273.259	386.486	391.632	125.057	113.691
2024/03/19	366.545	377.322	391.326	367.503	273.360	386.912	391.376	125.257	113.798
2024/03/21	366.225	376.992	390.936	367.207	273.176	386.616	391.080	125.136	113.692
2024/03/22	366.141	376.902	390.886	367.145	273.119	386.539	390.979	125.103	113.673
2024/03/25	366.342	377.107	391.159	367.338	273.216	386.740	391.163	125.170	113.746
2024/03/26	366.277	377.032	391.095	367.287	273.241	386.732	391.299	125.172	113.748
2024/03/27	366.973	377.790	391.613	367.908	273.353	387.229	391.436	125.348	113.856
2024/03/28	367.479	378.334	392.031	368.362	273.439	387.607	391.654	125.488	113.944
2024/03/29	366.739	377.512	391.595	367.776	273.423	387.176	391.578	125.336	113.872

出所:NFRC

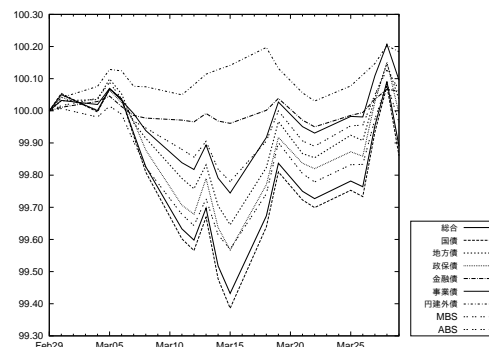
1983年12月末=100。MBSセクターは2003年3月末=100。ABSセクターは2008年3月末=100

指数の推移 (月次) 2023年3月末=100に補正。



出所:NFRC

指数の推移 (日次) 2024年2月末=100に補正。



出所:NFRC

総合 残存別・投資収益率 (2024年3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	366.739	-1.39	-2.18	0.80	-2.20	-2.05
短期 (1-3)	234.647	0.48	0.10	0.38	-0.29	-0.76
中期 (3-7)	337.774	0.74	0.11	0.63	-0.51	-1.71
長期 (7-)	543.729	-3.29	-4.35	1.06	-3.82	-2.76
長期 (7-11)	194.683	-0.02	-0.95	0.93	-1.17	-1.43
超長期 (11-)	242.610	-5.18	-6.32	1.13	-5.29	-3.53
(11-15)	228.094	-1.03	-2.08	1.06	-2.10	-1.22
(15-)	249.975	-6.68	-7.84	1.16	-6.43	-4.36

出所:NFRC

投資収益率は年率換算 (%)

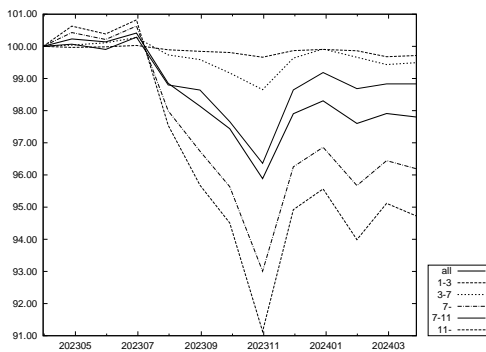
総合 残存別・投資収益指数の推移

総合 年/月/日	全体	短期 (1-3)	中期 (3-7)	長期 (7-)	長期*			
					長期* (7-11)	超長期* (11-)	(11-15)*	(15-)*
2023/03/31	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
2023/11/30	367.118	235.006	338.256	544.071	194.317	243.113	227.497	250.919
2023/12/29	368.626	235.090	339.221	547.500	195.377	244.765	228.791	252.723
2024/01/31	365.991	234.995	338.348	540.767	194.390	240.724	226.820	247.842
2024/02/29	367.144	234.558	337.577	545.152	194.686	243.614	228.280	251.309
2024/03/01	367.329	234.605	337.570	545.649	194.686	243.964	228.333	251.779
2024/03/04	367.145	234.620	337.686	545.002	194.766	243.450	228.166	251.123
2024/03/05	367.398	234.622	337.848	545.589	194.944	243.735	228.435	251.418
2024/03/06	367.280	234.580	337.638	545.470	194.785	243.766	228.294	251.517
2024/03/07	366.889	234.564	337.456	544.514	194.514	243.288	227.928	250.991
2024/03/08	366.505	234.545	337.435	543.444	194.459	242.572	227.560	250.132
2024/03/11	365.795	234.542	337.392	541.436	194.116	241.403	226.722	248.825
2024/03/12	365.668	234.541	337.334	541.118	193.998	241.264	226.571	248.690
2024/03/13	366.033	234.567	337.490	542.013	194.162	241.777	226.954	249.257
2024/03/14	365.373	234.553	337.318	540.271	193.796	240.812	226.391	248.127
2024/03/15	365.060	234.575	337.190	539.457	193.628	240.359	226.142	247.591
2024/03/18	365.944	234.596	337.475	541.740	194.124	241.612	226.942	249.031
2024/03/19	366.545	234.636	337.650	543.287	194.547	242.397	227.714	249.827
2024/03/21	366.225	234.546	337.253	542.792	194.257	242.259	227.467	249.730
2024/03/22	366.141	234.509	337.152	542.674	194.262	242.171	227.475	249.604
2024/03/25	366.342	234.547	337.337	543.057	194.485	242.280	227.753	249.646
2024/03/26	366.277	234.567	337.361	542.829	194.409	242.174	227.631	249.546
2024/03/27	366.973	234.607	337.618	544.578	194.733	243.174	228.253	250.702
2024/03/28	367.479	234.631	337.838	545.822	194.970	243.881	228.775	251.487
2024/03/29	366.739	234.647	337.774	543.729	194.683	242.610	228.094	249.975

出所:NFRC

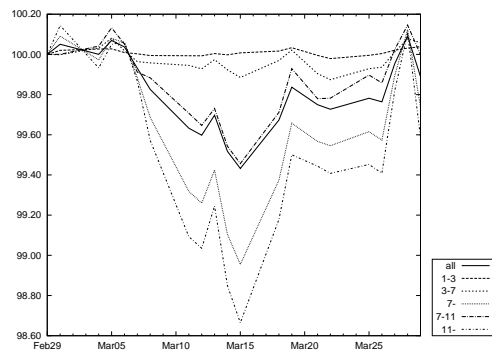
* は 1995年12月末=100。それ以外は、1983年12月末=100。

指数の推移 (月次) 2023年3月末=100に補正。



出所:NFRC

指数の推移 (日次) 2024年2月末=100に補正。



出所:NFRC

国債 残存別・投資収益率 (2024年3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	377.512	-1.76	-2.58	0.82	-2.47	-2.29
短期 (1-3)	221.262	0.39	0.02	0.37	-0.36	-0.83
中期 (3-7)	336.327	0.53	-0.10	0.64	-0.64	-1.87
長期 (7-)	554.290	-3.73	-4.82	1.09	-4.13	-3.07
長期 (7-11)	193.031	-0.22	-1.17	0.95	-1.37	-1.63
超長期 (11-)	241.486	-5.75	-6.92	1.16	-5.64	-3.88
(11-15)	225.933	-1.31	-2.38	1.08	-2.20	-1.46
(15-)	249.426	-7.36	-8.56	1.20	-6.88	-4.76

出所:NFRC

投資収益率は年率換算 (%)

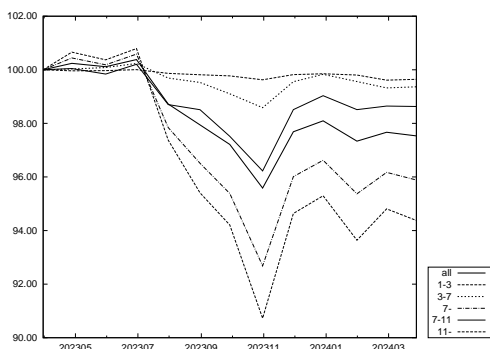
国債 残存別・投資収益指数の推移

国債 年/月/日	全体	短期 (1-3)	中期 (3-7)	長期 (7-)	長期*			
					長期* (7-11)	超長期* (11-)	(11-15)*	(15-)*
2023/03/31	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
2023/11/30	378.104	221.653	336.972	555.024	192.800	242.152	225.500	250.540
2023/12/29	379.681	221.718	337.902	558.559	193.819	243.845	226.756	252.421
2024/01/31	376.748	221.618	336.994	551.309	192.800	239.595	224.741	247.251
2024/02/29	378.041	221.194	336.185	555.938	193.064	242.595	226.168	250.893
2024/03/01	378.245	221.237	336.176	556.471	193.062	242.962	226.214	251.392
2024/03/04	378.027	221.251	336.291	555.757	193.140	242.416	226.044	250.690
2024/03/05	378.297	221.252	336.454	556.369	193.316	242.709	226.311	250.995
2024/03/06	378.180	221.213	336.243	556.258	193.158	242.747	226.162	251.110
2024/03/07	377.749	221.195	336.045	555.245	192.879	242.252	225.795	250.559
2024/03/08	377.319	221.174	336.023	554.094	192.823	241.502	225.425	249.652
2024/03/11	376.536	221.170	335.973	551.968	192.475	240.292	224.587	248.284
2024/03/12	376.398	221.168	335.913	551.637	192.355	240.151	224.435	248.146
2024/03/13	376.790	221.193	336.067	552.571	192.519	240.675	224.807	248.734
2024/03/14	376.065	221.179	335.889	550.724	192.155	239.668	224.246	247.542
2024/03/15	375.719	221.200	335.757	549.855	191.986	239.192	223.997	246.972
2024/03/18	376.676	221.218	336.038	552.256	192.476	240.488	224.792	248.478
2024/03/19	377.322	221.256	336.215	553.863	192.898	241.288	225.562	249.296
2024/03/21	376.992	221.170	335.812	553.366	192.609	241.155	225.316	249.207
2024/03/22	376.902	221.134	335.711	553.235	192.613	241.063	225.322	249.074
2024/03/25	377.107	221.170	335.895	553.614	192.835	241.163	225.599	249.104
2024/03/26	377.032	221.188	335.916	553.374	192.759	241.053	225.476	248.999
2024/03/27	377.790	221.225	336.175	555.221	193.083	242.089	226.096	250.208
2024/03/28	378.334	221.248	336.396	556.526	193.318	242.815	226.615	251.023
2024/03/29	377.512	221.262	336.327	554.290	193.031	241.486	225.933	249.426

出所:NFRC

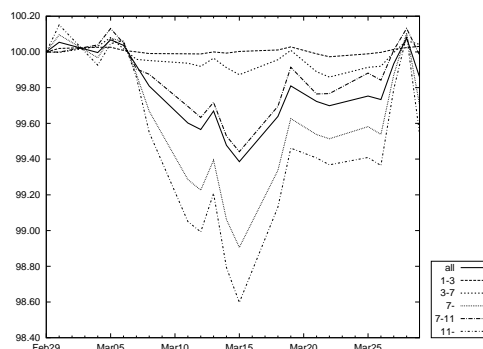
* は 1995年12月末=100。それ以外は、1983年12月末=100。

指数の推移 (月次) 2023年3月末=100に補正。



出所:NFRC

指数の推移 (日次) 2024年2月末=100に補正。



出所:NFRC

このページは空白です。

「除く MBS」残存別・投資収益率(2024年3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	366.638	-1.40	-2.20	0.80	-2.22	-2.06
短期 (1-3)	234.647	0.48	0.10	0.38	-0.29	-0.76
中期 (3-7)	337.774	0.74	0.11	0.63	-0.51	-1.71
長期 (7-)	545.852	-3.36	-4.43	1.07	-3.89	-2.79
長期 (7-11)	194.679	-0.02	-0.95	0.93	-1.17	-1.43
超長期 (11-)	244.650	-5.37	-6.52	1.15	-5.46	-3.61
(11-15)	228.083	-1.03	-2.08	1.06	-2.10	-1.22
(15-)	252.505	-7.02	-8.20	1.19	-6.72	-4.51

出所:NFRC

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

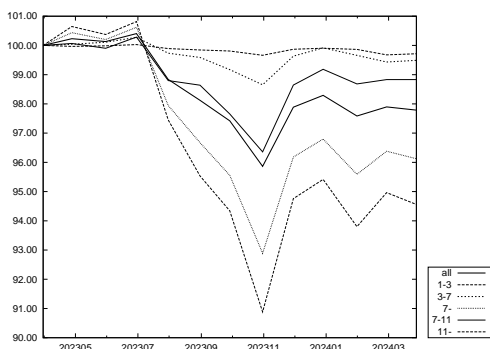
「除く MBS」残存別・投資収益指数の推移

除く MBS 年/月/日	全体	短期 (1-3)	中期 (3-7)	長期 (7-)	長期*			
					(7-11)	超長期* (11-)	(11-15)*	(15-)*
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
2023/11/30	367.015	235.006	338.256	546.187	194.313	245.165	227.485	253.494
2023/12/29	368.529	235.090	339.221	549.679	195.373	246.870	228.780	255.378
2024/01/31	365.886	234.995	338.348	542.823	194.386	242.685	226.809	250.252
2024/02/29	367.046	234.558	337.577	547.312	194.682	245.698	228.269	253.921
2024/03/01	367.233	234.605	337.570	547.822	194.683	246.065	228.322	254.421
2024/03/04	367.048	234.620	337.686	547.161	194.762	245.528	228.155	253.726
2024/03/05	367.302	234.622	337.848	547.760	194.940	245.824	228.424	254.035
2024/03/06	367.184	234.580	337.638	547.641	194.781	245.859	228.283	254.144
2024/03/07	366.792	234.564	337.456	546.669	194.510	245.366	227.916	253.596
2024/03/08	366.407	234.545	337.435	545.579	194.455	244.623	227.549	252.692
2024/03/11	365.695	234.542	337.392	543.532	194.111	243.412	226.711	251.320
2024/03/12	365.568	234.541	337.334	543.209	193.993	243.270	226.559	251.181
2024/03/13	365.934	234.567	337.490	544.119	194.158	243.799	226.943	251.773
2024/03/14	365.271	234.553	337.318	542.342	193.792	242.799	226.380	250.585
2024/03/15	364.956	234.575	337.190	541.510	193.623	242.328	226.131	250.020
2024/03/18	365.842	234.596	337.475	543.836	194.120	243.625	226.930	251.530
2024/03/19	366.444	234.636	337.650	545.407	194.543	244.433	227.703	252.356
2024/03/21	366.124	234.546	337.253	544.911	194.253	244.297	227.456	252.266
2024/03/22	366.041	234.509	337.152	544.792	194.258	244.208	227.463	252.136
2024/03/25	366.242	234.547	337.337	545.179	194.482	244.316	227.742	252.173
2024/03/26	366.176	234.567	337.361	544.944	194.405	244.205	227.620	252.066
2024/03/27	366.874	234.607	337.618	546.725	194.729	245.239	228.242	253.278
2024/03/28	367.381	234.631	337.838	547.990	194.966	245.970	228.764	254.099
2024/03/29	366.638	234.647	337.774	545.852	194.679	244.650	228.083	252.505

出所:NFRC

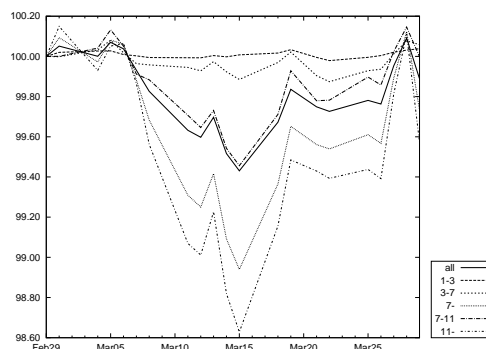
* は 1995 年 12 月末=100。それ以外は、1983 年 12 月末=100。

指数の推移(月次) 2023年3月末=100に補正。



出所:NFRC

指数の推移(日次) 2024年2月末=100に補正。



出所:NFRC

「除く ABS」残存別・投資収益率(2024 年 3 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	366.767	-1.39	-2.19	0.80	-2.20	-2.05
短期 (1-3)	234.607	0.48	0.10	0.38	-0.29	-0.76
中期 (3-7)	337.771	0.74	0.11	0.63	-0.51	-1.71
長期 (7-)	543.730	-3.29	-4.35	1.06	-3.82	-2.76
長期 (7-11)	194.677	-0.02	-0.95	0.93	-1.17	-1.43
超長期 (11-)	242.609	-5.19	-6.32	1.13	-5.29	-3.53
(11-15)	228.086	-1.03	-2.08	1.06	-2.10	-1.22
(15-)	249.977	-6.68	-7.84	1.16	-6.43	-4.36

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 (%)

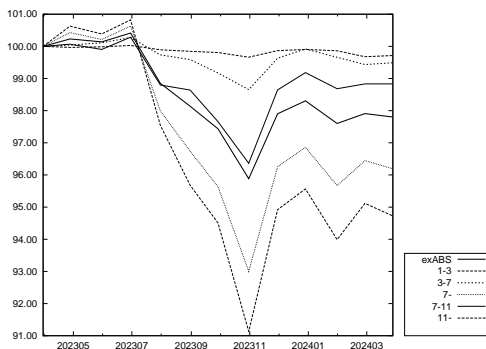
「除く ABS」残存別 投資収益指数の推移

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-)	(11-15)*	(15-)*
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
2023/11/30	367.146	234.966	338.253	544.073	194.311	243.112	227.488	250.921
2023/12/29	368.654	235.050	339.218	547.502	195.371	244.763	228.783	252.725
2024/01/31	366.018	234.955	338.345	540.768	194.384	240.722	226.812	247.844
2024/02/29	367.172	234.518	337.574	545.154	194.680	243.613	228.272	251.311
2024/03/01	367.357	234.565	337.567	545.650	194.680	243.963	228.325	251.781
2024/03/04	367.173	234.580	337.683	545.004	194.760	243.448	228.158	251.126
2024/03/05	367.426	234.582	337.845	545.591	194.938	243.734	228.427	251.420
2024/03/06	367.308	234.540	337.635	545.471	194.779	243.765	228.286	251.519
2024/03/07	366.916	234.524	337.452	544.516	194.508	243.287	227.919	250.994
2024/03/08	366.533	234.505	337.432	543.445	194.453	242.571	227.552	250.135
2024/03/11	365.823	234.502	337.389	541.437	194.110	241.402	226.714	248.827
2024/03/12	365.695	234.501	337.331	541.119	193.992	241.263	226.562	248.692
2024/03/13	366.061	234.527	337.487	542.014	194.156	241.775	226.946	249.259
2024/03/14	365.400	234.513	337.315	540.272	193.790	240.811	226.383	248.129
2024/03/15	365.087	234.535	337.186	539.457	193.622	240.358	226.134	247.593
2024/03/18	365.971	234.556	337.471	541.741	194.118	241.610	226.934	249.033
2024/03/19	366.573	234.596	337.647	543.288	194.541	242.396	227.706	249.829
2024/03/21	366.253	234.506	337.250	542.793	194.251	242.257	227.459	249.732
2024/03/22	366.169	234.468	337.149	542.675	194.256	242.170	227.467	249.607
2024/03/25	366.370	234.507	337.334	543.058	194.479	242.278	227.745	249.648
2024/03/26	366.305	234.527	337.358	542.830	194.403	242.172	227.623	249.548
2024/03/27	367.001	234.567	337.614	544.579	194.727	243.172	228.245	250.704
2024/03/28	367.507	234.591	337.835	545.824	194.964	243.879	228.767	251.489
2024/03/29	366.767	234.607	337.771	543.730	194.677	242.609	228.086	249.977

出所:NFRC

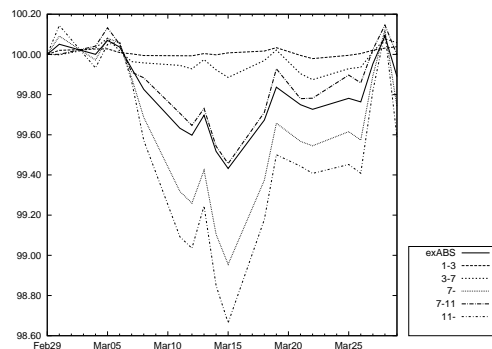
* は 1995 年 12 月末=100。それ以外は、1983 年 12 月末=100。

指数の推移(月次) 2023 年 3 月末=100 に補正。



出所:NFRC

指数の推移(日次) 2024 年 2 月末=100 に補正。



出所:NFRC

「除く国債」残存別・投資収益率(2024年3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	171.686	0.68	0.01	0.67	-0.70	-0.73
短期(1-3)	134.285	0.90	0.50	0.40	0.04	-0.43
中期(3-7)	167.381	1.62	1.04	0.58	0.06	-1.01
長期(7-)	236.179	-0.21	-1.09	0.88	-1.67	-0.68
長期(7-11)	200.502	1.29	0.46	0.82	0.15	-0.05
超長期(11-)	241.710	-1.13	-2.05	0.92	-2.77	-1.06

出所:NFRC

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

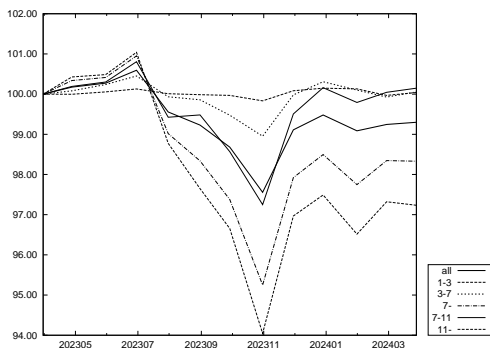
「除く国債」残存別・投資収益指数の推移

除く国債 年/月/日	全体	短期 (1-3)	中期 (3-7)	長期 (7-)	長期*	
					(7-11)	超長期* (11-)
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
2023/11/30	171.359	134.345	167.257	235.203	199.217	241.047
2023/12/29	172.001	134.430	167.805	236.578	200.527	242.349
2024/01/31	171.319	134.406	167.456	234.785	199.789	239.928
2024/02/29	171.594	134.189	167.165	236.218	200.297	241.928
2024/03/01	171.646	134.218	167.166	236.356	200.312	242.146
2024/03/04	171.633	134.229	167.224	236.237	200.405	241.878
2024/03/05	171.726	134.231	167.302	236.452	200.583	242.101
2024/03/06	171.659	134.207	167.202	236.368	200.431	242.076
2024/03/07	171.547	134.208	167.146	236.068	200.216	241.739
2024/03/08	171.454	134.203	167.139	235.780	200.178	241.290
2024/03/11	171.256	134.204	167.133	235.139	199.872	240.456
2024/03/12	171.211	134.206	167.110	235.020	199.768	240.336
2024/03/13	171.343	134.221	167.189	235.345	199.935	240.750
2024/03/14	171.149	134.214	167.119	234.800	199.567	240.122
2024/03/15	171.061	134.229	167.065	234.561	199.405	239.846
2024/03/18	171.357	134.246	167.211	235.338	199.927	240.745
2024/03/19	171.571	134.268	167.293	235.921	200.344	241.399
2024/03/21	171.421	134.218	167.114	235.684	200.055	241.224
2024/03/22	171.391	134.198	167.064	235.662	200.068	241.177
2024/03/25	171.492	134.221	167.156	235.864	200.295	241.342
2024/03/26	171.479	134.236	167.176	235.785	200.223	241.264
2024/03/27	171.703	134.259	167.295	236.355	200.539	241.975
2024/03/28	171.878	134.274	167.402	236.791	200.775	242.520
2024/03/29	171.686	134.285	167.381	236.179	200.502	241.710

出所:NFRC

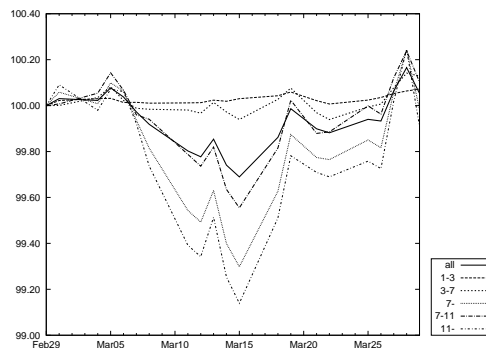
*は1995年12月末=100。それ以外は、1993年12月末=100。

指数の推移(月次) 2023年3月末=100に補正。



出所:NFRC

指数の推移(日次) 2024年2月末=100に補正。



出所:NFRC

銘柄 残存別・月間投資収益率(2024年3月末)

	全体	短期 (1-3)	中期 (3-7)	長期 (7-)	月間投資収益率	
					(7-11)	(11-)
総合	-1.39	0.48	0.74	-3.29	-0.02	-5.18
国債	-1.76	0.39	0.53	-3.73	-0.22	-5.75
30年国債	-5.62	-	-0.34	-5.69	-0.52	-6.18
20年国債	-0.83	0.36	0.40	-1.40	-0.25	-2.13
10年国債	0.21	0.35	0.39	-0.14	-0.14	-
5年国債	0.68	0.35	1.08	-	-	-
中期国債	0.57	0.57	-	-	-	-
地方債	0.44	0.56	0.87	0.04	0.38	-0.32
東京都債	0.00	0.51	0.55	-0.88	0.08	-2.31
五大都市債	0.34	0.58	0.96	-0.21	0.49	-0.59
その他地方債	0.44	0.53	0.70	0.18	0.17	0.19
政保債	-0.11	0.75	1.59	-1.90	0.76	-2.99
公営企業債券	1.19	0.79	1.56	-	-	-
その他政保債	-0.30	0.73	1.59	-1.90	0.76	-2.99
金融債	0.77	0.60	1.14	0.06	0.06	-
特定金融債	-	-	-	-	-	-
事業債	1.20	1.18	2.28	-0.03	2.71	-2.31
円建外債	2.31	0.92	2.92	7.14	6.64	7.76
MBS	-0.44	-	-	-0.44	0.49	-0.46
ABS	0.82	1.10	1.34	-0.17	0.40	-1.18

出所:NFRIC

「除く(銘柄)」残存別・月間投資収益率(2024年3月末)

	全体	短期 (1-3)	中期 (3-7)	長期 (7-)	月間投資収益率	
					(7-11)	(11-)
除く国債	0.68	0.90	1.62	-0.21	1.29	-1.13
除く30年国債	-0.61	0.48	0.74	-2.26	0.02	-4.43
除く20年国債	-1.59	0.50	0.83	-4.31	0.12	-6.77
除く10年国債	-1.94	0.54	0.97	-3.88	0.07	-5.18
除く5年国債	-1.63	0.53	0.66	-3.29	-0.02	-5.18
除く中期国債	-1.45	0.47	0.74	-3.29	-0.02	-5.18
除く地方債	-1.50	0.48	0.72	-3.47	-0.05	-5.38
除く東京都債	-1.39	0.48	0.74	-3.29	-0.02	-5.19
除く五大都市債	-1.40	0.48	0.73	-3.30	-0.02	-5.21
除くその他地方債	-1.47	0.48	0.74	-3.41	-0.03	-5.33
除く政保債	-1.40	0.48	0.72	-3.30	-0.03	-5.21
除く公営企業債券	-1.39	0.48	0.73	-3.29	-0.02	-5.18
除くその他政保債	-1.40	0.48	0.73	-3.30	-0.03	-5.21
除く金融債	-1.39	0.48	0.73	-3.29	-0.02	-5.18
除く特定金融債	-1.39	0.48	0.74	-3.29	-0.02	-5.18
除く事業債	-1.56	0.41	0.60	-3.42	-0.16	-5.28
除く円建外債	-1.40	0.48	0.73	-3.29	-0.02	-5.19
除くMBS	-1.40	0.48	0.74	-3.36	-0.02	-5.37
除くABS	-1.39	0.48	0.74	-3.29	-0.02	-5.19
除くMBS・ABS	-1.40	0.48	0.74	-3.36	-0.02	-5.37

出所:NFRIC

- ・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(2024年3月末)

	全体	短期 (1-3)	中期 (3-7)	長期 (7-)	月間投資収益率	
					(7-11)	(11-)
事業債全体	1.20	1.18	2.28	-0.03	2.71	-2.31
水産・農林業	3.44	-	3.44	-	-	-
鉱業	3.47	1.84	3.73	4.90	4.90	-
建設業	2.43	1.19	2.79	4.23	4.82	3.28
食料品	1.26	0.96	1.43	1.37	1.88	0.49
繊維製品	2.85	1.22	3.33	3.83	5.58	2.27
パルプ・紙	1.74	0.74	3.19	1.09	2.81	-0.72
化学	2.38	1.43	3.27	2.04	4.41	-1.24
医薬品	4.13	1.99	2.70	5.89	6.74	3.54
石油・石炭製品	2.93	1.59	2.88	3.61	4.57	-1.51
ゴム製品	2.51	0.92	2.79	4.13	4.13	-
ガラス・土石製品	2.63	1.55	3.41	2.47	2.10	3.35
鉄鋼	1.87	1.00	2.42	4.09	4.09	-
非鉄金属	2.17	1.25	2.04	4.08	4.08	-
金属製品	1.53	0.81	1.58	5.98	5.98	-
機械	2.40	1.49	2.53	3.71	3.71	-
電気機器	3.07	1.51	3.40	6.13	6.13	-
輸送用機器	1.73	1.19	2.06	2.18	3.12	0.77
精密機器	2.10	1.51	2.92	0.75	0.75	-
その他製品	1.93	1.34	1.06	4.13	2.62	4.69
電気・ガス業	1.32	1.11	1.63	1.15	0.88	1.44
陸運業	-0.55	0.80	1.15	-1.75	1.51	-3.39
海運業	1.72	1.09	1.74	2.45	2.45	-
空運業	2.30	2.39	4.62	1.23	6.55	-0.23
倉庫・運輸関連業	1.36	1.50	1.69	0.46	0.44	0.49
情報・通信業	2.62	1.76	2.83	4.08	3.80	4.85
卸売業	4.50	1.65	3.57	7.52	7.45	7.64
小売業	1.97	1.05	2.65	3.07	3.89	0.02
銀行業	2.21	1.92	2.50	3.68	3.68	-
証券・商品先物取引業	2.73	2.21	4.32	5.27	5.27	-
保険業	1.45	0.56	1.52	4.08	4.08	-
その他金融業	2.41	1.08	3.09	5.30	6.00	-0.90
不動産業	1.48	1.31	2.67	0.34	3.12	-3.91
サービス業	4.27	3.88	4.23	5.10	9.01	-8.93
財投機関債	-0.19	0.75	1.83	-2.34	1.89	-4.12

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(2024年3月末)

	全体	短期 (1-3)	中期 (3-7)	長期 (7-)	月間投資収益率	
					(7-11)	(11-)
事業債・円建外債全体	1.26	1.16	2.32	0.07	2.78	-2.19
AAA～A格	1.24	1.16	2.31	0.06	2.77	-2.21
AAA～AA格	0.82	0.98	2.13	-0.69	2.62	-3.02
AAA格	1.45	0.87	2.45	0.41	4.26	-6.38
AA格	0.65	1.03	2.02	-0.82	2.29	-2.78
A格	2.26	1.52	2.69	2.54	3.13	1.70
BBB格	2.23	1.29	3.19	3.57	3.40	3.88
事業債全体	1.20	1.18	2.28	-0.03	2.71	-2.31
AAA～A格	1.19	1.18	2.27	-0.03	2.72	-2.31
AAA～AA格	0.80	1.01	2.11	-0.72	2.59	-3.03
AAA格	1.45	0.87	2.45	0.41	4.26	-6.38
AA格	0.62	1.07	1.99	-0.85	2.25	-2.79
A格	2.21	1.56	2.64	2.34	3.02	1.33
BBB格	2.28	1.59	3.44	0.23	0.86	-0.98
円建外債全体	2.31	0.92	2.92	7.14	6.64	7.76
AAA～A格	2.33	0.92	2.94	7.22	6.79	7.72
AAA～AA格	1.73	0.46	2.66	6.39	6.32	7.45
AAA格	-	-	-	-	-	-
AA格	1.73	0.46	2.66	6.39	6.32	7.45
A格	2.76	1.29	3.14	7.51	7.17	7.73
BBB格	2.17	0.91	2.58	6.75	5.97	8.02

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(2024年3月末)

	全体	短期 (1-3)	中期 (3-7)	長期 (7-)	月間投資収益率	
					(7-11)	(11-)
事業債						
AAA~AA格	0.80	1.01	2.11	-0.72	2.59	-3.03
AAA~A格	1.19	1.18	2.27	-0.03	2.72	-2.31
AAA~BBB格	1.20	1.18	2.28	-0.03	2.71	-2.31
AAA~BB格	1.20	1.18	2.28	-0.03	2.71	-2.31
AAA格	1.45	0.87	2.45	0.41	4.26	-6.38
AA格	0.62	1.07	1.99	-0.85	2.25	-2.79
A格	2.21	1.56	2.64	2.34	3.02	1.33
BBB格	2.28	1.59	3.44	0.23	0.86	-0.98
BB格	-	-	-	-	-	-
B格以下	-	-	-	-	-	-
格付なし	-	-	-	-	-	-
円建外債						
AAA~AA格	1.73	0.46	2.66	6.39	6.32	7.45
AAA~A格	2.33	0.92	2.94	7.22	6.79	7.72
AAA~BBB格	2.31	0.92	2.92	7.14	6.64	7.76
AAA~BB格	2.31	0.92	2.92	7.14	6.64	7.76
AAA格	-	-	-	-	-	-
AA格	1.73	0.46	2.66	6.39	6.32	7.45
A格	2.76	1.29	3.14	7.51	7.17	7.73
BBB格	2.17	0.91	2.58	6.75	5.97	8.02
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(2024年3月末)

	全体	短期 (1-3)	中期 (3-7)	長期 (7-)	月間投資収益率	
					(7-11)	(11-)
事業債						
AAA~AA格	1.20	1.19	2.44	-0.79	2.85	-3.71
AAA~A格	1.10	1.16	2.21	-0.18	2.65	-2.51
AAA~BBB格	1.18	1.18	2.25	-0.05	2.71	-2.35
AAA~BB格	1.20	1.18	2.28	-0.03	2.71	-2.31
AAA格	-	-	-	-	-	-
AA格	1.20	1.19	2.44	-0.79	2.85	-3.71
A格	1.09	1.15	2.16	-0.09	2.62	-2.34
BBB格	2.87	1.64	3.07	4.42	4.42	4.43
BB格	6.80	-	5.65	17.42	-	17.42
B格以下	-	-	-	-	-	-
格付なし	-	-	-	-	-	-
円建外債						
AAA~AA格	1.42	0.61	2.18	5.92	5.92	-
AAA~A格	2.16	0.85	2.86	7.42	7.66	7.11
AAA~BBB格	2.31	0.92	2.92	7.14	6.64	7.76
AAA~BB格	2.31	0.92	2.92	7.14	6.64	7.76
AAA格	-	-	-	-	-	-
AA格	1.42	0.61	2.18	5.92	5.92	-
A格	2.27	0.90	2.95	7.57	7.97	7.11
BBB格	2.53	1.03	3.00	6.89	5.65	8.31
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(2024年3月末)

	全体	短期 (1-3)	中期 (3-7)	長期 (7-)	月間投資収益率	
					(7-11)	(11-)
事業債						
AAA~AA 格	0.52	0.96	2.11	-1.30	2.67	-3.69
AAA~A 格	1.08	1.09	2.19	-0.16	2.60	-2.34
AAA~BBB 格	1.08	1.11	2.20	-0.15	2.60	-2.34
AAA~BB 格	1.08	1.11	2.20	-0.15	2.60	-2.34
AAA 格	1.42	0.76	1.81	2.40	3.15	0.53
AA 格	0.49	0.96	2.12	-1.33	2.66	-3.70
A 格	1.92	1.28	2.30	2.11	2.52	1.55
BBB 格	2.10	2.07	2.52	0.84	1.40	-0.98
BB 格	-	-	-	-	-	-
B 格以下	-	-	-	-	-	-
格付なし	2.43	1.88	3.00	2.03	4.01	-1.54
円建外債						
AAA~AA 格	1.94	1.94	-	-	-	-
AAA~A 格	3.21	1.77	3.98	13.38	13.38	-
AAA~BBB 格	3.27	1.77	3.98	11.97	13.38	8.14
AAA~BB 格	3.27	1.77	3.98	11.97	13.38	8.14
AAA 格	-	-	-	-	-	-
AA 格	1.94	1.94	-	-	-	-
A 格	3.26	1.76	3.98	13.38	13.38	-
BBB 格	8.14	-	-	8.14	-	8.14
BB 格	-	-	-	-	-	-
B 格以下	-	-	-	-	-	-
格付なし	2.01	0.66	2.52	6.51	5.42	7.74

出所:NFRFC

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

事業債 円建外債 JCR 格付別・月間投資収益率(2024年3月末)

	全体	短期 (1-3)	中期 (3-7)	長期 (7-)	月間投資収益率	
					(7-11)	(11-)
事業債						
AAA~AA 格	1.58	1.09	2.27	1.13	3.08	-1.62
AAA~A 格	1.80	1.26	2.41	1.56	3.10	-0.62
AAA~BBB 格	1.81	1.26	2.42	1.56	3.10	-0.62
AAA~BB 格	1.81	1.26	2.42	1.56	3.10	-0.62
AAA 格	1.46	0.88	2.47	0.41	4.26	-6.38
AA 格	1.64	1.24	2.14	1.38	2.60	-0.20
A 格	2.33	1.68	2.75	2.47	3.15	1.50
BBB 格	2.49	1.52	3.94	-0.13	0.63	-0.98
BB 格	-	-	-	-	-	-
B 格以下	-	-	-	-	-	-
格付なし	0.33	1.03	2.03	-1.45	2.11	-3.25
円建外債						
AAA~AA 格	1.57	0.60	2.35	6.38	6.13	7.45
AAA~A 格	2.24	0.89	2.29	6.51	4.50	7.77
AAA~BBB 格	2.25	0.89	2.30	6.51	4.50	7.77
AAA~BB 格	2.25	0.89	2.30	6.51	4.50	7.77
AAA 格	-	-	-	-	-	-
AA 格	1.57	0.60	2.35	6.38	6.13	7.45
A 格	2.45	1.00	2.27	6.52	3.96	7.78
BBB 格	4.57	-	4.57	-	-	-
BB 格	-	-	-	-	-	-
B 格以下	-	-	-	-	-	-
格付なし	2.34	0.93	3.09	7.96	8.03	7.74

出所:NFRFC

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

事業債 円建外債 Moody's 格付別・月間投資収益率(2024年3月末)

	全体	短期 (1-3)	中期 (3-7)	長期 (7-)	月間投資収益率	
					(7-11)	(11-)
事業債						
AAA~AA格	-	-	-	-	-	-
AAA~A格	0.28	0.96	1.91	-1.67	1.95	-3.81
AAA~BBB格	0.54	0.97	2.09	-1.26	2.13	-3.31
AAA~BB格	0.54	0.97	2.09	-1.26	2.13	-3.31
AAA格	-	-	-	-	-	-
AA格	-	-	-	-	-	-
A格	0.28	0.96	1.91	-1.67	1.95	-3.81
BBB格	3.40	1.18	3.33	5.09	4.31	5.81
BB格	-	-	-	-	-	-
B格以下	-	-	-	-	-	-
格付なし	1.58	1.29	2.38	0.83	3.01	-1.42
円建外債						
AAA~AA格	1.74	0.42	2.68	6.32	6.32	-
AAA~A格	2.24	0.80	2.87	7.80	8.33	7.15
AAA~BBB格	2.36	0.78	2.96	7.16	6.64	7.76
AAA~BB格	2.36	0.78	2.96	7.16	6.64	7.76
AAA格	-	-	-	-	-	-
AA格	1.74	0.42	2.68	6.32	6.32	-
A格	2.85	1.26	3.16	8.50	11.17	7.15
BBB格	2.59	0.72	3.12	6.42	4.62	8.45
BB格	-	-	-	-	-	-
B格以下	-	-	-	-	-	-
格付なし	1.91	1.67	2.28	6.56	6.56	-

出所:NFRFC

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

事業債 円建外債 S&P 格付別・月間投資収益率(2024年3月末)

	全体	短期 (1-3)	中期 (3-7)	長期 (7-)	月間投資収益率	
					(7-11)	(11-)
事業債						
AAA~AA格	-1.21	0.41	0.71	-1.60	0.18	-2.66
AAA~A格	0.92	0.80	2.24	-0.16	2.90	-2.66
AAA~BBB格	0.99	0.87	2.28	-0.10	2.99	-2.66
AAA~BB格	1.08	0.87	2.40	-0.03	2.99	-2.53
AAA格	-	-	-	-	-	-
AA格	-1.21	0.41	0.71	-1.60	0.18	-2.66
A格	1.02	0.80	2.27	-0.02	3.12	-2.66
BBB格	2.84	1.68	3.46	8.69	8.69	-
BB格	6.80	-	5.65	17.42	-	17.42
B格以下	-	-	-	-	-	-
格付なし	1.24	1.26	2.24	-0.03	2.59	-2.22
円建外債						
AAA~AA格	1.41	0.34	2.21	5.92	5.92	-
AAA~A格	2.22	0.77	2.90	7.44	7.70	7.11
AAA~BBB格	2.34	0.85	2.92	7.15	6.65	7.76
AAA~BB格	2.34	0.85	2.92	7.15	6.65	7.76
AAA格	-	-	-	-	-	-
AA格	1.41	0.34	2.21	5.92	5.92	-
A格	2.33	0.84	2.98	7.59	8.03	7.11
BBB格	2.50	0.96	2.96	6.89	5.65	8.31
BB格	-	-	-	-	-	-
B格以下	-	-	-	-	-	-
格付なし	1.78	1.68	2.33	5.88	5.88	-

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(2024年3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	1,124,834	98.40	98.50	10.21	0.78	0.73	0.72	8.93	8.88	8.89	4
短期(1-3)	230,966	100.36	100.42	1.99	0.38	0.19	0.19	1.99	1.98	1.99	5
中期(3-7)	303,252	101.29	101.40	4.86	0.63	0.37	0.38	4.78	4.77	4.78	5
長期(7-)	590,617	96.14	96.27	16.16	1.02	1.14	1.12	14.00	13.91	13.93	4
長期(7-11)	203,923	102.66	102.82	8.77	0.95	0.65	0.66	8.42	8.39	8.41	4
超長期(11-)	386,693	92.70	92.82	20.07	1.05	1.43	1.38	17.27	17.14	17.15	4
(11-15)	94,857	100.28	100.42	13.00	1.06	1.02	1.02	12.14	12.08	12.12	4
(15-)	291,836	90.24	90.35	22.36	1.04	1.57	1.51	19.12	18.97	18.97	4
国債	951,212	98.49	98.59	10.72	0.80	0.72	0.70	9.33	9.28	9.29	0
短期(1-3)	190,180	100.45	100.51	1.99	0.37	0.14	0.14	1.98	1.98	1.98	0
中期(3-7)	245,862	101.61	101.71	4.88	0.64	0.33	0.33	4.80	4.79	4.80	0
長期(7-)	515,170	96.27	96.40	16.72	1.04	1.15	1.11	14.44	14.35	14.36	1
長期(7-11)	176,304	103.11	103.27	8.81	0.97	0.62	0.63	8.45	8.42	8.44	0
超長期(11-)	338,866	92.72	92.83	20.84	1.08	1.45	1.39	17.91	17.78	17.78	1
(11-15)	83,010	100.89	101.02	13.07	1.08	0.99	0.99	12.20	12.14	12.18	1
(15-)	255,855	90.06	90.17	23.36	1.08	1.62	1.53	19.98	19.83	19.82	1
地方債	67,365	98.58	98.68	7.43	0.59	0.64	0.65	6.93	6.90	6.91	12
短期(1-3)	13,102	100.18	100.24	2.03	0.38	0.26	0.26	2.02	2.02	2.02	11
中期(3-7)	24,052	100.15	100.23	4.97	0.50	0.45	0.45	4.91	4.89	4.91	11
長期(7-)	30,211	96.65	96.76	11.72	0.75	0.96	0.99	10.80	10.74	10.75	12
政保債	14,396	98.11	98.29	9.18	0.69	0.70	0.68	8.05	8.01	8.02	7
短期(1-3)	3,410	99.97	100.04	1.87	0.21	0.20	0.20	1.86	1.86	1.86	6
中期(3-7)	4,655	100.91	101.06	4.51	0.53	0.37	0.37	4.45	4.44	4.45	6
長期(7-)	6,331	95.04	95.31	16.55	1.07	1.24	1.19	14.36	14.26	14.29	8
金融債	3,455	99.12	99.17	3.16	0.23	0.48	0.48	3.13	3.12	3.13	26
短期(1-3)	1,982	99.47	99.50	2.05	0.14	0.39	0.39	2.04	2.04	2.04	24
中期(3-7)	1,280	99.01	99.08	4.13	0.32	0.55	0.55	4.09	4.08	4.09	26
長期(7-)	193	96.27	96.35	8.23	0.51	1.02	1.00	8.05	8.01	8.05	42
事業債	69,672	97.33	97.49	7.54	0.69	0.90	0.87	6.58	6.54	6.55	39
短期(1-3)	20,304	99.78	99.87	1.99	0.41	0.50	0.50	1.99	1.98	1.99	36
中期(3-7)	25,586	99.71	99.86	4.67	0.65	0.70	0.70	4.59	4.58	4.59	39
長期(7-)	23,782	92.67	92.90	15.35	0.98	1.49	1.42	13.10	12.99	13.01	42
長期(7-11)	10,193	98.48	98.70	8.53	0.89	1.10	1.08	8.20	8.16	8.20	48
超長期(11-)	13,589	88.31	88.55	20.46	1.05	1.81	1.70	17.19	17.03	17.03	37
円建外債	3,652	99.31	99.60	3.84	1.10	1.22	1.22	3.66	3.63	3.66	95
短期(1-3)	1,784	100.00	100.29	2.14	1.09	1.06	1.06	2.12	2.10	2.12	90
中期(3-7)	1,534	98.95	99.21	4.25	0.97	1.23	1.22	4.16	4.13	4.16	93
長期(7-)	333	97.25	97.75	11.03	1.76	2.11	2.07	9.82	9.71	9.79	128
長期(7-11)	185	96.94	97.25	8.66	1.30	1.73	1.71	8.16	8.09	8.16	110
超長期(11-)	149	97.64	98.37	13.97	2.34	2.56	2.52	11.84	11.70	11.79	150
MBS	14,373	96.64	96.67	7.04	0.64	0.75	1.02	6.64	6.61	6.82	22
ABS	710	96.86	97.03	5.76	0.70	1.07	1.05	5.37	5.34	5.37	66
短期(1-3)	204	99.96	100.11	1.92	0.71	0.72	0.72	1.91	1.90	1.91	58
中期(3-7)	283	98.38	98.52	4.79	0.65	0.98	0.97	4.71	4.68	4.71	65
長期(7-)	223	92.12	92.33	10.50	0.74	1.54	1.47	9.71	9.63	9.69	73

出所:NFRG

「除く」銘柄 残存別・ポートフォリオ指標 (2024年3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	1,110,461	98.42	98.53	10.25	0.78	0.73	0.71	8.96	8.91	8.92	4
短期 (1-3)	230,966	100.36	100.42	1.99	0.38	0.19	0.19	1.99	1.98	1.99	5
中期 (3-7)	303,252	101.29	101.40	4.86	0.63	0.37	0.38	4.78	4.77	4.78	5
長期 (7-)	576,244	96.13	96.26	16.39	1.02	1.15	1.12	14.19	14.10	14.11	3
長期 (7-11)	203,719	102.67	102.82	8.77	0.95	0.65	0.66	8.42	8.39	8.42	4
超長期 (11-)	372,524	92.56	92.68	20.56	1.06	1.45	1.39	17.68	17.55	17.56	3
(11-15)	94,833	100.28	100.42	13.00	1.06	1.02	1.02	12.15	12.08	12.13	4
(15-)	277,691	89.92	90.03	23.14	1.07	1.62	1.54	19.79	19.64	19.63	3
除く ABS	1,124,125	98.40	98.51	10.21	0.78	0.73	0.72	8.93	8.88	8.89	4
短期 (1-3)	230,762	100.36	100.42	1.99	0.38	0.19	0.19	1.99	1.98	1.99	5
中期 (3-7)	302,969	101.30	101.40	4.86	0.63	0.37	0.38	4.78	4.77	4.78	5
長期 (7-)	590,393	96.14	96.27	16.17	1.02	1.14	1.12	14.00	13.91	13.93	4
長期 (7-11)	203,786	102.67	102.82	8.77	0.95	0.65	0.66	8.42	8.39	8.41	4
超長期 (11-)	386,608	92.71	92.82	20.07	1.05	1.43	1.38	17.27	17.14	17.15	4
(11-15)	94,799	100.29	100.42	13.00	1.06	1.02	1.02	12.14	12.08	12.12	4
(15-)	291,808	90.24	90.35	22.36	1.04	1.57	1.51	19.12	18.97	18.97	4
除く MBS・ABS	1,109,752	98.42	98.53	10.25	0.78	0.73	0.71	8.96	8.91	8.92	4
短期 (1-3)	230,762	100.36	100.42	1.99	0.38	0.19	0.19	1.99	1.98	1.99	5
中期 (3-7)	302,969	101.30	101.40	4.86	0.63	0.37	0.38	4.78	4.77	4.78	5
長期 (7-)	576,021	96.13	96.26	16.39	1.02	1.15	1.12	14.19	14.10	14.11	3
長期 (7-11)	203,582	102.67	102.83	8.77	0.95	0.65	0.66	8.42	8.39	8.42	4
超長期 (11-)	372,439	92.56	92.68	20.56	1.06	1.45	1.39	17.69	17.56	17.56	3
(11-15)	94,775	100.29	100.42	13.00	1.06	1.02	1.02	12.15	12.08	12.13	4
(15-)	277,663	89.92	90.03	23.14	1.07	1.62	1.54	19.79	19.64	19.63	3
除く 国債	173,622	97.90	98.02	7.42	0.65	0.77	0.78	6.71	6.67	6.70	25
短期 (1-3)	40,786	99.92	100.01	2.00	0.40	0.42	0.42	2.00	1.99	2.00	27
中期 (3-7)	57,389	99.95	100.07	4.76	0.58	0.58	0.58	4.69	4.68	4.69	26
長期 (7-)	75,447	95.24	95.40	12.36	0.83	1.11	1.15	10.99	10.91	10.97	24
長期 (7-11)	27,619	99.79	99.95	8.52	0.82	0.87	0.86	8.22	8.19	8.22	26
超長期 (11-)	47,828	92.62	92.77	14.58	0.84	1.26	1.32	12.70	12.61	12.68	22

出所:NFRC

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

銘柄 残存別・ポートフォリオ指標 (2024年3月末、4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	1,133,949	98.40	98.51	10.22	0.78	0.73	0.72	8.95	8.90	8.91	4
短期 (1-3)	231,350	100.36	100.42	2.02	0.38	0.19	0.19	2.01	2.01	2.01	5
中期 (3-7)	307,006	101.27	101.38	4.87	0.63	0.37	0.38	4.79	4.78	4.79	5
長期 (7-)	595,593	96.16	96.29	16.17	1.01	1.14	1.12	14.01	13.92	13.93	4
長期 (7-11)	206,812	102.63	102.78	8.79	0.95	0.65	0.66	8.44	8.41	8.44	4
超長期 (11-)	388,781	92.72	92.84	20.10	1.05	1.43	1.38	17.29	17.16	17.17	4
(11-15)	95,125	100.25	100.38	13.01	1.05	1.02	1.02	12.15	12.09	12.13	4
(15-)	293,657	90.28	90.39	22.39	1.05	1.57	1.51	19.14	18.99	18.99	4
国債	960,624	98.49	98.60	10.72	0.80	0.72	0.71	9.34	9.29	9.30	1
短期 (1-3)	190,304	100.45	100.51	2.01	0.37	0.14	0.14	2.00	2.00	2.00	0
中期 (3-7)	249,677	101.59	101.68	4.88	0.64	0.33	0.33	4.80	4.79	4.80	0
長期 (7-)	520,642	96.29	96.42	16.71	1.04	1.14	1.11	14.43	14.34	14.35	1
長期 (7-11)	179,448	103.05	103.20	8.82	0.97	0.62	0.63	8.46	8.44	8.46	0
超長期 (11-)	341,194	92.74	92.85	20.86	1.08	1.45	1.39	17.92	17.79	17.79	1
(11-15)	83,235	100.87	101.00	13.07	1.08	0.99	0.99	12.20	12.14	12.18	1
(15-)	257,959	90.11	90.22	23.37	1.08	1.62	1.53	19.99	19.83	19.82	1
地方債	67,321	98.58	98.67	7.47	0.59	0.64	0.65	6.97	6.94	6.95	12
短期 (1-3)	13,071	100.17	100.22	2.08	0.37	0.26	0.26	2.08	2.07	2.08	11
中期 (3-7)	24,141	100.13	100.21	5.03	0.50	0.45	0.45	4.96	4.95	4.96	11
長期 (7-)	30,109	96.65	96.77	11.76	0.76	0.96	0.99	10.83	10.77	10.78	12
政保債	14,406	98.10	98.28	9.26	0.69	0.70	0.68	8.13	8.09	8.10	7
短期 (1-3)	3,336	99.95	100.01	1.94	0.20	0.20	0.20	1.93	1.93	1.93	6
中期 (3-7)	4,689	100.90	101.04	4.56	0.53	0.37	0.37	4.50	4.49	4.50	6
長期 (7-)	6,381	95.07	95.34	16.54	1.07	1.24	1.19	14.36	14.26	14.29	8
金融債	3,445	99.11	99.16	3.21	0.23	0.49	0.49	3.18	3.17	3.18	26
短期 (1-3)	2,011	99.45	99.48	2.12	0.15	0.40	0.39	2.12	2.11	2.12	24
中期 (3-7)	1,241	99.01	99.08	4.21	0.33	0.56	0.56	4.17	4.16	4.17	27
長期 (7-)	193	96.27	96.35	8.23	0.51	1.02	1.00	8.05	8.01	8.05	42
事業債	69,547	97.32	97.48	7.58	0.70	0.90	0.88	6.62	6.58	6.59	39
短期 (1-3)	20,608	99.80	99.89	2.06	0.42	0.51	0.51	2.05	2.05	2.05	36
中期 (3-7)	25,489	99.65	99.80	4.77	0.65	0.71	0.71	4.68	4.67	4.68	39
長期 (7-)	23,450	92.61	92.85	15.48	0.99	1.50	1.43	13.20	13.10	13.12	42
長期 (7-11)	9,916	98.54	98.76	8.63	0.91	1.11	1.09	8.28	8.24	8.28	48
超長期 (11-)	13,534	88.27	88.51	20.51	1.05	1.81	1.70	17.22	17.07	17.07	37
円建外債	3,628	99.30	99.60	3.86	1.10	1.22	1.22	3.68	3.65	3.67	95
短期 (1-3)	1,812	99.98	100.26	2.18	1.09	1.06	1.06	2.16	2.14	2.16	90
中期 (3-7)	1,482	98.95	99.20	4.29	0.98	1.24	1.23	4.20	4.17	4.20	93
長期 (7-)	333	97.25	97.75	11.03	1.76	2.11	2.07	9.82	9.71	9.79	128
長期 (7-11)	185	96.94	97.25	8.66	1.30	1.73	1.71	8.16	8.09	8.16	110
超長期 (11-)	149	97.64	98.37	13.97	2.34	2.56	2.52	11.84	11.70	11.79	150
MBS	14,270	96.62	96.65	7.13	0.62	0.76	1.02	6.73	6.69	6.91	22
ABS	710	96.86	97.03	5.81	0.70	1.08	1.05	5.42	5.39	5.42	66
短期 (1-3)	208	99.94	100.09	1.99	0.71	0.73	0.72	1.98	1.97	1.98	58
中期 (3-7)	288	98.25	98.39	4.94	0.65	0.99	0.99	4.85	4.83	4.85	65
長期 (7-)	215	92.03	92.24	10.68	0.76	1.56	1.49	9.86	9.78	9.85	74

出所:NFRIC

「除く」銘柄 残存別・ポートフォリオ指標 (2024年3月末、4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	1,119,679	98.42	98.53	10.26	0.78	0.73	0.71	8.97	8.92	8.93	4
短期 (1-3)	231,350	100.36	100.42	2.02	0.38	0.19	0.19	2.01	2.01	2.01	5
中期 (3-7)	307,006	101.27	101.38	4.87	0.63	0.37	0.38	4.79	4.78	4.79	5
長期 (7-)	581,323	96.15	96.28	16.39	1.02	1.15	1.12	14.19	14.10	14.11	3
長期 (7-11)	206,608	102.63	102.79	8.80	0.95	0.65	0.66	8.45	8.42	8.44	4
超長期 (11-)	374,715	92.57	92.70	20.58	1.06	1.45	1.40	17.70	17.57	17.57	3
(11-15)	95,125	100.25	100.38	13.01	1.05	1.02	1.02	12.15	12.09	12.13	4
(15-)	279,591	89.96	90.08	23.16	1.07	1.62	1.54	19.80	19.65	19.63	3
除く ABS	1,133,239	98.40	98.51	10.23	0.78	0.73	0.72	8.95	8.90	8.91	4
短期 (1-3)	231,142	100.36	100.42	2.02	0.38	0.19	0.19	2.01	2.01	2.01	5
中期 (3-7)	306,719	101.28	101.38	4.87	0.63	0.37	0.38	4.79	4.78	4.79	5
長期 (7-)	595,379	96.16	96.29	16.17	1.02	1.14	1.12	14.01	13.92	13.94	4
長期 (7-11)	206,683	102.63	102.79	8.79	0.95	0.65	0.66	8.44	8.41	8.44	4
超長期 (11-)	388,696	92.72	92.84	20.10	1.05	1.43	1.38	17.29	17.16	17.17	4
(11-15)	95,067	100.25	100.38	13.01	1.05	1.02	1.02	12.15	12.09	12.13	4
(15-)	293,629	90.28	90.40	22.39	1.05	1.57	1.51	19.14	18.99	18.99	4
除く MBS・ABS	1,118,969	98.42	98.53	10.27	0.78	0.73	0.71	8.98	8.93	8.93	4
短期 (1-3)	231,142	100.36	100.42	2.02	0.38	0.19	0.19	2.01	2.01	2.01	5
中期 (3-7)	306,719	101.28	101.38	4.87	0.63	0.37	0.38	4.79	4.78	4.79	5
長期 (7-)	581,109	96.15	96.28	16.39	1.02	1.15	1.12	14.19	14.10	14.11	3
長期 (7-11)	206,479	102.63	102.79	8.80	0.95	0.65	0.66	8.45	8.42	8.44	4
超長期 (11-)	374,630	92.58	92.70	20.58	1.06	1.45	1.40	17.70	17.57	17.57	3
(11-15)	95,067	100.25	100.38	13.01	1.05	1.02	1.02	12.15	12.09	12.13	4
(15-)	279,563	89.97	90.08	23.16	1.07	1.62	1.54	19.80	19.65	19.63	3
除く 国債	173,326	97.89	98.02	7.47	0.65	0.77	0.78	6.75	6.72	6.75	25
短期 (1-3)	41,045	99.92	100.01	2.07	0.40	0.42	0.42	2.06	2.05	2.06	28
中期 (3-7)	57,329	99.91	100.04	4.84	0.58	0.59	0.58	4.76	4.75	4.76	26
長期 (7-)	74,952	95.23	95.39	12.43	0.84	1.12	1.15	11.05	10.98	11.03	24
長期 (7-11)	27,364	99.85	100.01	8.60	0.84	0.87	0.87	8.29	8.25	8.28	26
超長期 (11-)	47,588	92.58	92.73	14.64	0.84	1.27	1.33	12.76	12.67	12.73	22

出所:NFRC

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

事業債 業種別・ポートフォリオ指標 (1/4) (2024年3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	69,672	97.33	97.49	7.54	0.69	0.90	0.87	6.58	6.54	6.55	39
短期 (1-3)	20,304	99.78	99.87	1.99	0.41	0.50	0.50	1.99	1.98	1.99	36
中期 (3-7)	25,586	99.71	99.86	4.67	0.65	0.70	0.70	4.59	4.58	4.59	39
長期 (7-)	23,782	92.67	92.90	15.35	0.98	1.49	1.42	13.10	12.99	13.01	42
長期 (7-11)	10,193	98.48	98.70	8.53	0.89	1.10	1.08	8.20	8.16	8.20	48
超長期 (11-)	13,589	88.31	88.55	20.46	1.05	1.81	1.70	17.19	17.03	17.03	37
水産・農林業	18	100.04	100.15	4.19	0.78	0.78	0.78	4.13	4.11	4.13	49
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	18	100.04	100.15	4.19	0.78	0.78	0.78	4.13	4.11	4.13	49
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
鉱業	30	97.09	97.14	5.49	0.21	0.72	0.71	5.40	5.38	5.40	33
短期 (1-3)	10	99.30	99.30	1.96	0.08	0.44	0.44	1.96	1.96	1.96	30
中期 (3-7)	10	96.54	96.56	6.96	0.30	0.83	0.81	6.89	6.86	6.89	35
長期 (7-)	10	95.44	95.55	7.55	0.25	0.90	0.88	7.47	7.44	7.47	36
長期 (7-11)	10	95.44	95.55	7.55	0.25	0.90	0.88	7.47	7.44	7.47	36
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
建設業	1,296	98.60	98.72	4.44	0.42	0.66	0.65	4.29	4.27	4.29	35
短期 (1-3)	429	99.60	99.67	1.91	0.25	0.43	0.43	1.90	1.90	1.90	29
中期 (3-7)	702	99.01	99.12	4.47	0.47	0.67	0.67	4.41	4.39	4.41	36
長期 (7-)	165	94.30	94.52	10.88	0.71	1.25	1.21	10.28	10.22	10.27	42
長期 (7-11)	99	97.44	97.68	8.54	0.71	1.05	1.03	8.28	8.23	8.27	43
超長期 (11-)	66	89.60	89.79	14.39	0.71	1.58	1.50	13.56	13.46	13.54	40
食料品	1,500	98.62	98.73	5.02	0.46	0.69	0.69	4.81	4.79	4.81	33
短期 (1-3)	513	99.64	99.68	2.01	0.27	0.43	0.43	2.01	2.00	2.01	29
中期 (3-7)	677	98.92	99.02	4.48	0.41	0.65	0.65	4.43	4.41	4.43	34
長期 (7-)	310	96.27	96.51	11.19	0.89	1.23	1.21	10.48	10.41	10.46	39
長期 (7-11)	190	98.86	99.14	9.05	0.88	1.02	1.02	8.69	8.65	8.69	37
超長期 (11-)	120	92.17	92.34	14.59	0.92	1.59	1.53	13.51	13.40	13.47	43
繊維製品	275	98.76	98.87	4.63	0.48	0.69	0.69	4.44	4.42	4.44	36
短期 (1-3)	70	99.65	99.70	1.66	0.23	0.40	0.40	1.66	1.66	1.66	28
中期 (3-7)	169	99.22	99.32	4.23	0.47	0.66	0.66	4.18	4.17	4.18	37
長期 (7-)	36	94.89	95.17	12.24	1.03	1.45	1.41	11.37	11.29	11.36	51
長期 (7-11)	16	100.87	101.32	9.66	1.29	1.19	1.19	9.07	9.02	9.07	49
超長期 (11-)	20	90.10	90.26	14.30	0.83	1.69	1.61	13.43	13.33	13.41	52
パルプ・紙	369	97.61	97.73	5.09	0.45	0.83	0.81	4.83	4.81	4.83	46
短期 (1-3)	159	99.43	99.53	2.15	0.33	0.57	0.57	2.14	2.13	2.14	42
中期 (3-7)	140	98.25	98.35	5.06	0.44	0.78	0.77	4.99	4.98	4.99	43
長期 (7-)	70	92.24	92.42	11.79	0.75	1.54	1.48	11.05	10.96	11.03	62
長期 (7-11)	35	95.04	95.19	8.17	0.62	1.35	1.32	7.96	7.91	7.95	74
超長期 (11-)	35	89.44	89.65	15.41	0.88	1.74	1.65	14.33	14.21	14.30	48
化学	2,300	96.84	96.97	5.62	0.45	0.86	0.84	5.25	5.22	5.24	45
短期 (1-3)	710	99.54	99.60	1.92	0.25	0.47	0.47	1.91	1.91	1.91	33
中期 (3-7)	983	98.49	98.62	4.64	0.42	0.74	0.73	4.58	4.56	4.58	42
長期 (7-)	607	91.02	91.22	11.56	0.72	1.57	1.49	10.68	10.60	10.66	66
長期 (7-11)	334	96.17	96.34	8.22	0.64	1.17	1.15	8.00	7.95	7.99	57
超長期 (11-)	273	84.72	84.96	15.65	0.83	2.12	1.95	14.41	14.26	14.37	78
医薬品	708	96.86	96.97	6.56	0.48	0.88	0.86	6.20	6.17	6.20	41
短期 (1-3)	163	99.73	99.77	2.20	0.30	0.42	0.42	2.20	2.19	2.20	27
中期 (3-7)	180	99.44	99.49	4.41	0.49	0.63	0.62	4.36	4.35	4.36	32
長期 (7-)	365	94.30	94.47	9.58	0.56	1.22	1.18	9.05	8.99	9.04	51
長期 (7-11)	265	95.51	95.69	7.60	0.43	1.07	1.05	7.46	7.42	7.46	53
超長期 (11-)	100	91.09	91.25	14.82	0.91	1.63	1.55	13.45	13.35	13.41	48

出所:NFRC

- 東証 33 業種分類を参考に NFRC で分類

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

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
事業債 全体	69,547	97.32	97.48	7.58	0.70	0.90	0.88	6.62	6.58	6.59	39
短期 (1-3)	20,608	99.80	99.89	2.06	0.42	0.51	0.51	2.05	2.05	2.05	36
中期 (3-7)	25,489	99.65	99.80	4.77	0.65	0.71	0.71	4.68	4.67	4.68	39
長期 (7-)	23,450	92.61	92.85	15.48	0.99	1.50	1.43	13.20	13.10	13.12	42
長期 (7-11)	9,916	98.54	98.76	8.63	0.91	1.11	1.09	8.28	8.24	8.28	48
超長期 (11-)	13,534	88.27	88.51	20.51	1.05	1.81	1.70	17.22	17.07	17.07	37
水産・農林業	18	100.04	100.15	4.19	0.78	0.78	0.78	4.13	4.11	4.13	49
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	18	100.04	100.15	4.19	0.78	0.78	0.78	4.13	4.11	4.13	49
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
鉱業	30	97.09	97.14	5.49	0.21	0.72	0.71	5.40	5.38	5.40	33
短期 (1-3)	10	99.30	99.30	1.96	0.08	0.44	0.44	1.96	1.96	1.96	30
中期 (3-7)	10	96.54	96.56	6.96	0.30	0.83	0.81	6.89	6.86	6.89	35
長期 (7-)	10	95.44	95.55	7.55	0.25	0.90	0.88	7.47	7.44	7.47	36
長期 (7-11)	10	95.44	95.55	7.55	0.25	0.90	0.88	7.47	7.44	7.47	36
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
建設業	1,286	98.59	98.70	4.49	0.43	0.67	0.66	4.34	4.32	4.34	35
短期 (1-3)	434	99.56	99.63	2.01	0.24	0.44	0.44	2.01	2.00	2.01	29
中期 (3-7)	687	99.01	99.12	4.52	0.48	0.68	0.68	4.46	4.45	4.46	37
長期 (7-)	165	94.30	94.52	10.88	0.71	1.25	1.21	10.28	10.22	10.27	42
長期 (7-11)	99	97.44	97.68	8.54	0.71	1.05	1.03	8.28	8.23	8.27	43
超長期 (11-)	66	89.60	89.79	14.39	0.71	1.58	1.50	13.56	13.46	13.54	40
食料品	1,514	98.63	98.74	5.02	0.47	0.69	0.69	4.81	4.79	4.81	34
短期 (1-3)	521	99.64	99.68	2.03	0.28	0.44	0.44	2.02	2.02	2.02	30
中期 (3-7)	683	98.93	99.03	4.50	0.41	0.65	0.65	4.44	4.43	4.44	34
長期 (7-)	310	96.27	96.51	11.19	0.89	1.23	1.21	10.48	10.41	10.46	39
長期 (7-11)	190	98.86	99.14	9.05	0.88	1.02	1.02	8.69	8.65	8.69	37
超長期 (11-)	120	92.17	92.34	14.59	0.92	1.59	1.53	13.51	13.40	13.47	43
繊維製品	275	98.76	98.87	4.63	0.48	0.69	0.69	4.44	4.42	4.44	36
短期 (1-3)	70	99.65	99.70	1.66	0.23	0.40	0.40	1.66	1.66	1.66	28
中期 (3-7)	169	99.22	99.32	4.23	0.47	0.66	0.66	4.18	4.17	4.18	37
長期 (7-)	36	94.89	95.17	12.24	1.03	1.45	1.41	11.37	11.29	11.36	51
長期 (7-11)	16	100.87	101.32	9.66	1.29	1.19	1.19	9.07	9.02	9.07	49
超長期 (11-)	20	90.10	90.26	14.30	0.83	1.69	1.61	13.43	13.33	13.41	52
パルプ・紙	369	97.61	97.73	5.09	0.45	0.83	0.81	4.83	4.81	4.83	46
短期 (1-3)	159	99.43	99.53	2.15	0.33	0.57	0.57	2.14	2.13	2.14	42
中期 (3-7)	140	98.25	98.35	5.06	0.44	0.78	0.77	4.99	4.98	4.99	43
長期 (7-)	70	92.24	92.42	11.79	0.75	1.54	1.48	11.05	10.96	11.03	62
長期 (7-11)	35	95.04	95.19	8.17	0.62	1.35	1.32	7.96	7.91	7.95	74
超長期 (11-)	35	89.44	89.65	15.41	0.88	1.74	1.65	14.33	14.21	14.30	48
化学	2,185	96.69	96.82	5.88	0.46	0.89	0.86	5.49	5.46	5.49	46
短期 (1-3)	680	99.44	99.52	2.23	0.28	0.51	0.51	2.23	2.22	2.23	35
中期 (3-7)	898	98.44	98.56	4.81	0.43	0.75	0.74	4.75	4.73	4.75	42
長期 (7-)	607	91.02	91.22	11.56	0.72	1.57	1.49	10.68	10.60	10.66	66
長期 (7-11)	334	96.17	96.34	8.22	0.64	1.17	1.15	8.00	7.95	7.99	57
超長期 (11-)	273	84.72	84.96	15.65	0.83	2.12	1.95	14.41	14.26	14.37	78
医薬品	708	96.86	96.97	6.56	0.48	0.88	0.86	6.20	6.17	6.20	41
短期 (1-3)	163	99.73	99.77	2.20	0.30	0.42	0.42	2.20	2.19	2.20	27
中期 (3-7)	180	99.44	99.49	4.41	0.49	0.63	0.62	4.36	4.35	4.36	32
長期 (7-)	365	94.30	94.47	9.58	0.56	1.22	1.18	9.05	8.99	9.04	51
長期 (7-11)	265	95.51	95.69	7.60	0.43	1.07	1.05	7.46	7.42	7.46	53
超長期 (11-)	100	91.09	91.25	14.82	0.91	1.63	1.55	13.45	13.35	13.41	48

出所:NFRG

- 東証 33 業種分類を参考に NFRG で分類

事業債 業種別・ポートフォリオ指標 (2/4) (2024年3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	305	97.47	97.60	6.38	0.55	0.92	0.90	6.06	6.03	6.06	46
短期 (1-3)	70	99.53	99.55	1.83	0.20	0.45	0.45	1.83	1.82	1.83	32
中期 (3-7)	85	98.32	98.39	4.94	0.42	0.74	0.73	4.88	4.86	4.88	40
長期 (7-)	150	96.04	96.25	9.31	0.79	1.24	1.22	8.79	8.73	8.78	56
長期 (7-11)	125	97.11	97.30	8.00	0.72	1.12	1.10	7.77	7.72	7.76	55
超長期 (11-)	25	90.68	90.96	15.86	1.13	1.91	1.82	14.27	14.14	14.21	64
ゴム製品	330	98.74	98.86	4.28	0.39	0.66	0.66	4.22	4.20	4.22	37
短期 (1-3)	70	99.52	99.60	2.13	0.26	0.49	0.49	2.12	2.12	2.12	34
中期 (3-7)	230	98.72	98.85	4.41	0.38	0.66	0.66	4.36	4.35	4.36	36
長期 (7-)	30	97.13	97.25	8.33	0.74	1.12	1.11	8.07	8.03	8.07	52
長期 (7-11)	30	97.13	97.25	8.33	0.74	1.12	1.11	8.07	8.03	8.07	52
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
ガラス・土石製品	267	97.21	97.32	5.72	0.47	0.85	0.84	5.40	5.37	5.39	44
短期 (1-3)	73	99.51	99.57	1.96	0.23	0.47	0.47	1.95	1.95	1.95	34
中期 (3-7)	117	98.28	98.39	4.50	0.39	0.75	0.75	4.45	4.43	4.45	44
長期 (7-)	77	93.43	93.59	11.11	0.81	1.39	1.34	10.36	10.28	10.35	54
長期 (7-11)	52	97.66	97.85	8.97	0.82	1.11	1.10	8.65	8.60	8.64	45
超長期 (11-)	25	84.59	84.68	15.60	0.80	2.08	1.92	14.49	14.36	14.46	74
鉄鋼	518	99.30	99.40	3.49	0.46	0.62	0.62	3.42	3.41	3.42	38
短期 (1-3)	250	99.73	99.82	1.73	0.34	0.45	0.45	1.72	1.72	1.72	32
中期 (3-7)	225	98.94	99.06	4.47	0.51	0.72	0.72	4.41	4.40	4.41	42
長期 (7-)	43	98.64	98.73	8.57	0.94	1.12	1.11	8.24	8.20	8.24	51
長期 (7-11)	43	98.64	98.73	8.57	0.94	1.12	1.11	8.24	8.20	8.24	51
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
非鉄金属	360	98.69	98.79	4.74	0.45	0.74	0.73	4.64	4.62	4.64	41
短期 (1-3)	120	99.22	99.26	2.55	0.25	0.56	0.56	2.55	2.54	2.55	38
中期 (3-7)	170	98.86	98.99	4.63	0.50	0.75	0.75	4.57	4.55	4.57	43
長期 (7-)	70	97.35	97.48	8.73	0.67	1.03	1.01	8.47	8.43	8.47	39
長期 (7-11)	70	97.35	97.48	8.73	0.67	1.03	1.01	8.47	8.43	8.47	39
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
金属製品	175	98.98	99.05	3.74	0.39	0.64	0.64	3.69	3.68	3.69	38
短期 (1-3)	60	99.50	99.54	1.89	0.22	0.47	0.47	1.88	1.88	1.88	34
中期 (3-7)	106	98.88	98.97	4.40	0.46	0.70	0.70	4.35	4.33	4.35	40
長期 (7-)	9	96.73	96.78	8.41	0.70	1.13	1.11	8.18	8.13	8.17	52
長期 (7-11)	9	96.73	96.78	8.41	0.70	1.13	1.11	8.18	8.13	8.17	52
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
機械	1,303	98.56	98.65	4.44	0.40	0.71	0.70	4.35	4.34	4.35	39
短期 (1-3)	420	99.43	99.48	2.05	0.26	0.52	0.52	2.05	2.04	2.05	38
中期 (3-7)	650	98.49	98.59	4.55	0.40	0.71	0.70	4.50	4.48	4.50	39
長期 (7-)	233	97.19	97.35	8.43	0.65	1.03	1.01	8.19	8.15	8.19	42
長期 (7-11)	233	97.19	97.35	8.43	0.65	1.03	1.01	8.19	8.15	8.19	42
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
電気機器	1,990	99.07	99.15	4.35	0.48	0.70	0.69	4.26	4.24	4.26	39
短期 (1-3)	685	99.62	99.66	2.01	0.29	0.47	0.47	2.00	2.00	2.00	33
中期 (3-7)	1,070	98.76	98.85	4.82	0.49	0.74	0.73	4.75	4.73	4.75	41
長期 (7-)	235	98.85	99.00	9.02	1.00	1.16	1.16	8.63	8.58	8.63	51
長期 (7-11)	235	98.85	99.00	9.02	1.00	1.16	1.16	8.63	8.58	8.63	51
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
輸送用機器	1,136	98.05	98.14	4.70	0.40	0.74	0.73	4.52	4.50	4.52	41
短期 (1-3)	455	99.36	99.42	2.08	0.32	0.60	0.60	2.07	2.07	2.07	46
中期 (3-7)	467	98.54	98.61	4.52	0.35	0.66	0.65	4.47	4.45	4.47	34
長期 (7-)	214	94.20	94.38	10.65	0.68	1.25	1.21	10.12	10.06	10.12	44
長期 (7-11)	124	97.51	97.73	8.68	0.69	1.02	1.01	8.42	8.37	8.41	39
超長期 (11-)	90	89.65	89.77	13.35	0.67	1.60	1.52	12.69	12.59	12.67	51

出所:NFRC

- 東証 33 業種分類を参考に NFRC で分類

事業債 業種別・ポートフォリオ指標 (2/4) (2024年3月末、4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	97.47	97.60	6.38	0.55	0.92	0.90	6.06	6.03	6.06	46
短期 (1-3)	70	99.53	99.55	1.83	0.20	0.45	0.45	1.83	1.82	1.83	32
中期 (3-7)	85	98.32	98.39	4.94	0.42	0.74	0.73	4.88	4.86	4.88	40
長期 (7-)	150	96.04	96.25	9.31	0.79	1.24	1.22	8.79	8.73	8.78	56
長期 (7-11)	125	97.11	97.30	8.00	0.72	1.12	1.10	7.77	7.72	7.76	55
超長期 (11-)	25	90.68	90.96	15.86	1.13	1.91	1.82	14.27	14.14	14.21	64
ゴム製品	330	98.74	98.86	4.28	0.39	0.66	0.66	4.22	4.20	4.22	37
短期 (1-3)	130	99.45	99.55	2.56	0.28	0.50	0.50	2.55	2.54	2.55	31
中期 (3-7)	170	98.49	98.62	4.89	0.41	0.72	0.71	4.83	4.82	4.83	38
長期 (7-)	30	97.13	97.25	8.33	0.74	1.12	1.11	8.07	8.03	8.07	52
長期 (7-11)	30	97.13	97.25	8.33	0.74	1.12	1.11	8.07	8.03	8.07	52
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
ガラス・土石製品	277	97.31	97.42	5.69	0.48	0.85	0.83	5.38	5.35	5.37	43
短期 (1-3)	73	99.51	99.57	1.96	0.23	0.47	0.47	1.95	1.95	1.95	34
中期 (3-7)	127	98.42	98.53	4.53	0.42	0.75	0.74	4.48	4.46	4.48	43
長期 (7-)	77	93.43	93.59	11.11	0.81	1.39	1.34	10.36	10.28	10.35	54
長期 (7-11)	52	97.66	97.85	8.97	0.82	1.11	1.10	8.65	8.60	8.64	45
超長期 (11-)	25	84.59	84.68	15.60	0.80	2.08	1.92	14.49	14.36	14.46	74
鉄鋼	518	99.30	99.40	3.49	0.46	0.62	0.62	3.42	3.41	3.42	38
短期 (1-3)	250	99.73	99.82	1.73	0.34	0.45	0.45	1.72	1.72	1.72	32
中期 (3-7)	225	98.94	99.06	4.47	0.51	0.72	0.72	4.41	4.40	4.41	42
長期 (7-)	43	98.64	98.73	8.57	0.94	1.12	1.11	8.24	8.20	8.24	51
長期 (7-11)	43	98.64	98.73	8.57	0.94	1.12	1.11	8.24	8.20	8.24	51
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
非鉄金属	360	98.69	98.79	4.74	0.45	0.74	0.73	4.64	4.62	4.64	41
短期 (1-3)	120	99.22	99.26	2.55	0.25	0.56	0.56	2.55	2.54	2.55	38
中期 (3-7)	170	98.86	98.99	4.63	0.50	0.75	0.75	4.57	4.55	4.57	43
長期 (7-)	70	97.35	97.48	8.73	0.67	1.03	1.01	8.47	8.43	8.47	39
長期 (7-11)	70	97.35	97.48	8.73	0.67	1.03	1.01	8.47	8.43	8.47	39
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
金属製品	175	98.98	99.05	3.74	0.39	0.64	0.64	3.69	3.68	3.69	38
短期 (1-3)	60	99.50	99.54	1.89	0.22	0.47	0.47	1.88	1.88	1.88	34
中期 (3-7)	106	98.88	98.97	4.40	0.46	0.70	0.70	4.35	4.33	4.35	40
長期 (7-)	9	96.73	96.78	8.41	0.70	1.13	1.11	8.18	8.13	8.17	52
長期 (7-11)	9	96.73	96.78	8.41	0.70	1.13	1.11	8.18	8.13	8.17	52
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
機械	1,303	98.56	98.65	4.44	0.40	0.71	0.70	4.35	4.34	4.35	39
短期 (1-3)	420	99.43	99.48	2.05	0.26	0.52	0.52	2.05	2.04	2.05	38
中期 (3-7)	650	98.49	98.59	4.55	0.40	0.71	0.70	4.50	4.48	4.50	39
長期 (7-)	233	97.19	97.35	8.43	0.65	1.03	1.01	8.19	8.15	8.19	42
長期 (7-11)	233	97.19	97.35	8.43	0.65	1.03	1.01	8.19	8.15	8.19	42
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
電気機器	1,975	99.06	99.14	4.37	0.48	0.70	0.69	4.28	4.26	4.28	39
短期 (1-3)	670	99.61	99.65	2.03	0.29	0.47	0.47	2.02	2.02	2.02	33
中期 (3-7)	1,070	98.76	98.85	4.82	0.49	0.74	0.73	4.75	4.73	4.75	41
長期 (7-)	235	98.85	99.00	9.02	1.00	1.16	1.16	8.63	8.58	8.63	51
長期 (7-11)	235	98.85	99.00	9.02	1.00	1.16	1.16	8.63	8.58	8.63	51
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
輸送用機器	1,146	98.07	98.16	4.70	0.40	0.74	0.73	4.52	4.50	4.52	41
短期 (1-3)	455	99.36	99.42	2.08	0.32	0.60	0.60	2.07	2.07	2.07	46
中期 (3-7)	477	98.57	98.65	4.53	0.36	0.66	0.65	4.48	4.46	4.48	34
長期 (7-)	214	94.20	94.38	10.65	0.68	1.25	1.21	10.12	10.06	10.12	44
長期 (7-11)	124	97.51	97.73	8.68	0.69	1.02	1.01	8.42	8.37	8.41	39
超長期 (11-)	90	89.65	89.77	13.35	0.67	1.60	1.52	12.69	12.59	12.67	51

出所:NFRC

- 東証 33 業種分類を参考に NFRC で分類

事業債 業種別・ポートフォリオ指標 (3/4) (2024年3月末)

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
精密機器	205	98.50	98.68	4.67	0.53	0.83	0.82	4.55	4.52	4.55	50
短期 (1-3)	65	99.67	99.74	1.60	0.27	0.47	0.46	1.60	1.60	1.60	35
中期 (3-7)	105	98.03	98.19	5.25	0.54	0.91	0.90	5.16	5.14	5.16	55
長期 (7-)	35	97.73	98.16	8.63	0.97	1.27	1.26	8.25	8.20	8.25	65
長期 (7-11)	35	97.73	98.16	8.63	0.97	1.27	1.26	8.25	8.20	8.25	65
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
その他製品	215	96.71	96.79	6.65	0.48	0.86	0.84	6.26	6.23	6.26	38
短期 (1-3)	50	99.47	99.54	1.83	0.32	0.58	0.58	1.82	1.82	1.82	45
中期 (3-7)	105	98.88	98.99	5.35	0.49	0.71	0.70	5.28	5.26	5.28	35
長期 (7-)	60	90.60	90.64	12.94	0.61	1.40	1.33	12.20	12.11	12.18	37
長期 (7-11)	15	97.87	97.90	7.44	0.55	0.86	0.85	7.29	7.26	7.29	34
超長期 (11-)	45	88.18	88.22	14.78	0.63	1.60	1.50	14.01	13.91	13.99	38
電気・ガス業	12,303	96.42	96.62	7.89	0.74	1.03	1.00	7.02	6.98	7.00	47
短期 (1-3)	2,529	99.86	99.97	1.89	0.43	0.48	0.47	1.88	1.87	1.88	34
中期 (3-7)	4,448	99.56	99.75	4.68	0.72	0.81	0.81	4.59	4.57	4.59	49
長期 (7-)	5,326	92.18	92.42	13.42	0.89	1.51	1.44	11.86	11.76	11.81	53
長期 (7-11)	2,527	97.69	97.95	8.46	0.82	1.14	1.13	8.15	8.10	8.15	53
超長期 (11-)	2,799	87.19	87.44	17.90	0.96	1.88	1.76	15.60	15.46	15.52	53
陸運業	6,155	93.49	93.77	13.33	0.98	1.19	1.12	10.49	10.41	10.40	35
短期 (1-3)	847	100.52	100.69	1.88	0.65	0.42	0.42	1.87	1.87	1.87	29
中期 (3-7)	1,610	102.03	102.40	5.07	1.12	0.66	0.67	4.92	4.91	4.92	33
長期 (7-)	3,698	88.16	88.43	19.54	1.00	1.65	1.53	15.55	15.41	15.38	38
長期 (7-11)	1,085	100.65	100.93	8.76	1.06	0.99	0.99	8.35	8.31	8.35	37
超長期 (11-)	2,613	82.98	83.23	24.02	0.98	1.99	1.80	19.17	18.99	18.92	38
海運業	116	99.85	99.99	4.77	0.88	0.85	0.85	4.64	4.61	4.64	52
短期 (1-3)	25	101.47	101.79	2.09	1.26	0.60	0.60	2.06	2.05	2.06	45
中期 (3-7)	71	98.85	98.93	4.69	0.56	0.82	0.81	4.63	4.61	4.63	49
長期 (7-)	20	101.37	101.51	8.38	1.52	1.27	1.27	7.88	7.83	7.88	69
長期 (7-11)	20	101.37	101.51	8.38	1.52	1.27	1.27	7.88	7.83	7.88	69
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
空運業	235	93.13	93.30	7.70	0.72	1.45	1.38	6.93	6.87	6.93	84
短期 (1-3)	90	99.52	99.64	2.38	0.65	0.86	0.86	2.36	2.35	2.36	69
中期 (3-7)	40	96.32	96.41	5.11	0.36	1.11	1.09	5.06	5.03	5.06	74
長期 (7-)	105	86.43	86.67	13.24	0.92	2.18	2.02	12.24	12.11	12.22	103
長期 (7-11)	20	98.25	98.58	9.22	1.20	1.42	1.40	8.72	8.66	8.72	74
超長期 (11-)	85	83.65	83.87	14.19	0.86	2.39	2.19	13.21	13.06	13.18	112
倉庫・運輸関連業	139	95.87	95.95	6.61	0.52	1.09	1.06	6.28	6.25	6.28	60
短期 (1-3)	17	99.89	99.99	1.59	0.40	0.48	0.48	1.59	1.58	1.59	37
中期 (3-7)	85	96.90	96.96	5.38	0.42	1.00	0.99	5.31	5.28	5.31	63
長期 (7-)	37	91.61	91.71	11.81	0.80	1.60	1.53	11.07	10.98	11.05	67
長期 (7-11)	17	96.57	96.67	8.14	0.88	1.40	1.38	7.85	7.79	7.84	81
超長期 (11-)	20	87.51	87.61	14.84	0.72	1.78	1.67	14.00	13.89	13.98	54
情報・通信業	2,170	97.34	97.50	4.65	0.78	1.24	1.21	4.33	4.30	4.33	90
短期 (1-3)	868	99.35	99.48	1.96	0.58	0.88	0.88	1.95	1.94	1.95	74
中期 (3-7)	885	98.13	98.28	4.62	0.76	1.15	1.14	4.53	4.50	4.53	83
長期 (7-)	418	91.47	91.73	10.29	1.25	2.24	2.14	9.26	9.15	9.24	141
長期 (7-11)	300	94.29	94.50	8.47	1.07	1.87	1.81	8.06	7.99	8.06	122
超長期 (11-)	118	84.27	84.67	14.91	1.73	3.32	3.06	12.66	12.47	12.59	198
卸売業	1,240	99.06	99.25	6.27	0.84	0.85	0.85	5.93	5.90	5.93	41
短期 (1-3)	195	100.29	100.43	1.79	0.69	0.53	0.53	1.78	1.78	1.78	41
中期 (3-7)	645	100.51	100.71	4.84	0.84	0.73	0.73	4.74	4.72	4.74	40
長期 (7-)	400	96.13	96.31	10.76	0.92	1.23	1.20	10.04	9.98	10.03	43
長期 (7-11)	245	99.95	100.16	8.36	0.97	0.98	0.98	8.02	7.98	8.02	40
超長期 (11-)	155	90.09	90.24	14.55	0.83	1.67	1.59	13.59	13.48	13.56	49

出所:NFRC

- 東証 33 業種分類を参考に NFRC で分類

事業債 業種別・ポートフォリオ指標 (3/4) (2024年3月末、4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	98.50	98.68	4.67	0.53	0.83	0.82	4.55	4.52	4.55	50
短期 (1-3)	75	99.61	99.68	1.80	0.26	0.47	0.47	1.79	1.79	1.79	34
中期 (3-7)	95	97.90	98.08	5.48	0.57	0.95	0.95	5.39	5.36	5.39	58
長期 (7-)	35	97.73	98.16	8.63	0.97	1.27	1.26	8.25	8.20	8.25	65
長期 (7-11)	35	97.73	98.16	8.63	0.97	1.27	1.26	8.25	8.20	8.25	65
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
その他製品	215	96.71	96.79	6.65	0.48	0.86	0.84	6.26	6.23	6.26	38
短期 (1-3)	50	99.47	99.54	1.83	0.32	0.58	0.58	1.82	1.82	1.82	45
中期 (3-7)	105	98.88	98.99	5.35	0.49	0.71	0.70	5.28	5.26	5.28	35
長期 (7-)	60	90.60	90.64	12.94	0.61	1.40	1.33	12.20	12.11	12.18	37
長期 (7-11)	15	97.87	97.90	7.44	0.55	0.86	0.85	7.29	7.26	7.29	34
超長期 (11-)	45	88.18	88.22	14.78	0.63	1.60	1.50	14.01	13.91	13.99	38
電気・ガス業	12,123	96.37	96.57	8.04	0.75	1.04	1.01	7.16	7.11	7.14	48
短期 (1-3)	2,639	99.81	99.92	2.11	0.44	0.50	0.50	2.10	2.09	2.10	35
中期 (3-7)	4,323	99.41	99.60	4.93	0.74	0.83	0.83	4.83	4.81	4.83	50
長期 (7-)	5,161	92.06	92.31	13.67	0.91	1.53	1.46	12.06	11.96	12.01	53
長期 (7-11)	2,402	97.83	98.09	8.66	0.87	1.16	1.15	8.32	8.27	8.32	54
超長期 (11-)	2,759	87.04	87.28	18.02	0.95	1.89	1.76	15.71	15.57	15.62	52
陸運業	6,180	93.52	93.79	13.30	0.98	1.19	1.12	10.47	10.39	10.38	35
短期 (1-3)	877	100.62	100.79	1.92	0.68	0.42	0.42	1.91	1.90	1.91	29
中期 (3-7)	1,660	101.78	102.14	5.18	1.08	0.67	0.67	5.03	5.01	5.03	33
長期 (7-)	3,643	88.04	88.31	19.74	1.01	1.67	1.54	15.69	15.55	15.52	38
長期 (7-11)	1,045	100.89	101.19	8.89	1.11	1.00	1.01	8.46	8.42	8.46	37
超長期 (11-)	2,598	82.87	83.13	24.10	0.98	1.99	1.81	19.23	19.05	18.98	38
海運業	116	99.85	99.99	4.77	0.88	0.85	0.85	4.64	4.61	4.64	52
短期 (1-3)	25	101.47	101.79	2.09	1.26	0.60	0.60	2.06	2.05	2.06	45
中期 (3-7)	71	98.85	98.93	4.69	0.56	0.82	0.81	4.63	4.61	4.63	49
長期 (7-)	20	101.37	101.51	8.38	1.52	1.27	1.27	7.88	7.83	7.88	69
長期 (7-11)	20	101.37	101.51	8.38	1.52	1.27	1.27	7.88	7.83	7.88	69
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
空運業	235	93.13	93.30	7.70	0.72	1.45	1.38	6.93	6.87	6.93	84
短期 (1-3)	90	99.52	99.64	2.38	0.65	0.86	0.86	2.36	2.35	2.36	69
中期 (3-7)	40	96.32	96.41	5.11	0.36	1.11	1.09	5.06	5.03	5.06	74
長期 (7-)	105	86.43	86.67	13.24	0.92	2.18	2.02	12.24	12.11	12.22	103
長期 (7-11)	20	98.25	98.58	9.22	1.20	1.42	1.40	8.72	8.66	8.72	74
超長期 (11-)	85	83.65	83.87	14.19	0.86	2.39	2.19	13.21	13.06	13.18	112
倉庫・運輸関連業	139	95.87	95.95	6.61	0.52	1.09	1.06	6.28	6.25	6.28	60
短期 (1-3)	17	99.89	99.99	1.59	0.40	0.48	0.48	1.59	1.58	1.59	37
中期 (3-7)	85	96.90	96.96	5.38	0.42	1.00	0.99	5.31	5.28	5.31	63
長期 (7-)	37	91.61	91.71	11.81	0.80	1.60	1.53	11.07	10.98	11.05	67
長期 (7-11)	17	96.57	96.67	8.14	0.88	1.40	1.38	7.85	7.79	7.84	81
超長期 (11-)	20	87.51	87.61	14.84	0.72	1.78	1.67	14.00	13.89	13.98	54
情報・通信業	2,170	97.34	97.50	4.65	0.78	1.24	1.21	4.33	4.30	4.33	90
短期 (1-3)	868	99.35	99.48	1.96	0.58	0.88	0.88	1.95	1.94	1.95	74
中期 (3-7)	885	98.13	98.28	4.62	0.76	1.15	1.14	4.53	4.50	4.53	83
長期 (7-)	418	91.47	91.73	10.29	1.25	2.24	2.14	9.26	9.15	9.24	141
長期 (7-11)	300	94.29	94.50	8.47	1.07	1.87	1.81	8.06	7.99	8.06	122
超長期 (11-)	118	84.27	84.67	14.91	1.73	3.32	3.06	12.66	12.47	12.59	198
卸売業	1,268	99.08	99.26	6.35	0.85	0.86	0.85	6.01	5.98	6.00	41
短期 (1-3)	210	100.66	100.87	1.88	0.81	0.53	0.53	1.87	1.86	1.87	40
中期 (3-7)	645	100.31	100.49	4.93	0.79	0.73	0.74	4.83	4.82	4.83	40
長期 (7-)	413	96.36	96.54	10.83	0.95	1.23	1.20	10.11	10.05	10.10	42
長期 (7-11)	258	100.12	100.32	8.60	1.01	1.00	1.00	8.24	8.20	8.23	39
超長期 (11-)	155	90.09	90.24	14.55	0.83	1.67	1.59	13.59	13.48	13.56	49

出所:NFRC

- 東証 33 業種分類を参考に NFRC で分類

事業債 業種別・ポートフォリオ指標 (4/4) (2024年3月末)

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
小売業	1,228	99.41	99.58	4.11	0.57	0.66	0.66	3.97	3.96	3.97	37
短期 (1-3)	564	99.87	99.99	1.92	0.43	0.44	0.44	1.91	1.91	1.91	30
中期 (3-7)	487	99.42	99.58	4.45	0.57	0.72	0.72	4.39	4.37	4.39	41
長期 (7-)	177	97.91	98.25	10.10	1.03	1.24	1.22	9.50	9.44	9.49	49
長期 (7-11)	137	99.75	100.12	8.91	1.07	1.14	1.14	8.49	8.44	8.48	50
超長期 (11-)	40	91.62	91.86	14.18	0.88	1.61	1.54	13.28	13.18	13.26	46
銀行業	1,519	100.84	101.18	3.43	1.19	0.88	0.89	3.34	3.32	3.33	65
短期 (1-3)	779	101.09	101.45	1.97	1.29	0.80	0.80	1.94	1.93	1.94	66
中期 (3-7)	722	100.62	100.94	4.86	1.09	0.97	0.98	4.72	4.70	4.72	65
長期 (7-)	18	98.38	98.67	8.93	0.83	1.03	1.02	8.60	8.55	8.59	38
長期 (7-11)	18	98.38	98.67	8.93	0.83	1.03	1.02	8.60	8.55	8.59	38
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
証券、商品先物取引業	1,020	99.73	99.94	2.56	0.89	0.92	0.92	2.52	2.51	2.52	74
短期 (1-3)	769	99.88	100.10	2.04	0.90	0.89	0.89	2.02	2.02	2.02	74
中期 (3-7)	247	99.36	99.56	4.06	0.85	1.02	1.02	3.99	3.97	3.99	74
長期 (7-)	5	95.01	95.07	8.43	0.90	1.57	1.53	8.13	8.06	8.12	94
長期 (7-11)	5	95.01	95.07	8.43	0.90	1.57	1.53	8.13	8.06	8.12	94
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
保険業	335	98.84	98.99	3.95	0.38	0.67	0.67	3.88	3.87	3.88	39
短期 (1-3)	155	99.10	99.17	2.59	0.19	0.55	0.54	2.58	2.58	2.58	36
中期 (3-7)	130	99.34	99.53	3.82	0.45	0.63	0.63	3.78	3.77	3.78	36
長期 (7-)	50	96.73	97.07	8.55	0.75	1.17	1.15	8.26	8.21	8.26	55
長期 (7-11)	50	96.73	97.07	8.55	0.75	1.17	1.15	8.26	8.21	8.26	55
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
その他金融業	5,933	98.77	98.87	4.01	0.41	0.69	0.69	3.92	3.90	3.92	41
短期 (1-3)	2,742	99.40	99.47	2.05	0.28	0.55	0.55	2.04	2.03	2.04	41
中期 (3-7)	2,477	98.84	98.95	4.72	0.48	0.71	0.71	4.65	4.64	4.65	39
長期 (7-)	715	96.14	96.29	9.11	0.72	1.19	1.16	8.72	8.67	8.72	51
長期 (7-11)	637	97.14	97.26	8.44	0.70	1.10	1.08	8.20	8.15	8.19	48
超長期 (11-)	78	87.99	88.34	14.62	0.96	2.00	1.88	13.46	13.34	13.43	78
不動産業	2,635	96.58	96.74	7.83	0.72	1.00	0.98	6.90	6.85	6.88	47
短期 (1-3)	471	99.78	99.89	2.02	0.45	0.53	0.52	2.01	2.00	2.01	38
中期 (3-7)	1,058	99.12	99.27	4.65	0.60	0.76	0.76	4.58	4.56	4.58	44
長期 (7-)	1,106	92.78	92.98	13.34	0.94	1.47	1.41	11.51	11.42	11.45	53
長期 (7-11)	633	98.36	98.58	8.65	0.90	1.11	1.10	8.31	8.26	8.30	49
超長期 (11-)	473	85.31	85.49	19.61	1.00	2.03	1.87	16.45	16.29	16.31	59
サービス業	799	89.88	90.04	5.10	0.58	2.26	2.00	4.53	4.47	4.53	168
短期 (1-3)	297	97.94	98.02	2.01	0.33	1.20	1.17	1.99	1.98	1.99	103
中期 (3-7)	292	96.17	96.28	4.95	0.45	1.29	1.23	4.89	4.86	4.89	89
長期 (7-)	210	69.73	70.08	9.68	1.14	6.21	5.15	8.87	8.65	8.86	446
長期 (7-11)	160	71.87	72.18	8.57	1.04	6.01	5.07	8.04	7.85	8.04	447
超長期 (11-)	50	62.89	63.33	13.25	1.45	6.91	5.45	11.88	11.58	11.84	444
財投機関債	20,548	97.86	98.01	9.57	0.77	0.81	0.79	8.16	8.11	8.11	18
短期 (1-3)	5,586	99.96	100.01	2.03	0.30	0.31	0.31	2.02	2.02	2.02	17
中期 (3-7)	6,182	100.96	101.08	4.61	0.71	0.49	0.49	4.53	4.52	4.53	17
長期 (7-)	8,780	94.34	94.57	17.87	1.11	1.39	1.34	15.01	14.90	14.89	20
長期 (7-11)	2,420	101.78	101.99	8.57	1.00	0.79	0.80	8.21	8.18	8.21	19
超長期 (11-)	6,360	91.50	91.74	21.40	1.16	1.65	1.58	17.89	17.74	17.72	20

出所:NFRC

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

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

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
小売業	1,228	99.41	99.58	4.11	0.57	0.66	0.66	3.97	3.96	3.97	37
短期 (1-3)	564	99.87	99.99	1.92	0.43	0.44	0.44	1.91	1.91	1.91	30
中期 (3-7)	487	99.42	99.58	4.45	0.57	0.72	0.72	4.39	4.37	4.39	41
長期 (7-)	177	97.91	98.25	10.10	1.03	1.24	1.22	9.50	9.44	9.49	49
長期 (7-11)	137	99.75	100.12	8.91	1.07	1.14	1.14	8.49	8.44	8.48	50
超長期 (11-)	40	91.62	91.86	14.18	0.88	1.61	1.54	13.28	13.18	13.26	46
銀行業	1,519	100.84	101.18	3.43	1.19	0.88	0.89	3.34	3.32	3.33	65
短期 (1-3)	809	101.23	101.62	2.01	1.33	0.80	0.80	1.98	1.97	1.98	66
中期 (3-7)	692	100.43	100.73	4.94	1.03	0.98	0.98	4.80	4.78	4.80	65
長期 (7-)	18	98.38	98.67	8.93	0.83	1.03	1.02	8.60	8.55	8.59	38
長期 (7-11)	18	98.38	98.67	8.93	0.83	1.03	1.02	8.60	8.55	8.59	38
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
証券、商品先物取引業	1,030	99.74	99.94	2.56	0.89	0.92	0.92	2.53	2.52	2.53	74
短期 (1-3)	779	99.88	100.09	2.05	0.90	0.88	0.88	2.04	2.03	2.04	74
中期 (3-7)	247	99.36	99.56	4.06	0.85	1.02	1.02	3.99	3.97	3.99	74
長期 (7-)	5	95.01	95.07	8.43	0.90	1.57	1.53	8.13	8.06	8.12	94
長期 (7-11)	5	95.01	95.07	8.43	0.90	1.57	1.53	8.13	8.06	8.12	94
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
保険業	335	98.84	98.99	3.95	0.38	0.67	0.67	3.88	3.87	3.88	39
短期 (1-3)	155	99.10	99.17	2.59	0.19	0.55	0.54	2.58	2.58	2.58	36
中期 (3-7)	130	99.34	99.53	3.82	0.45	0.63	0.63	3.78	3.77	3.78	36
長期 (7-)	50	96.73	97.07	8.55	0.75	1.17	1.15	8.26	8.21	8.26	55
長期 (7-11)	50	96.73	97.07	8.55	0.75	1.17	1.15	8.26	8.21	8.26	55
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
その他金融業	5,998	98.78	98.88	4.03	0.42	0.70	0.69	3.94	3.92	3.94	41
短期 (1-3)	2,802	99.40	99.47	2.08	0.28	0.56	0.55	2.08	2.07	2.08	41
中期 (3-7)	2,497	98.82	98.93	4.79	0.48	0.72	0.71	4.72	4.70	4.72	39
長期 (7-)	700	96.16	96.31	9.16	0.73	1.19	1.16	8.76	8.71	8.75	51
長期 (7-11)	622	97.18	97.31	8.47	0.70	1.10	1.08	8.22	8.18	8.22	48
超長期 (11-)	78	87.99	88.34	14.62	0.96	2.00	1.88	13.46	13.34	13.43	78
不動産業	2,625	96.56	96.72	7.90	0.72	1.01	0.98	6.97	6.92	6.95	47
短期 (1-3)	441	99.74	99.83	2.08	0.44	0.54	0.54	2.07	2.07	2.07	39
中期 (3-7)	1,078	99.12	99.28	4.67	0.60	0.77	0.76	4.60	4.58	4.60	45
長期 (7-)	1,106	92.78	92.98	13.36	0.94	1.47	1.41	11.53	11.44	11.48	53
長期 (7-11)	633	98.37	98.59	8.69	0.90	1.11	1.10	8.35	8.30	8.34	49
超長期 (11-)	473	85.31	85.49	19.61	1.00	2.03	1.87	16.45	16.29	16.31	59
サービス業	819	90.12	90.28	5.10	0.59	2.21	1.97	4.54	4.48	4.54	164
短期 (1-3)	297	97.94	98.02	2.01	0.33	1.20	1.17	1.99	1.98	1.99	103
中期 (3-7)	312	96.40	96.50	4.94	0.46	1.25	1.19	4.88	4.85	4.88	86
長期 (7-)	210	69.73	70.08	9.68	1.14	6.21	5.15	8.87	8.65	8.86	446
長期 (7-11)	160	71.87	72.18	8.57	1.04	6.01	5.07	8.04	7.85	8.04	447
超長期 (11-)	50	62.89	63.33	13.25	1.45	6.91	5.45	11.88	11.58	11.84	444
財投機関債	20,570	97.86	98.01	9.59	0.77	0.81	0.79	8.17	8.12	8.12	18
短期 (1-3)	5,626	100.00	100.05	2.07	0.32	0.32	0.32	2.07	2.06	2.07	17
中期 (3-7)	6,274	100.89	101.01	4.69	0.70	0.49	0.49	4.61	4.60	4.61	18
長期 (7-)	8,670	94.27	94.50	18.01	1.12	1.40	1.35	15.12	15.01	15.00	20
長期 (7-11)	2,310	101.90	102.11	8.66	1.02	0.80	0.81	8.28	8.25	8.28	19
超長期 (11-)	6,360	91.50	91.74	21.40	1.16	1.65	1.58	17.89	17.74	17.72	20

出所:NFRC

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

事業債 円建外債 格付別・ポートフォリオ指標(2024年3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	73,324	97.42	97.59	7.35	0.71	0.91	0.89	6.43	6.39	6.41	42
短期(1-3)	22,088	99.80	99.91	2.01	0.46	0.55	0.54	2.00	1.99	2.00	40
中期(3-7)	27,120	99.66	99.82	4.65	0.67	0.73	0.73	4.57	4.55	4.57	42
長期(7-)	24,116	92.73	92.97	15.29	0.99	1.50	1.43	13.05	12.95	12.97	43
長期(7-11)	10,377	98.45	98.67	8.53	0.89	1.11	1.09	8.20	8.16	8.20	49
超長期(11-)	13,738	88.41	88.66	20.39	1.07	1.82	1.71	17.12	16.97	16.97	39
AAA~A 格	72,342	97.41	97.58	7.40	0.71	0.91	0.89	6.47	6.43	6.44	41
短期(1-3)	21,579	99.80	99.91	2.01	0.46	0.54	0.53	2.00	1.99	2.00	39
中期(3-7)	26,759	99.68	99.84	4.65	0.67	0.72	0.72	4.57	4.55	4.57	41
長期(7-)	24,004	92.73	92.97	15.31	0.99	1.50	1.43	13.06	12.96	12.98	43
長期(7-11)	10,308	98.46	98.69	8.54	0.89	1.11	1.09	8.21	8.16	8.20	49
超長期(11-)	13,695	88.42	88.66	20.41	1.07	1.82	1.71	17.13	16.98	16.98	38
AAA~AA 格	51,167	97.32	97.48	8.20	0.70	0.85	0.83	7.03	6.99	6.99	31
短期(1-3)	14,574	99.90	99.99	2.00	0.39	0.43	0.43	1.99	1.99	1.99	29
中期(3-7)	18,109	100.07	100.23	4.67	0.66	0.63	0.63	4.59	4.57	4.59	32
長期(7-)	18,485	92.60	92.82	16.54	0.98	1.43	1.36	13.89	13.78	13.78	31
長期(7-11)	7,153	99.35	99.56	8.52	0.85	0.95	0.95	8.21	8.17	8.21	35
超長期(11-)	11,332	88.34	88.57	21.60	1.07	1.77	1.66	17.91	17.76	17.74	29
AAA 格	10,746	98.02	98.09	5.68	0.36	0.58	0.56	5.00	4.98	4.98	21
短期(1-3)	4,245	99.58	99.61	2.02	0.14	0.34	0.34	2.02	2.01	2.02	20
中期(3-7)	4,490	99.28	99.35	4.62	0.38	0.52	0.52	4.57	4.55	4.57	21
長期(7-)	2,011	91.93	92.10	15.78	0.78	1.25	1.17	12.85	12.75	12.74	25
長期(7-11)	1,204	98.38	98.52	8.39	0.62	0.84	0.84	8.17	8.13	8.17	24
超長期(11-)	807	82.32	82.51	26.81	1.02	1.96	1.77	21.18	20.98	20.88	26
AA 格	40,422	97.14	97.32	8.87	0.79	0.92	0.90	7.57	7.52	7.53	33
短期(1-3)	10,330	100.03	100.15	2.00	0.49	0.47	0.47	1.99	1.98	1.99	33
中期(3-7)	13,618	100.33	100.52	4.68	0.75	0.67	0.67	4.59	4.58	4.59	35
長期(7-)	16,474	92.68	92.91	16.63	1.01	1.45	1.39	14.01	13.90	13.91	32
長期(7-11)	5,949	99.55	99.77	8.55	0.90	0.97	0.97	8.22	8.18	8.22	37
超長期(11-)	10,525	88.80	89.04	21.20	1.07	1.76	1.65	17.68	17.53	17.52	29
A 格	21,175	97.62	97.81	5.48	0.74	1.06	1.04	5.13	5.09	5.12	66
短期(1-3)	7,005	99.60	99.74	2.02	0.59	0.75	0.75	2.01	2.00	2.00	60
中期(3-7)	8,651	98.86	99.03	4.62	0.68	0.92	0.91	4.54	4.52	4.54	60
長期(7-)	5,519	93.17	93.45	11.21	1.02	1.71	1.63	10.33	10.24	10.31	82
長期(7-11)	3,156	96.45	96.72	8.57	0.98	1.48	1.42	8.20	8.14	8.19	82
超長期(11-)	2,364	88.79	89.09	14.73	1.07	2.05	1.93	13.42	13.29	13.38	83
BBB 格	982	98.46	98.67	3.84	0.93	1.21	1.19	3.65	3.63	3.65	93
短期(1-3)	509	99.64	99.84	1.92	0.79	0.93	0.93	1.91	1.90	1.91	79
中期(3-7)	361	98.53	98.71	4.53	1.09	1.42	1.41	4.41	4.38	4.41	110
長期(7-)	112	92.89	93.16	10.36	1.03	1.80	1.74	9.56	9.47	9.54	100
長期(7-11)	69	96.00	96.24	7.84	0.92	1.50	1.48	7.54	7.49	7.54	94
超長期(11-)	43	87.85	88.17	14.44	1.21	2.34	2.20	13.12	12.98	13.09	111

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 (2024年3月末、4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	73,174	97.42	97.59	7.39	0.72	0.92	0.89	6.47	6.43	6.45	42
短期 (1-3)	22,420	99.81	99.92	2.07	0.47	0.55	0.55	2.06	2.06	2.06	40
中期 (3-7)	26,971	99.61	99.77	4.74	0.67	0.74	0.74	4.66	4.64	4.66	42
長期 (7-)	23,784	92.68	92.91	15.42	1.00	1.51	1.44	13.15	13.05	13.07	43
長期 (7-11)	10,100	98.51	98.74	8.63	0.92	1.12	1.10	8.28	8.23	8.28	49
超長期 (11-)	13,683	88.37	88.62	20.44	1.07	1.82	1.71	17.16	17.01	17.01	38
AAA～A 格	72,188	97.40	97.57	7.44	0.71	0.91	0.89	6.51	6.47	6.48	41
短期 (1-3)	21,907	99.82	99.93	2.08	0.47	0.54	0.54	2.06	2.06	2.06	39
中期 (3-7)	26,609	99.62	99.78	4.74	0.66	0.73	0.73	4.66	4.64	4.66	41
長期 (7-)	23,672	92.68	92.91	15.44	1.00	1.51	1.43	13.17	13.06	13.08	43
長期 (7-11)	10,031	98.53	98.75	8.63	0.92	1.12	1.10	8.29	8.24	8.28	49
超長期 (11-)	13,640	88.38	88.62	20.45	1.07	1.82	1.71	17.17	17.02	17.02	38
AAA～AA 格	51,399	97.33	97.49	8.21	0.70	0.85	0.83	7.04	7.00	7.01	31
短期 (1-3)	14,954	99.92	100.02	2.07	0.41	0.44	0.44	2.06	2.05	2.06	29
中期 (3-7)	18,183	99.99	100.15	4.76	0.65	0.64	0.64	4.67	4.66	4.67	32
長期 (7-)	18,263	92.55	92.77	16.67	0.99	1.44	1.37	13.99	13.88	13.88	31
長期 (7-11)	6,941	99.44	99.65	8.60	0.87	0.96	0.96	8.28	8.24	8.28	35
超長期 (11-)	11,322	88.33	88.56	21.61	1.07	1.77	1.66	17.92	17.77	17.75	29
AAA 格	10,756	98.02	98.10	5.70	0.36	0.58	0.56	5.02	5.00	5.00	21
短期 (1-3)	4,205	99.57	99.60	2.04	0.14	0.34	0.34	2.04	2.04	2.04	20
中期 (3-7)	4,620	99.25	99.32	4.67	0.38	0.53	0.53	4.62	4.60	4.62	21
長期 (7-)	1,931	91.73	91.90	16.14	0.81	1.27	1.20	13.10	13.01	12.99	25
長期 (7-11)	1,124	98.49	98.63	8.49	0.65	0.85	0.85	8.25	8.22	8.25	25
超長期 (11-)	807	82.32	82.51	26.81	1.02	1.96	1.77	21.18	20.98	20.88	26
AA 格	40,644	97.14	97.33	8.87	0.79	0.92	0.90	7.58	7.53	7.54	33
短期 (1-3)	10,750	100.06	100.18	2.08	0.51	0.48	0.48	2.07	2.06	2.07	33
中期 (3-7)	13,562	100.25	100.43	4.78	0.74	0.68	0.68	4.69	4.68	4.69	35
長期 (7-)	16,332	92.65	92.88	16.73	1.02	1.46	1.39	14.09	13.98	13.99	32
長期 (7-11)	5,817	99.62	99.84	8.63	0.92	0.98	0.98	8.29	8.25	8.28	37
超長期 (11-)	10,515	88.79	89.03	21.21	1.07	1.76	1.65	17.69	17.54	17.53	29
A 格	20,789	97.59	97.78	5.56	0.75	1.07	1.05	5.20	5.17	5.19	66
短期 (1-3)	6,953	99.58	99.73	2.09	0.60	0.76	0.76	2.08	2.07	2.08	61
中期 (3-7)	8,427	98.82	98.99	4.72	0.69	0.93	0.92	4.63	4.61	4.63	60
長期 (7-)	5,409	93.11	93.38	11.32	1.03	1.73	1.64	10.42	10.33	10.40	83
長期 (7-11)	3,091	96.48	96.75	8.69	1.01	1.49	1.44	8.30	8.24	8.29	83
超長期 (11-)	2,319	88.61	88.90	14.81	1.06	2.06	1.93	13.50	13.37	13.46	83
BBB 格	986	98.47	98.67	3.84	0.93	1.21	1.20	3.65	3.62	3.65	93
短期 (1-3)	513	99.64	99.85	1.93	0.79	0.94	0.93	1.91	1.90	1.91	80
中期 (3-7)	362	98.53	98.72	4.53	1.09	1.42	1.41	4.41	4.38	4.41	111
長期 (7-)	112	92.89	93.16	10.36	1.03	1.80	1.74	9.56	9.47	9.54	100
長期 (7-11)	69	96.00	96.24	7.84	0.92	1.50	1.48	7.54	7.49	7.54	94
超長期 (11-)	43	87.85	88.17	14.44	1.21	2.34	2.20	13.12	12.98	13.09	111

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 (2024年3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	49,803	97.26	97.42	8.32	0.70	0.85	0.82	7.13	7.08	7.09	30
短期 (1-3)	13,881	99.90	99.99	1.99	0.38	0.42	0.42	1.98	1.98	1.98	27
中期 (3-7)	17,508	100.08	100.24	4.67	0.65	0.62	0.62	4.60	4.58	4.60	30
長期 (7-)	18,414	92.58	92.80	16.57	0.98	1.43	1.36	13.91	13.80	13.81	31
長期 (7-11)	7,086	99.36	99.57	8.52	0.85	0.95	0.94	8.21	8.17	8.21	34
超長期 (11-)	11,328	88.34	88.57	21.60	1.07	1.77	1.66	17.92	17.76	17.74	29
AAA~A格	69,075	97.32	97.48	7.57	0.69	0.90	0.87	6.61	6.56	6.58	38
短期 (1-3)	20,022	99.79	99.88	1.99	0.41	0.49	0.49	1.98	1.98	1.98	35
中期 (3-7)	25,326	99.72	99.88	4.68	0.65	0.70	0.69	4.60	4.58	4.60	38
長期 (7-)	23,727	92.67	92.90	15.36	0.98	1.49	1.42	13.10	13.00	13.02	42
長期 (7-11)	10,158	98.49	98.71	8.53	0.89	1.10	1.08	8.21	8.16	8.20	48
超長期 (11-)	13,569	88.32	88.56	20.47	1.05	1.81	1.70	17.19	17.04	17.04	37
AAA~BBB格	69,672	97.33	97.49	7.54	0.69	0.90	0.87	6.58	6.54	6.55	39
短期 (1-3)	20,304	99.78	99.87	1.99	0.41	0.50	0.50	1.99	1.98	1.99	36
中期 (3-7)	25,586	99.71	99.86	4.67	0.65	0.70	0.70	4.59	4.58	4.59	39
長期 (7-)	23,782	92.67	92.90	15.35	0.98	1.49	1.42	13.10	12.99	13.01	42
長期 (7-11)	10,193	98.48	98.70	8.53	0.89	1.10	1.08	8.20	8.16	8.20	48
超長期 (11-)	13,589	88.31	88.55	20.46	1.05	1.81	1.70	17.19	17.03	17.03	37
AAA~BB格	69,672	97.33	97.49	7.54	0.69	0.90	0.87	6.58	6.54	6.55	39
短期 (1-3)	20,304	99.78	99.87	1.99	0.41	0.50	0.50	1.99	1.98	1.99	36
中期 (3-7)	25,586	99.71	99.86	4.67	0.65	0.70	0.70	4.59	4.58	4.59	39
長期 (7-)	23,782	92.67	92.90	15.35	0.98	1.49	1.42	13.10	12.99	13.01	42
長期 (7-11)	10,193	98.48	98.70	8.53	0.89	1.10	1.08	8.20	8.16	8.20	48
超長期 (11-)	13,589	88.31	88.55	20.46	1.05	1.81	1.70	17.19	17.03	17.03	37
AAA格	10,746	98.02	98.09	5.68	0.36	0.58	0.56	5.00	4.98	4.98	21
短期 (1-3)	4,245	99.58	99.61	2.02	0.14	0.34	0.34	2.02	2.01	2.02	20
中期 (3-7)	4,490	99.28	99.35	4.62	0.38	0.52	0.52	4.57	4.55	4.57	21
長期 (7-)	2,011	91.93	92.10	15.78	0.78	1.25	1.17	12.85	12.75	12.74	25
長期 (7-11)	1,204	98.38	98.52	8.39	0.62	0.84	0.84	8.17	8.13	8.17	24
超長期 (11-)	807	82.32	82.51	26.81	1.02	1.96	1.77	21.18	20.98	20.88	26
AA格	39,058	97.05	97.23	9.05	0.79	0.92	0.90	7.72	7.67	7.68	32
短期 (1-3)	9,637	100.04	100.15	1.97	0.48	0.45	0.45	1.96	1.96	1.96	31
中期 (3-7)	13,018	100.36	100.55	4.70	0.74	0.65	0.65	4.61	4.59	4.61	33
長期 (7-)	16,403	92.66	92.89	16.66	1.01	1.45	1.39	14.04	13.93	13.94	32
長期 (7-11)	5,882	99.57	99.78	8.55	0.90	0.97	0.96	8.22	8.18	8.22	36
超長期 (11-)	10,521	88.80	89.03	21.20	1.07	1.76	1.65	17.68	17.53	17.52	29
A格	19,271	97.47	97.64	5.62	0.68	1.02	1.00	5.26	5.23	5.25	61
短期 (1-3)	6,141	99.52	99.63	2.00	0.47	0.67	0.67	1.99	1.99	1.99	53
中期 (3-7)	7,817	98.91	99.07	4.68	0.65	0.87	0.87	4.60	4.58	4.60	55
長期 (7-)	5,314	92.98	93.25	11.18	0.98	1.69	1.60	10.33	10.24	10.31	80
長期 (7-11)	3,072	96.46	96.72	8.57	0.97	1.46	1.41	8.20	8.14	8.19	80
超長期 (11-)	2,242	88.22	88.49	14.77	0.99	2.02	1.89	13.52	13.39	13.48	79
BBB格	598	98.13	98.25	3.89	0.81	1.21	1.20	3.73	3.71	3.73	93
短期 (1-3)	282	99.42	99.55	2.11	0.60	0.88	0.88	2.09	2.08	2.09	73
中期 (3-7)	260	98.04	98.16	4.46	1.05	1.50	1.48	4.36	4.32	4.36	118
長期 (7-)	55	91.95	92.07	10.35	0.78	1.63	1.56	9.66	9.58	9.65	83
長期 (7-11)	35	95.36	95.46	7.64	0.69	1.36	1.33	7.44	7.39	7.44	81
超長期 (11-)	20	85.99	86.15	15.08	0.93	2.16	2.01	13.97	13.83	13.93	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 (2024年3月末、4月ポートフォリオ)

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
AAA~AA 格	50,035	97.27	97.43	8.33	0.70	0.85	0.82	7.14	7.10	7.10	30
短期 (1-3)	14,261	99.93	100.02	2.06	0.39	0.42	0.42	2.05	2.04	2.05	28
中期 (3-7)	17,582	100.01	100.16	4.77	0.64	0.63	0.63	4.69	4.67	4.69	30
長期 (7-)	18,192	92.53	92.75	16.70	0.99	1.44	1.37	14.01	13.90	13.91	31
長期 (7-11)	6,874	99.45	99.66	8.60	0.87	0.95	0.95	8.28	8.24	8.28	34
超長期 (11-)	11,318	88.33	88.56	21.61	1.07	1.77	1.66	17.93	17.77	17.75	29
AAA~A 格	68,945	97.31	97.48	7.61	0.70	0.90	0.87	6.65	6.60	6.62	38
短期 (1-3)	20,322	99.80	99.90	2.06	0.42	0.50	0.50	2.05	2.05	2.05	35
中期 (3-7)	25,228	99.66	99.82	4.77	0.65	0.70	0.70	4.69	4.67	4.69	38
長期 (7-)	23,395	92.61	92.85	15.49	0.99	1.50	1.43	13.21	13.11	13.12	42
長期 (7-11)	9,881	98.55	98.78	8.63	0.91	1.11	1.09	8.29	8.24	8.28	48
超長期 (11-)	13,514	88.28	88.51	20.51	1.05	1.81	1.70	17.23	17.07	17.07	37
AAA~BBB 格	69,547	97.32	97.48	7.58	0.70	0.90	0.88	6.62	6.58	6.59	39
短期 (1-3)	20,608	99.80	99.89	2.06	0.42	0.51	0.51	2.05	2.05	2.05	36
中期 (3-7)	25,489	99.65	99.80	4.77	0.65	0.71	0.71	4.68	4.67	4.68	39
長期 (7-)	23,450	92.61	92.85	15.48	0.99	1.50	1.43	13.20	13.10	13.12	42
長期 (7-11)	9,916	98.54	98.76	8.63	0.91	1.11	1.09	8.28	8.24	8.28	48
超長期 (11-)	13,534	88.27	88.51	20.51	1.05	1.81	1.70	17.22	17.07	17.07	37
AAA~BB 格	69,547	97.32	97.48	7.58	0.70	0.90	0.88	6.62	6.58	6.59	39
短期 (1-3)	20,608	99.80	99.89	2.06	0.42	0.51	0.51	2.05	2.05	2.05	36
中期 (3-7)	25,489	99.65	99.80	4.77	0.65	0.71	0.71	4.68	4.67	4.68	39
長期 (7-)	23,450	92.61	92.85	15.48	0.99	1.50	1.43	13.20	13.10	13.12	42
長期 (7-11)	9,916	98.54	98.76	8.63	0.91	1.11	1.09	8.28	8.24	8.28	48
超長期 (11-)	13,534	88.27	88.51	20.51	1.05	1.81	1.70	17.22	17.07	17.07	37
AAA 格	10,756	98.02	98.10	5.70	0.36	0.58	0.56	5.02	5.00	5.00	21
短期 (1-3)	4,205	99.57	99.60	2.04	0.14	0.34	0.34	2.04	2.04	2.04	20
中期 (3-7)	4,620	99.25	99.32	4.67	0.38	0.53	0.53	4.62	4.60	4.62	21
長期 (7-)	1,931	91.73	91.90	16.14	0.81	1.27	1.20	13.10	13.01	12.99	25
長期 (7-11)	1,124	98.49	98.63	8.49	0.65	0.85	0.85	8.25	8.22	8.25	25
超長期 (11-)	807	82.32	82.51	26.81	1.02	1.96	1.77	21.18	20.98	20.88	26
AA 格	39,280	97.06	97.24	9.05	0.79	0.92	0.90	7.73	7.68	7.69	32
短期 (1-3)	10,057	100.08	100.19	2.06	0.50	0.46	0.46	2.05	2.05	2.05	31
中期 (3-7)	12,962	100.28	100.46	4.80	0.73	0.66	0.66	4.71	4.69	4.71	34
長期 (7-)	16,261	92.62	92.86	16.76	1.01	1.46	1.39	14.12	14.01	14.01	32
長期 (7-11)	5,750	99.64	99.86	8.62	0.91	0.97	0.97	8.29	8.25	8.28	36
超長期 (11-)	10,511	88.79	89.02	21.21	1.07	1.76	1.65	17.70	17.54	17.53	29
A 格	18,909	97.43	97.61	5.70	0.69	1.03	1.01	5.34	5.30	5.33	61
短期 (1-3)	6,061	99.51	99.62	2.08	0.48	0.69	0.68	2.06	2.06	2.06	54
中期 (3-7)	7,645	98.87	99.02	4.78	0.66	0.88	0.88	4.69	4.67	4.69	55
長期 (7-)	5,204	92.91	93.18	11.29	0.99	1.70	1.61	10.42	10.34	10.41	80
長期 (7-11)	3,007	96.49	96.76	8.69	1.00	1.48	1.43	8.30	8.24	8.30	81
超長期 (11-)	2,197	88.02	88.28	14.86	0.98	2.03	1.89	13.61	13.48	13.57	79
BBB 格	602	98.15	98.27	3.89	0.82	1.22	1.20	3.73	3.70	3.73	94
短期 (1-3)	286	99.42	99.55	2.12	0.61	0.89	0.88	2.10	2.09	2.10	74
中期 (3-7)	261	98.05	98.17	4.46	1.06	1.50	1.49	4.36	4.33	4.36	118
長期 (7-)	55	91.95	92.07	10.35	0.78	1.63	1.56	9.66	9.58	9.65	83
長期 (7-11)	35	95.36	95.46	7.64	0.69	1.36	1.33	7.44	7.39	7.44	81
超長期 (11-)	20	85.99	86.15	15.08	0.93	2.16	2.01	13.97	13.83	13.93	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 (2024年3月末)

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
AAA~AA格	10,498	96.77	96.95	7.45	0.61	0.82	0.80	6.27	6.23	6.24	34
短期(1-3)	3,150	99.98	100.11	1.95	0.46	0.45	0.45	1.94	1.93	1.94	32
中期(3-7)	4,377	99.52	99.69	4.61	0.57	0.67	0.67	4.54	4.52	4.54	36
長期(7-)	2,971	89.31	89.57	17.46	0.84	1.50	1.40	14.25	14.13	14.12	35
長期(7-11)	1,210	97.94	98.15	8.58	0.72	0.99	0.98	8.31	8.27	8.30	38
超長期(11-)	1,760	83.38	83.66	23.56	0.93	1.91	1.74	19.04	18.86	18.81	33
AAA~A格	66,418	97.30	97.46	7.62	0.69	0.89	0.87	6.64	6.60	6.61	38
短期(1-3)	19,287	99.80	99.89	2.00	0.40	0.49	0.49	1.99	1.98	1.99	35
中期(3-7)	24,061	99.71	99.86	4.67	0.64	0.68	0.68	4.59	4.57	4.59	36
長期(7-)	23,070	92.69	92.93	15.40	0.98	1.48	1.41	13.13	13.02	13.04	42
長期(7-11)	9,836	98.53	98.75	8.53	0.89	1.09	1.08	8.20	8.16	8.20	47
超長期(11-)	13,233	88.36	88.59	20.51	1.05	1.81	1.69	17.21	17.06	17.06	37
AAA~BBB格	69,432	97.31	97.47	7.54	0.69	0.89	0.87	6.58	6.54	6.56	38
短期(1-3)	20,304	99.78	99.87	1.99	0.41	0.50	0.50	1.99	1.98	1.99	36
中期(3-7)	25,371	99.68	99.84	4.67	0.64	0.70	0.69	4.59	4.58	4.59	38
長期(7-)	23,757	92.67	92.90	15.35	0.98	1.49	1.42	13.10	12.99	13.01	42
長期(7-11)	10,193	98.48	98.70	8.53	0.89	1.10	1.08	8.20	8.16	8.20	48
超長期(11-)	13,564	88.30	88.54	20.47	1.05	1.81	1.70	17.19	17.04	17.04	37
AAA~BB格	69,672	97.33	97.49	7.54	0.69	0.90	0.87	6.58	6.54	6.55	39
短期(1-3)	20,304	99.78	99.87	1.99	0.41	0.50	0.50	1.99	1.98	1.99	36
中期(3-7)	25,586	99.71	99.86	4.67	0.65	0.70	0.70	4.59	4.58	4.59	39
長期(7-)	23,782	92.67	92.90	15.35	0.98	1.49	1.42	13.10	12.99	13.01	42
長期(7-11)	10,193	98.48	98.70	8.53	0.89	1.10	1.08	8.20	8.16	8.20	48
超長期(11-)	13,589	88.31	88.55	20.46	1.05	1.81	1.70	17.19	17.03	17.03	37
AAA格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA格	10,498	96.77	96.95	7.45	0.61	0.82	0.80	6.27	6.23	6.24	34
短期(1-3)	3,150	99.98	100.11	1.95	0.46	0.45	0.45	1.94	1.93	1.94	32
中期(3-7)	4,377	99.52	99.69	4.61	0.57	0.67	0.67	4.54	4.52	4.54	36
長期(7-)	2,971	89.31	89.57	17.46	0.84	1.50	1.40	14.25	14.13	14.12	35
長期(7-11)	1,210	97.94	98.15	8.58	0.72	0.99	0.98	8.31	8.27	8.30	38
超長期(11-)	1,760	83.38	83.66	23.56	0.93	1.91	1.74	19.04	18.86	18.81	33
A格	55,920	97.40	97.56	7.65	0.70	0.90	0.88	6.71	6.67	6.68	38
短期(1-3)	16,137	99.76	99.85	2.01	0.39	0.49	0.49	2.00	1.99	2.00	35
中期(3-7)	19,684	99.75	99.90	4.68	0.65	0.69	0.68	4.60	4.59	4.60	37
長期(7-)	20,099	93.19	93.42	15.10	1.00	1.48	1.42	12.97	12.87	12.89	42
長期(7-11)	8,626	98.61	98.84	8.52	0.91	1.11	1.09	8.19	8.14	8.18	49
超長期(11-)	11,473	89.12	89.35	20.05	1.07	1.79	1.69	16.95	16.80	16.80	37
BBB格	3,014	97.57	97.72	5.78	0.70	1.00	0.97	5.30	5.26	5.29	59
短期(1-3)	1,017	99.44	99.54	1.98	0.53	0.73	0.73	1.97	1.96	1.97	59
中期(3-7)	1,310	99.17	99.32	4.70	0.73	0.92	0.92	4.62	4.60	4.62	60
長期(7-)	688	91.75	91.96	13.47	0.89	1.57	1.49	12.01	11.92	11.97	56
長期(7-11)	357	96.99	97.20	8.57	0.83	1.25	1.22	8.27	8.22	8.27	61
超長期(11-)	331	86.10	86.31	18.75	0.95	1.96	1.82	16.56	16.40	16.46	50
BB格	240	101.78	102.19	6.17	2.26	1.79	1.81	5.59	5.54	5.58	139
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	215	102.49	102.85	5.00	2.25	1.69	1.71	4.74	4.70	4.74	138
長期(7-)	25	95.70	96.49	16.16	2.37	2.75	2.70	13.35	13.17	13.26	151
長期(7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期(11-)	25	95.70	96.49	16.16	2.37	2.75	2.70	13.35	13.17	13.26	151
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 (2024年3月末、4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	10,588	96.79	96.97	7.44	0.61	0.82	0.80	6.28	6.24	6.24	34
短期 (1-3)	3,245	99.95	100.07	1.99	0.45	0.46	0.46	1.98	1.98	1.98	31
中期 (3-7)	4,404	99.48	99.64	4.68	0.57	0.68	0.68	4.61	4.59	4.61	36
長期 (7-)	2,939	89.27	89.53	17.60	0.85	1.51	1.41	14.36	14.24	14.23	35
長期 (7-11)	1,178	98.07	98.29	8.69	0.74	1.00	0.99	8.40	8.36	8.40	37
超長期 (11-)	1,760	83.38	83.66	23.56	0.93	1.91	1.74	19.04	18.86	18.81	33
AAA~A 格	66,288	97.29	97.45	7.66	0.69	0.89	0.87	6.68	6.64	6.66	38
短期 (1-3)	19,597	99.82	99.91	2.07	0.41	0.49	0.49	2.06	2.05	2.06	35
中期 (3-7)	23,948	99.65	99.80	4.77	0.63	0.69	0.69	4.69	4.67	4.69	37
長期 (7-)	22,743	92.63	92.87	15.54	0.99	1.49	1.42	13.23	13.13	13.15	42
長期 (7-11)	9,564	98.59	98.82	8.62	0.91	1.11	1.09	8.28	8.24	8.28	48
超長期 (11-)	13,178	88.31	88.55	20.56	1.05	1.81	1.69	17.25	17.09	17.09	37
AAA~BBB 格	69,307	97.30	97.47	7.58	0.69	0.90	0.87	6.62	6.58	6.60	39
短期 (1-3)	20,608	99.80	99.89	2.06	0.42	0.51	0.51	2.05	2.05	2.05	36
中期 (3-7)	25,274	99.62	99.77	4.76	0.64	0.70	0.70	4.68	4.67	4.68	38
長期 (7-)	23,425	92.61	92.84	15.48	0.99	1.50	1.43	13.20	13.10	13.12	42
長期 (7-11)	9,916	98.54	98.76	8.63	0.91	1.11	1.09	8.28	8.24	8.28	48
超長期 (11-)	13,509	88.26	88.50	20.51	1.05	1.81	1.70	17.23	17.08	17.08	37
AAA~BB 格	69,547	97.32	97.48	7.58	0.70	0.90	0.88	6.62	6.58	6.59	39
短期 (1-3)	20,608	99.80	99.89	2.06	0.42	0.51	0.51	2.05	2.05	2.05	36
中期 (3-7)	25,489	99.65	99.80	4.77	0.65	0.71	0.71	4.68	4.67	4.68	39
長期 (7-)	23,450	92.61	92.85	15.48	0.99	1.50	1.43	13.20	13.10	13.12	42
長期 (7-11)	9,916	98.54	98.76	8.63	0.91	1.11	1.09	8.28	8.24	8.28	48
超長期 (11-)	13,534	88.27	88.51	20.51	1.05	1.81	1.70	17.22	17.07	17.07	37
AAA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA 格	10,588	96.79	96.97	7.44	0.61	0.82	0.80	6.28	6.24	6.24	34
短期 (1-3)	3,245	99.95	100.07	1.99	0.45	0.46	0.46	1.98	1.98	1.98	31
中期 (3-7)	4,404	99.48	99.64	4.68	0.57	0.68	0.68	4.61	4.59	4.61	36
長期 (7-)	2,939	89.27	89.53	17.60	0.85	1.51	1.41	14.36	14.24	14.23	35
長期 (7-11)	1,178	98.07	98.29	8.69	0.74	1.00	0.99	8.40	8.36	8.40	37
超長期 (11-)	1,760	83.38	83.66	23.56	0.93	1.91	1.74	19.04	18.86	18.81	33
A 格	55,700	97.39	97.55	7.71	0.71	0.91	0.88	6.76	6.72	6.73	38
短期 (1-3)	16,352	99.79	99.88	2.08	0.41	0.50	0.50	2.07	2.07	2.07	35
中期 (3-7)	19,544	99.69	99.84	4.78	0.65	0.69	0.69	4.70	4.69	4.70	37
長期 (7-)	19,804	93.13	93.36	15.23	1.01	1.49	1.42	13.07	12.97	12.99	43
長期 (7-11)	8,386	98.66	98.89	8.61	0.93	1.12	1.10	8.26	8.22	8.26	49
超長期 (11-)	11,418	89.07	89.30	20.10	1.07	1.79	1.69	16.99	16.84	16.84	37
BBB 格	3,019	97.57	97.72	5.81	0.70	1.00	0.98	5.32	5.29	5.31	59
短期 (1-3)	1,011	99.43	99.54	1.99	0.54	0.74	0.73	1.98	1.97	1.98	59
中期 (3-7)	1,326	99.13	99.28	4.73	0.72	0.92	0.92	4.65	4.63	4.65	60
長期 (7-)	683	91.77	91.99	13.56	0.90	1.58	1.50	12.09	11.99	12.04	56
長期 (7-11)	352	97.11	97.33	8.67	0.86	1.26	1.23	8.36	8.31	8.35	61
超長期 (11-)	331	86.10	86.31	18.75	0.95	1.96	1.82	16.56	16.40	16.46	50
BB 格	240	101.78	102.19	6.17	2.26	1.79	1.81	5.59	5.54	5.58	139
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	215	102.49	102.85	5.00	2.25	1.69	1.71	4.74	4.70	4.74	138
長期 (7-)	25	95.70	96.49	16.16	2.37	2.75	2.70	13.35	13.17	13.26	151
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	25	95.70	96.49	16.16	2.37	2.75	2.70	13.35	13.17	13.26	151
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 (2024年3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	37,994	97.29	97.45	8.99	0.74	0.84	0.82	7.57	7.52	7.53	26
短期 (1-3)	10,393	99.95	100.03	2.02	0.36	0.38	0.38	2.01	2.00	2.01	24
中期 (3-7)	12,774	100.55	100.72	4.67	0.71	0.58	0.58	4.58	4.57	4.58	27
長期 (7-)	14,827	92.61	92.84	17.61	1.04	1.44	1.37	14.57	14.45	14.45	27
長期 (7-11)	5,147	100.33	100.54	8.65	0.93	0.90	0.90	8.30	8.26	8.30	29
超長期 (11-)	9,680	88.50	88.74	22.38	1.10	1.76	1.65	18.34	18.18	18.15	26
AAA~A 格	63,052	97.33	97.50	7.79	0.70	0.88	0.86	6.76	6.72	6.73	36
短期 (1-3)	18,095	99.83	99.92	1.99	0.39	0.46	0.46	1.99	1.98	1.99	32
中期 (3-7)	22,610	99.88	100.04	4.66	0.67	0.68	0.68	4.58	4.57	4.58	36
長期 (7-)	22,346	92.73	92.96	15.64	0.98	1.46	1.40	13.29	13.18	13.20	39
長期 (7-11)	9,287	98.84	99.06	8.53	0.87	1.03	1.03	8.21	8.17	8.21	42
超長期 (11-)	13,059	88.38	88.62	20.69	1.06	1.80	1.69	17.32	17.17	17.16	36
AAA~BBB 格	63,661	97.33	97.50	7.75	0.70	0.88	0.86	6.73	6.69	6.70	36
短期 (1-3)	18,381	99.82	99.91	2.00	0.40	0.47	0.47	1.99	1.98	1.99	33
中期 (3-7)	22,853	99.86	100.02	4.66	0.67	0.69	0.69	4.58	4.57	4.58	37
長期 (7-)	22,427	92.72	92.95	15.62	0.98	1.46	1.40	13.27	13.17	13.18	39
長期 (7-11)	9,348	98.78	99.00	8.52	0.87	1.04	1.03	8.20	8.16	8.20	43
超長期 (11-)	13,079	88.38	88.62	20.69	1.06	1.80	1.69	17.32	17.16	17.16	36
AAA~BB 格	63,661	97.33	97.50	7.75	0.70	0.88	0.86	6.73	6.69	6.70	36
短期 (1-3)	18,381	99.82	99.91	2.00	0.40	0.47	0.47	1.99	1.98	1.99	33
中期 (3-7)	22,853	99.86	100.02	4.66	0.67	0.69	0.69	4.58	4.57	4.58	37
長期 (7-)	22,427	92.72	92.95	15.62	0.98	1.46	1.40	13.27	13.17	13.18	39
長期 (7-11)	9,348	98.78	99.00	8.52	0.87	1.04	1.03	8.20	8.16	8.20	43
超長期 (11-)	13,079	88.38	88.62	20.69	1.06	1.80	1.69	17.32	17.16	17.16	36
AAA 格	895	98.76	98.86	3.98	0.28	0.54	0.54	3.89	3.88	3.89	26
短期 (1-3)	380	99.53	99.59	2.00	0.16	0.40	0.40	1.99	1.99	1.99	25
中期 (3-7)	415	98.87	98.97	4.35	0.32	0.56	0.55	4.31	4.30	4.31	26
長期 (7-)	100	95.41	95.60	9.98	0.57	1.04	1.02	9.64	9.59	9.63	29
長期 (7-11)	70	97.51	97.71	8.89	0.62	0.93	0.92	8.64	8.60	8.64	28
超長期 (11-)	30	90.52	90.66	12.51	0.45	1.33	1.27	12.14	12.06	12.13	32
AA 格	37,099	97.25	97.42	9.11	0.76	0.85	0.83	7.66	7.61	7.62	26
短期 (1-3)	10,013	99.97	100.05	2.02	0.37	0.38	0.38	2.01	2.01	2.01	24
中期 (3-7)	12,359	100.61	100.78	4.68	0.72	0.58	0.58	4.59	4.58	4.59	27
長期 (7-)	14,727	92.59	92.82	17.66	1.05	1.44	1.37	14.60	14.49	14.48	27
長期 (7-11)	5,077	100.36	100.58	8.64	0.94	0.90	0.90	8.29	8.26	8.29	29
超長期 (11-)	9,650	88.50	88.74	22.41	1.10	1.76	1.65	18.36	18.20	18.17	26
A 格	25,057	97.41	97.56	5.96	0.63	0.94	0.92	5.53	5.50	5.52	51
短期 (1-3)	7,702	99.67	99.77	1.96	0.43	0.57	0.57	1.95	1.95	1.95	43
中期 (3-7)	9,836	99.02	99.17	4.66	0.61	0.81	0.81	4.58	4.56	4.58	49
長期 (7-)	7,520	92.97	93.20	11.75	0.86	1.51	1.45	10.77	10.69	10.75	62
長期 (7-11)	4,140	96.99	97.21	8.39	0.79	1.20	1.19	8.09	8.04	8.09	60
超長期 (11-)	3,380	88.04	88.29	15.88	0.95	1.92	1.80	14.38	14.25	14.33	64
BBB 格	609	97.17	97.32	4.05	0.71	1.31	1.28	3.88	3.85	3.87	100
短期 (1-3)	286	98.69	98.84	2.13	0.63	1.16	1.15	2.10	2.09	2.10	100
中期 (3-7)	243	98.02	98.19	4.51	0.79	1.23	1.21	4.43	4.40	4.43	90
長期 (7-)	81	89.24	89.37	9.46	0.74	2.15	1.99	8.97	8.88	8.96	132
長期 (7-11)	61	90.31	90.42	7.61	0.67	2.15	1.98	7.41	7.33	7.40	146
超長期 (11-)	20	85.99	86.15	15.08	0.93	2.16	2.01	13.97	13.83	13.93	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	6,011	97.25	97.41	5.26	0.63	1.05	1.00	4.97	4.94	4.97	64
短期 (1-3)	1,924	99.45	99.57	1.98	0.52	0.76	0.75	1.97	1.96	1.97	61
中期 (3-7)	2,733	98.37	98.50	4.77	0.52	0.86	0.85	4.70	4.68	4.70	52
長期 (7-)	1,355	91.88	92.15	10.92	1.00	1.89	1.73	10.17	10.09	10.16	94
長期 (7-11)	845	95.06	95.36	8.61	1.09	1.80	1.66	8.19	8.13	8.19	105
超長期 (11-)	510	86.60	86.83	14.76	0.85	2.05	1.86	13.78	13.66	13.75	74

出所:NFRC

- 格付は、R&Iの格付をもとに NFRC で分類

事業債 R&I 格付別・ポートフォリオ指標 (2024年3月末、4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	37,999	97.29	97.45	9.02	0.75	0.85	0.82	7.60	7.55	7.55	26
短期 (1-3)	10,528	99.99	100.08	2.07	0.38	0.39	0.39	2.06	2.06	2.06	24
中期 (3-7)	12,796	100.48	100.64	4.75	0.70	0.59	0.59	4.66	4.65	4.66	27
長期 (7-)	14,675	92.56	92.79	17.73	1.05	1.45	1.38	14.66	14.54	14.54	27
長期 (7-11)	5,010	100.41	100.63	8.73	0.95	0.91	0.91	8.37	8.33	8.37	29
超長期 (11-)	9,665	88.48	88.72	22.39	1.10	1.76	1.65	18.36	18.20	18.16	26
AAA~A 格	62,997	97.33	97.49	7.82	0.70	0.88	0.86	6.80	6.75	6.77	36
短期 (1-3)	18,415	99.85	99.94	2.06	0.40	0.47	0.47	2.05	2.05	2.05	32
中期 (3-7)	22,557	99.82	99.98	4.76	0.66	0.69	0.69	4.68	4.66	4.68	36
長期 (7-)	22,024	92.67	92.90	15.78	0.99	1.47	1.41	13.40	13.29	13.31	39
長期 (7-11)	9,020	98.92	99.14	8.63	0.89	1.04	1.04	8.29	8.25	8.29	43
超長期 (11-)	13,004	88.34	88.58	20.74	1.06	1.80	1.69	17.36	17.21	17.20	36
AAA~BBB 格	63,611	97.33	97.49	7.79	0.70	0.89	0.86	6.77	6.73	6.74	37
短期 (1-3)	18,704	99.83	99.93	2.06	0.41	0.48	0.48	2.05	2.05	2.05	33
中期 (3-7)	22,801	99.80	99.96	4.76	0.67	0.69	0.69	4.68	4.66	4.68	37
長期 (7-)	22,105	92.66	92.89	15.76	0.99	1.47	1.41	13.38	13.28	13.29	39
長期 (7-11)	9,081	98.86	99.08	8.63	0.89	1.05	1.04	8.29	8.25	8.29	43
超長期 (11-)	13,024	88.34	88.58	20.73	1.06	1.81	1.69	17.35	17.20	17.20	36
AAA~BB 格	63,611	97.33	97.49	7.79	0.70	0.89	0.86	6.77	6.73	6.74	37
短期 (1-3)	18,704	99.83	99.93	2.06	0.41	0.48	0.48	2.05	2.05	2.05	33
中期 (3-7)	22,801	99.80	99.96	4.76	0.67	0.69	0.69	4.68	4.66	4.68	37
長期 (7-)	22,105	92.66	92.89	15.76	0.99	1.47	1.41	13.38	13.28	13.29	39
長期 (7-11)	9,081	98.86	99.08	8.63	0.89	1.05	1.04	8.29	8.25	8.29	43
超長期 (11-)	13,024	88.34	88.58	20.73	1.06	1.81	1.69	17.35	17.20	17.20	36
AAA 格	895	98.76	98.86	3.98	0.28	0.54	0.54	3.89	3.88	3.89	26
短期 (1-3)	380	99.53	99.59	2.00	0.16	0.40	0.40	1.99	1.99	1.99	25
中期 (3-7)	415	98.87	98.97	4.35	0.32	0.56	0.55	4.31	4.30	4.31	26
長期 (7-)	100	95.41	95.60	9.98	0.57	1.04	1.02	9.64	9.59	9.63	29
長期 (7-11)	70	97.51	97.71	8.89	0.62	0.93	0.92	8.64	8.60	8.64	28
超長期 (11-)	30	90.52	90.66	12.51	0.45	1.33	1.27	12.14	12.06	12.13	32
AA 格	37,104	97.25	97.42	9.14	0.76	0.85	0.83	7.69	7.64	7.64	26
短期 (1-3)	10,148	100.01	100.10	2.07	0.39	0.39	0.39	2.06	2.06	2.06	24
中期 (3-7)	12,381	100.54	100.70	4.76	0.71	0.59	0.59	4.67	4.66	4.67	27
長期 (7-)	14,575	92.54	92.77	17.78	1.05	1.45	1.38	14.69	14.58	14.57	27
長期 (7-11)	4,940	100.45	100.67	8.73	0.96	0.91	0.91	8.37	8.33	8.36	29
超長期 (11-)	9,635	88.48	88.72	22.42	1.10	1.76	1.66	18.38	18.22	18.18	26
A 格	24,997	97.40	97.55	6.01	0.64	0.94	0.92	5.58	5.55	5.57	51
短期 (1-3)	7,887	99.66	99.76	2.05	0.43	0.57	0.57	2.04	2.03	2.04	43
中期 (3-7)	9,761	98.95	99.10	4.78	0.62	0.82	0.82	4.70	4.68	4.70	50
長期 (7-)	7,350	92.91	93.14	11.89	0.88	1.52	1.46	10.89	10.80	10.86	62
長期 (7-11)	4,010	97.06	97.28	8.51	0.82	1.22	1.20	8.20	8.15	8.20	60
超長期 (11-)	3,340	87.93	88.17	15.96	0.94	1.92	1.81	14.45	14.32	14.40	64
BBB 格	614	97.19	97.34	4.05	0.72	1.31	1.28	3.87	3.84	3.87	100
短期 (1-3)	289	98.71	98.86	2.14	0.64	1.17	1.15	2.11	2.10	2.11	100
中期 (3-7)	244	98.03	98.20	4.52	0.80	1.23	1.21	4.43	4.40	4.43	91
長期 (7-)	81	89.24	89.37	9.46	0.74	2.15	1.99	8.97	8.88	8.96	132
長期 (7-11)	61	90.31	90.42	7.61	0.67	2.15	1.98	7.41	7.33	7.40	146
超長期 (11-)	20	85.99	86.15	15.08	0.93	2.16	2.01	13.97	13.83	13.93	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	5,936	97.22	97.38	5.33	0.64	1.05	1.01	5.04	5.01	5.03	65
短期 (1-3)	1,904	99.45	99.58	2.07	0.55	0.78	0.77	2.05	2.05	2.05	63
中期 (3-7)	2,688	98.34	98.47	4.83	0.52	0.86	0.85	4.75	4.73	4.75	52
長期 (7-)	1,345	91.83	92.10	10.95	1.00	1.89	1.74	10.20	10.11	10.19	95
長期 (7-11)	835	95.02	95.32	8.62	1.09	1.81	1.67	8.21	8.14	8.21	106
超長期 (11-)	510	86.60	86.83	14.76	0.85	2.05	1.86	13.78	13.66	13.75	74

出所:NFRC

- 格付は、R&Iの格付をもとに NFRC で分類

事業債 JCR 格付別・ポートフォリオ指標 (2024年3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	28,587	97.63	97.76	6.08	0.52	0.75	0.74	5.49	5.46	5.47	34
短期 (1-3)	9,572	99.76	99.84	1.97	0.33	0.44	0.44	1.96	1.96	1.96	30
中期 (3-7)	11,442	99.24	99.36	4.64	0.50	0.65	0.65	4.58	4.56	4.58	33
長期 (7-)	7,574	92.52	92.71	13.44	0.78	1.35	1.29	11.76	11.67	11.70	40
長期 (7-11)	4,203	97.64	97.81	8.36	0.67	1.00	0.98	8.12	8.08	8.12	40
超長期 (11-)	3,371	86.14	86.34	19.78	0.91	1.85	1.71	16.90	16.75	16.77	41
AAA~A 格	40,713	97.45	97.59	5.98	0.58	0.86	0.84	5.45	5.42	5.44	44
短期 (1-3)	13,339	99.67	99.76	1.98	0.37	0.51	0.51	1.98	1.97	1.98	37
中期 (3-7)	16,140	99.15	99.29	4.65	0.56	0.73	0.73	4.58	4.56	4.58	41
長期 (7-)	11,234	92.38	92.59	12.64	0.84	1.50	1.43	11.24	11.15	11.20	57
長期 (7-11)	6,299	96.72	96.93	8.41	0.76	1.20	1.17	8.12	8.08	8.12	58
超長期 (11-)	4,935	86.83	87.06	18.04	0.95	1.93	1.79	15.67	15.53	15.57	56
AAA~BBB 格	41,089	97.46	97.60	5.96	0.58	0.86	0.84	5.44	5.41	5.43	45
短期 (1-3)	13,500	99.67	99.75	1.98	0.37	0.52	0.51	1.98	1.97	1.98	37
中期 (3-7)	16,316	99.14	99.28	4.65	0.57	0.74	0.74	4.58	4.56	4.58	42
長期 (7-)	11,274	92.37	92.59	12.63	0.84	1.50	1.43	11.24	11.15	11.20	57
長期 (7-11)	6,319	96.72	96.92	8.41	0.76	1.20	1.17	8.12	8.08	8.12	58
超長期 (11-)	4,955	86.83	87.06	18.03	0.95	1.93	1.79	15.66	15.52	15.57	56
AAA~BB 格	41,089	97.46	97.60	5.96	0.58	0.86	0.84	5.44	5.41	5.43	45
短期 (1-3)	13,500	99.67	99.75	1.98	0.37	0.52	0.51	1.98	1.97	1.98	37
中期 (3-7)	16,316	99.14	99.28	4.65	0.57	0.74	0.74	4.58	4.56	4.58	42
長期 (7-)	11,274	92.37	92.59	12.63	0.84	1.50	1.43	11.24	11.15	11.20	57
長期 (7-11)	6,319	96.72	96.92	8.41	0.76	1.20	1.17	8.12	8.08	8.12	58
超長期 (11-)	4,955	86.83	87.06	18.03	0.95	1.93	1.79	15.66	15.52	15.57	56
AAA 格	10,261	97.95	98.02	5.81	0.37	0.58	0.57	5.10	5.08	5.08	21
短期 (1-3)	3,975	99.58	99.60	2.02	0.14	0.34	0.33	2.02	2.02	2.02	19
中期 (3-7)	4,275	99.27	99.33	4.65	0.38	0.52	0.52	4.60	4.59	4.60	21
長期 (7-)	2,011	91.93	92.10	15.78	0.78	1.25	1.17	12.85	12.75	12.74	25
長期 (7-11)	1,204	98.38	98.52	8.39	0.62	0.84	0.84	8.17	8.13	8.17	24
超長期 (11-)	807	82.32	82.51	26.81	1.02	1.96	1.77	21.18	20.98	20.88	26
AA 格	18,327	97.46	97.61	6.23	0.60	0.85	0.83	5.70	5.67	5.69	41
短期 (1-3)	5,597	99.89	100.01	1.94	0.47	0.51	0.51	1.93	1.92	1.93	37
中期 (3-7)	7,167	99.22	99.37	4.63	0.57	0.73	0.72	4.56	4.54	4.56	41
長期 (7-)	5,563	92.73	92.93	12.60	0.77	1.39	1.33	11.37	11.28	11.33	45
長期 (7-11)	2,999	97.34	97.53	8.35	0.69	1.06	1.04	8.10	8.06	8.10	46
超長期 (11-)	2,564	87.35	87.54	17.57	0.87	1.81	1.69	15.63	15.49	15.55	45
A 格	12,126	97.03	97.21	5.75	0.72	1.12	1.08	5.37	5.33	5.36	68
短期 (1-3)	3,768	99.44	99.55	2.02	0.47	0.70	0.70	2.01	2.00	2.01	55
中期 (3-7)	4,698	98.95	99.12	4.68	0.72	0.94	0.93	4.59	4.57	4.59	61
長期 (7-)	3,660	92.08	92.35	10.97	0.98	1.82	1.72	10.17	10.08	10.15	93
長期 (7-11)	2,096	94.88	95.15	8.50	0.93	1.63	1.56	8.13	8.07	8.13	96
超長期 (11-)	1,565	88.32	88.61	14.28	1.05	2.10	1.96	13.09	12.97	13.06	89
BBB 格	377	97.86	97.99	4.10	0.89	1.32	1.30	3.89	3.86	3.89	102
短期 (1-3)	161	99.45	99.58	1.95	0.54	0.82	0.82	1.94	1.93	1.94	68
中期 (3-7)	176	97.98	98.12	4.38	1.21	1.70	1.68	4.27	4.23	4.27	138
長期 (7-)	40	90.95	91.07	11.48	0.86	1.74	1.65	10.63	10.54	10.62	82
長期 (7-11)	20	95.91	96.00	7.88	0.79	1.36	1.33	7.64	7.59	7.64	79
超長期 (11-)	20	85.99	86.15	15.08	0.93	2.16	2.01	13.97	13.83	13.93	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	28,583	97.14	97.33	9.80	0.86	0.95	0.92	8.23	8.17	8.18	31
短期 (1-3)	6,804	100.01	100.11	2.02	0.47	0.47	0.47	2.00	2.00	2.00	32
中期 (3-7)	9,270	100.70	100.89	4.72	0.80	0.64	0.64	4.62	4.61	4.62	32
長期 (7-)	12,508	92.94	93.18	17.80	1.11	1.47	1.41	14.76	14.64	14.64	29
長期 (7-11)	3,874	101.34	101.59	8.74	1.09	0.94	0.94	8.33	8.29	8.32	32
超長期 (11-)	8,634	89.16	89.41	21.86	1.11	1.75	1.65	18.04	17.88	17.86	27

出所:NFRC

- 格付は、JCR の格付をもとに NFRC で分類

事業債 JCR 格付別・ポートフォリオ指標 (2024年3月末、4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	28,817	97.64	97.77	6.10	0.52	0.76	0.74	5.51	5.48	5.50	34
短期 (1-3)	9,757	99.76	99.84	2.03	0.34	0.45	0.45	2.03	2.02	2.03	30
中期 (3-7)	11,624	99.18	99.29	4.72	0.49	0.66	0.65	4.66	4.64	4.66	33
長期 (7-)	7,437	92.47	92.66	13.59	0.79	1.36	1.30	11.87	11.79	11.82	40
長期 (7-11)	4,061	97.71	97.89	8.44	0.69	1.01	0.99	8.19	8.15	8.19	40
超長期 (11-)	3,376	86.16	86.36	19.78	0.91	1.85	1.71	16.90	16.75	16.77	41
AAA~A 格	40,671	97.45	97.59	6.03	0.58	0.87	0.84	5.50	5.47	5.49	44
短期 (1-3)	13,449	99.67	99.76	2.05	0.38	0.52	0.52	2.04	2.04	2.04	37
中期 (3-7)	16,195	99.10	99.23	4.75	0.56	0.74	0.73	4.67	4.65	4.67	41
長期 (7-)	11,027	92.31	92.52	12.77	0.86	1.52	1.44	11.35	11.26	11.31	57
長期 (7-11)	6,127	96.76	96.97	8.51	0.78	1.22	1.19	8.21	8.16	8.21	59
超長期 (11-)	4,900	86.74	86.96	18.10	0.95	1.93	1.79	15.73	15.59	15.63	56
AAA~BBB 格	41,069	97.45	97.59	6.01	0.59	0.87	0.85	5.48	5.45	5.47	45
短期 (1-3)	13,629	99.66	99.76	2.05	0.38	0.53	0.52	2.04	2.04	2.04	38
中期 (3-7)	16,373	99.09	99.22	4.74	0.57	0.75	0.74	4.67	4.65	4.67	42
長期 (7-)	11,067	92.30	92.52	12.77	0.86	1.52	1.44	11.35	11.26	11.31	58
長期 (7-11)	6,147	96.76	96.97	8.51	0.78	1.22	1.19	8.21	8.16	8.21	59
超長期 (11-)	4,920	86.74	86.96	18.09	0.95	1.93	1.79	15.72	15.58	15.62	56
AAA~BB 格	41,069	97.45	97.59	6.01	0.59	0.87	0.85	5.48	5.45	5.47	45
短期 (1-3)	13,629	99.66	99.76	2.05	0.38	0.53	0.52	2.04	2.04	2.04	38
中期 (3-7)	16,373	99.09	99.22	4.74	0.57	0.75	0.74	4.67	4.65	4.67	42
長期 (7-)	11,067	92.30	92.52	12.77	0.86	1.52	1.44	11.35	11.26	11.31	58
長期 (7-11)	6,147	96.76	96.97	8.51	0.78	1.22	1.19	8.21	8.16	8.21	59
超長期 (11-)	4,920	86.74	86.96	18.09	0.95	1.93	1.79	15.72	15.58	15.62	56
AAA 格	10,271	97.95	98.02	5.84	0.37	0.58	0.57	5.13	5.10	5.11	21
短期 (1-3)	3,935	99.57	99.59	2.05	0.14	0.34	0.34	2.04	2.04	2.04	19
中期 (3-7)	4,405	99.23	99.30	4.70	0.38	0.53	0.53	4.65	4.64	4.65	21
長期 (7-)	1,931	91.73	91.90	16.14	0.81	1.27	1.20	13.10	13.01	12.99	25
長期 (7-11)	1,124	98.49	98.63	8.49	0.65	0.85	0.85	8.25	8.22	8.25	25
超長期 (11-)	807	82.32	82.51	26.81	1.02	1.96	1.77	21.18	20.98	20.88	26
AA 格	18,547	97.47	97.63	6.25	0.60	0.85	0.83	5.73	5.69	5.72	41
短期 (1-3)	5,822	99.89	100.01	2.02	0.48	0.52	0.52	2.01	2.01	2.01	38
中期 (3-7)	7,219	99.14	99.29	4.74	0.56	0.73	0.73	4.66	4.64	4.66	41
長期 (7-)	5,506	92.73	92.92	12.69	0.79	1.39	1.33	11.45	11.36	11.41	45
長期 (7-11)	2,937	97.41	97.61	8.42	0.71	1.06	1.05	8.16	8.12	8.16	46
超長期 (11-)	2,569	87.37	87.57	17.57	0.87	1.81	1.69	15.63	15.49	15.55	45
A 格	11,854	96.96	97.15	5.86	0.73	1.13	1.10	5.47	5.43	5.47	69
短期 (1-3)	3,693	99.42	99.53	2.11	0.48	0.72	0.72	2.09	2.08	2.09	57
中期 (3-7)	4,571	98.90	99.07	4.80	0.73	0.95	0.94	4.71	4.68	4.71	62
長期 (7-)	3,590	91.97	92.24	11.08	0.99	1.84	1.74	10.27	10.18	10.25	93
長期 (7-11)	2,066	94.90	95.16	8.64	0.96	1.65	1.58	8.26	8.20	8.26	96
超長期 (11-)	1,525	88.01	88.29	14.39	1.03	2.12	1.97	13.20	13.07	13.17	89
BBB 格	398	97.96	98.10	4.02	0.92	1.33	1.31	3.81	3.78	3.81	104
短期 (1-3)	180	99.47	99.61	2.00	0.62	0.89	0.89	1.98	1.97	1.98	75
中期 (3-7)	178	98.01	98.15	4.38	1.22	1.70	1.68	4.26	4.23	4.26	138
長期 (7-)	40	90.95	91.07	11.48	0.86	1.74	1.65	10.63	10.54	10.62	82
長期 (7-11)	20	95.91	96.00	7.88	0.79	1.36	1.33	7.64	7.59	7.64	79
超長期 (11-)	20	85.99	86.15	15.08	0.93	2.16	2.01	13.97	13.83	13.93	87
BB 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
B 格以下	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
格付なし	28,478	97.13	97.33	9.84	0.86	0.95	0.92	8.26	8.21	8.21	31
短期 (1-3)	6,979	100.06	100.16	2.08	0.49	0.47	0.47	2.07	2.07	2.07	32
中期 (3-7)	9,116	100.65	100.84	4.81	0.80	0.65	0.65	4.71	4.70	4.71	32
長期 (7-)	12,383	92.89	93.14	17.91	1.11	1.48	1.41	14.84	14.73	14.72	28
長期 (7-11)	3,769	101.44	101.70	8.82	1.11	0.94	0.95	8.40	8.36	8.39	32
超長期 (11-)	8,614	89.15	89.40	21.89	1.11	1.75	1.65	18.05	17.90	17.87	27

出所:NFRC

- 格付は、JCR の格付をもとに NFRC で分類

事業債 Moody's 格付別・ポートフォリオ指標 (2024年3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	23,087	97.91	98.09	8.68	0.74	0.83	0.81	7.46	7.42	7.42	26
短期 (1-3)	6,514	99.89	99.96	2.01	0.32	0.37	0.37	2.01	2.00	2.01	23
中期 (3-7)	7,568	100.41	100.58	4.55	0.66	0.55	0.56	4.47	4.46	4.47	25
長期 (7-)	9,005	94.37	94.65	16.98	1.11	1.43	1.38	14.30	14.19	14.20	28
長期 (7-11)	3,153	100.34	100.61	8.70	0.94	0.92	0.92	8.34	8.30	8.34	30
超長期 (11-)	5,852	91.16	91.44	21.44	1.21	1.73	1.65	17.84	17.69	17.67	27
AAA~BBB 格	25,189	97.90	98.08	8.54	0.75	0.84	0.82	7.37	7.33	7.33	27
短期 (1-3)	6,903	99.88	99.95	2.00	0.32	0.37	0.37	2.00	1.99	2.00	23
中期 (3-7)	8,669	100.38	100.56	4.59	0.70	0.60	0.60	4.51	4.50	4.51	29
長期 (7-)	9,617	94.23	94.50	16.80	1.10	1.43	1.38	14.20	14.09	14.09	30
長期 (7-11)	3,429	100.19	100.45	8.70	0.93	0.93	0.93	8.35	8.31	8.34	31
超長期 (11-)	6,188	90.92	91.20	21.29	1.20	1.74	1.66	17.77	17.61	17.60	29
AAA~BB 格	25,189	97.90	98.08	8.54	0.75	0.84	0.82	7.37	7.33	7.33	27
短期 (1-3)	6,903	99.88	99.95	2.00	0.32	0.37	0.37	2.00	1.99	2.00	23
中期 (3-7)	8,669	100.38	100.56	4.59	0.70	0.60	0.60	4.51	4.50	4.51	29
長期 (7-)	9,617	94.23	94.50	16.80	1.10	1.43	1.38	14.20	14.09	14.09	30
長期 (7-11)	3,429	100.19	100.45	8.70	0.93	0.93	0.93	8.35	8.31	8.34	31
超長期 (11-)	6,188	90.92	91.20	21.29	1.20	1.74	1.66	17.77	17.61	17.60	29
AAA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
A 格	23,087	97.91	98.09	8.68	0.74	0.83	0.81	7.46	7.42	7.42	26
短期 (1-3)	6,514	99.89	99.96	2.01	0.32	0.37	0.37	2.01	2.00	2.01	23
中期 (3-7)	7,568	100.41	100.58	4.55	0.66	0.55	0.56	4.47	4.46	4.47	25
長期 (7-)	9,005	94.37	94.65	16.98	1.11	1.43	1.38	14.30	14.19	14.20	28
長期 (7-11)	3,153	100.34	100.61	8.70	0.94	0.92	0.92	8.34	8.30	8.34	30
超長期 (11-)	5,852	91.16	91.44	21.44	1.21	1.73	1.65	17.84	17.69	17.67	27
BBB 格	2,103	97.75	97.93	7.04	0.81	0.98	0.96	6.36	6.32	6.34	49
短期 (1-3)	390	99.73	99.78	1.82	0.27	0.40	0.40	1.81	1.81	1.81	27
中期 (3-7)	1,101	100.21	100.41	4.89	0.93	0.89	0.89	4.78	4.75	4.77	56
長期 (7-)	612	92.06	92.31	14.25	0.96	1.55	1.48	12.57	12.47	12.52	49
長期 (7-11)	276	98.44	98.68	8.74	0.83	1.05	1.04	8.42	8.37	8.41	42
超長期 (11-)	336	86.82	87.08	18.77	1.06	2.02	1.89	16.44	16.29	16.34	57
BB 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
B 格以下	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
格付なし	44,483	97.00	97.15	6.97	0.66	0.93	0.90	6.13	6.09	6.11	45
短期 (1-3)	13,401	99.73	99.83	1.99	0.45	0.57	0.56	1.98	1.97	1.98	42
中期 (3-7)	16,917	99.36	99.51	4.71	0.63	0.76	0.76	4.64	4.62	4.64	44
長期 (7-)	14,165	91.61	91.82	14.36	0.90	1.52	1.44	12.33	12.23	12.26	51
長期 (7-11)	6,763	97.61	97.81	8.45	0.86	1.19	1.16	8.13	8.08	8.13	57
超長期 (11-)	7,402	86.13	86.34	19.77	0.93	1.87	1.73	16.67	16.52	16.53	45

出所:NFRC

- 格付は、Moody's の格付をもとに NFRC で分類

事業債 Moody's 格付別・ポートフォリオ指標 (2024年3月末、4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	22,997	97.90	98.09	8.74	0.75	0.83	0.82	7.51	7.47	7.47	26
短期 (1-3)	6,639	99.95	100.03	2.09	0.36	0.38	0.38	2.08	2.08	2.08	23
中期 (3-7)	7,448	100.31	100.47	4.66	0.65	0.56	0.56	4.58	4.57	4.58	24
長期 (7-)	8,910	94.36	94.64	17.10	1.13	1.44	1.39	14.40	14.28	14.29	28
長期 (7-11)	3,068	100.50	100.77	8.79	0.97	0.93	0.93	8.42	8.38	8.41	30
超長期 (11-)	5,842	91.14	91.42	21.46	1.21	1.73	1.65	17.86	17.71	17.69	27
AAA~BBB 格	25,099	97.89	98.07	8.60	0.75	0.85	0.83	7.42	7.37	7.38	28
短期 (1-3)	7,018	99.94	100.02	2.08	0.35	0.38	0.38	2.07	2.06	2.07	24
中期 (3-7)	8,564	100.29	100.46	4.69	0.68	0.60	0.60	4.61	4.60	4.61	29
長期 (7-)	9,517	94.22	94.49	16.92	1.12	1.44	1.39	14.29	14.18	14.18	30
長期 (7-11)	3,339	100.34	100.61	8.80	0.96	0.94	0.94	8.43	8.39	8.42	31
超長期 (11-)	6,178	90.90	91.19	21.31	1.20	1.74	1.66	17.78	17.63	17.62	29
AAA~BB 格	25,099	97.89	98.07	8.60	0.75	0.85	0.83	7.42	7.37	7.38	28
短期 (1-3)	7,018	99.94	100.02	2.08	0.35	0.38	0.38	2.07	2.06	2.07	24
中期 (3-7)	8,564	100.29	100.46	4.69	0.68	0.60	0.60	4.61	4.60	4.61	29
長期 (7-)	9,517	94.22	94.49	16.92	1.12	1.44	1.39	14.29	14.18	14.18	30
長期 (7-11)	3,339	100.34	100.61	8.80	0.96	0.94	0.94	8.43	8.39	8.42	31
超長期 (11-)	6,178	90.90	91.19	21.31	1.20	1.74	1.66	17.78	17.63	17.62	29
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	22,997	97.90	98.09	8.74	0.75	0.83	0.82	7.51	7.47	7.47	26
短期 (1-3)	6,639	99.95	100.03	2.09	0.36	0.38	0.38	2.08	2.08	2.08	23
中期 (3-7)	7,448	100.31	100.47	4.66	0.65	0.56	0.56	4.58	4.57	4.58	24
長期 (7-)	8,910	94.36	94.64	17.10	1.13	1.44	1.39	14.40	14.28	14.29	28
長期 (7-11)	3,068	100.50	100.77	8.79	0.97	0.93	0.93	8.42	8.38	8.41	30
超長期 (11-)	5,842	91.14	91.42	21.46	1.21	1.73	1.65	17.86	17.71	17.69	27
BBB 格	2,103	97.75	97.93	7.09	0.82	0.98	0.96	6.40	6.36	6.38	49
短期 (1-3)	380	99.72	99.77	1.84	0.27	0.40	0.40	1.83	1.83	1.83	27
中期 (3-7)	1,116	100.15	100.35	4.92	0.92	0.89	0.89	4.80	4.78	4.80	56
長期 (7-)	607	92.09	92.34	14.35	0.97	1.56	1.48	12.66	12.56	12.61	49
長期 (7-11)	271	98.63	98.87	8.88	0.87	1.05	1.05	8.53	8.49	8.53	41
超長期 (11-)	336	86.82	87.08	18.77	1.06	2.02	1.89	16.44	16.29	16.34	57
BB 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
B 格以下	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
格付なし	44,447	97.00	97.15	7.00	0.66	0.93	0.91	6.16	6.13	6.14	45
短期 (1-3)	13,589	99.73	99.83	2.06	0.46	0.57	0.57	2.04	2.04	2.04	42
中期 (3-7)	16,925	99.32	99.47	4.80	0.63	0.77	0.76	4.72	4.70	4.72	44
長期 (7-)	13,933	91.52	91.72	14.50	0.91	1.54	1.45	12.44	12.34	12.36	51
長期 (7-11)	6,576	97.62	97.83	8.54	0.88	1.20	1.17	8.21	8.16	8.21	57
超長期 (11-)	7,357	86.06	86.26	19.83	0.93	1.88	1.73	16.72	16.57	16.58	45

出所:NFRC

- 格付は、Moody's の格付をもとに NFRC で分類

事業債 S&P 格付別・ポートフォリオ指標 (2024年3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	790	87.96	88.18	18.35	0.94	1.49	1.36	14.52	14.39	14.39	31
短期 (1-3)	20	101.79	102.11	2.26	1.21	0.40	0.40	2.23	2.23	2.23	24
中期 (3-7)	100	99.32	99.49	5.01	0.64	0.61	0.61	4.93	4.91	4.93	27
長期 (7-)	670	85.85	86.07	20.82	0.97	1.68	1.53	16.61	16.46	16.46	32
長期 (7-11)	212	101.58	101.83	8.73	1.09	0.92	0.93	8.33	8.29	8.32	31
超長期 (11-)	458	78.57	78.77	26.41	0.92	2.13	1.88	21.56	21.35	21.33	32
AAA~A 格	16,278	96.51	96.64	9.22	0.72	0.86	0.83	7.77	7.72	7.73	26
短期 (1-3)	3,716	99.97	100.03	2.04	0.36	0.37	0.37	2.03	2.03	2.03	23
中期 (3-7)	5,608	100.30	100.43	4.90	0.69	0.59	0.59	4.81	4.79	4.81	26
長期 (7-)	6,954	91.61	91.77	16.55	0.94	1.39	1.31	13.72	13.62	13.62	28
長期 (7-11)	2,851	100.75	100.93	8.55	0.97	0.88	0.89	8.20	8.17	8.20	28
超長期 (11-)	4,104	85.26	85.40	22.11	0.92	1.80	1.66	18.25	18.09	18.07	28
AAA~BBB 格	16,863	96.62	96.75	9.02	0.72	0.86	0.83	7.60	7.56	7.56	27
短期 (1-3)	4,060	99.96	100.02	2.03	0.39	0.39	0.39	2.02	2.02	2.02	25
中期 (3-7)	5,799	100.27	100.41	4.87	0.69	0.60	0.60	4.79	4.77	4.79	27
長期 (7-)	7,004	91.66	91.81	16.50	0.94	1.39	1.31	13.68	13.58	13.58	29
長期 (7-11)	2,900	100.72	100.89	8.56	0.98	0.89	0.89	8.21	8.17	8.20	29
超長期 (11-)	4,104	85.26	85.40	22.11	0.92	1.80	1.66	18.25	18.09	18.07	28
AAA~BB 格	17,103	96.69	96.82	8.98	0.74	0.87	0.84	7.57	7.53	7.54	29
短期 (1-3)	4,060	99.96	100.02	2.03	0.39	0.39	0.39	2.02	2.02	2.02	25
中期 (3-7)	6,014	100.35	100.49	4.88	0.74	0.64	0.64	4.79	4.77	4.79	31
長期 (7-)	7,029	91.67	91.83	16.50	0.95	1.39	1.31	13.68	13.57	13.58	29
長期 (7-11)	2,900	100.72	100.89	8.56	0.98	0.89	0.89	8.21	8.17	8.20	29
超長期 (11-)	4,129	85.32	85.47	22.07	0.93	1.81	1.66	18.22	18.06	18.04	29
AAA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA 格	790	87.96	88.18	18.35	0.94	1.49	1.36	14.52	14.39	14.39	31
短期 (1-3)	20	101.79	102.11	2.26	1.21	0.40	0.40	2.23	2.23	2.23	24
中期 (3-7)	100	99.32	99.49	5.01	0.64	0.61	0.61	4.93	4.91	4.93	27
長期 (7-)	670	85.85	86.07	20.82	0.97	1.68	1.53	16.61	16.46	16.46	32
長期 (7-11)	212	101.58	101.83	8.73	1.09	0.92	0.93	8.33	8.29	8.32	31
超長期 (11-)	458	78.57	78.77	26.41	0.92	2.13	1.88	21.56	21.35	21.33	32
A 格	15,488	96.95	97.07	8.76	0.71	0.83	0.81	7.46	7.41	7.42	26
短期 (1-3)	3,696	99.96	100.02	2.04	0.35	0.37	0.37	2.03	2.03	2.03	23
中期 (3-7)	5,508	100.32	100.45	4.89	0.69	0.59	0.59	4.81	4.79	4.81	26
長期 (7-)	6,284	92.22	92.37	16.10	0.94	1.36	1.29	13.43	13.33	13.34	28
長期 (7-11)	2,639	100.69	100.86	8.54	0.97	0.88	0.88	8.19	8.16	8.19	28
超長期 (11-)	3,646	86.10	86.23	21.57	0.92	1.77	1.63	17.87	17.71	17.69	28
BBB 格	585	99.61	99.72	3.26	0.71	0.73	0.73	3.19	3.18	3.19	50
短期 (1-3)	344	99.85	99.96	1.92	0.67	0.62	0.62	1.90	1.90	1.90	48
中期 (3-7)	192	99.45	99.55	4.25	0.68	0.81	0.80	4.19	4.17	4.19	51
長期 (7-)	50	98.63	98.70	8.75	1.09	1.27	1.26	8.35	8.29	8.34	64
長期 (7-11)	50	98.63	98.70	8.75	1.09	1.27	1.26	8.35	8.29	8.34	64
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
BB 格	240	101.78	102.19	6.17	2.26	1.79	1.81	5.59	5.54	5.58	139
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	215	102.49	102.85	5.00	2.25	1.69	1.71	4.74	4.70	4.74	138
長期 (7-)	25	95.70	96.49	16.16	2.37	2.75	2.70	13.35	13.17	13.26	151
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	25	95.70	96.49	16.16	2.37	2.75	2.70	13.35	13.17	13.26	151
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	52,569	97.53	97.71	7.07	0.68	0.91	0.88	6.26	6.22	6.24	42
短期 (1-3)	16,244	99.74	99.84	1.99	0.41	0.53	0.53	1.98	1.97	1.98	38
中期 (3-7)	19,571	99.51	99.67	4.61	0.63	0.72	0.72	4.53	4.52	4.53	41
長期 (7-)	16,754	93.09	93.35	14.87	1.00	1.53	1.46	12.86	12.75	12.78	48
長期 (7-11)	7,293	97.58	97.82	8.52	0.85	1.19	1.16	8.20	8.16	8.20	56
超長期 (11-)	9,461	89.62	89.90	19.76	1.11	1.81	1.71	16.76	16.61	16.62	41

出所:NFRC

- 格付は、S&P の格付をもとに NFRC で分類

事業債 S&P 格付別・ポートフォリオ指標 (2024年3月末、4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	790	87.96	88.18	18.35	0.94	1.49	1.36	14.52	14.39	14.39	31
短期 (1-3)	20	101.79	102.11	2.26	1.21	0.40	0.40	2.23	2.23	2.23	24
中期 (3-7)	100	99.32	99.49	5.01	0.64	0.61	0.61	4.93	4.91	4.93	27
長期 (7-)	670	85.85	86.07	20.82	0.97	1.68	1.53	16.61	16.46	16.46	32
長期 (7-11)	212	101.58	101.83	8.73	1.09	0.92	0.93	8.33	8.29	8.32	31
超長期 (11-)	458	78.57	78.77	26.41	0.92	2.13	1.88	21.56	21.35	21.33	32
AAA~A 格	16,303	96.52	96.64	9.23	0.72	0.86	0.83	7.78	7.73	7.74	26
短期 (1-3)	3,796	100.03	100.10	2.07	0.38	0.37	0.37	2.06	2.06	2.06	23
中期 (3-7)	5,608	100.26	100.39	4.96	0.68	0.60	0.60	4.87	4.86	4.87	26
長期 (7-)	6,899	91.54	91.70	16.65	0.95	1.40	1.32	13.80	13.69	13.70	28
長期 (7-11)	2,791	100.76	100.95	8.61	0.99	0.89	0.90	8.26	8.22	8.25	29
超長期 (11-)	4,109	85.28	85.42	22.11	0.92	1.80	1.66	18.25	18.09	18.07	28
AAA~BBB 格	16,888	96.63	96.75	9.03	0.72	0.86	0.83	7.61	7.57	7.57	27
短期 (1-3)	4,140	100.01	100.09	2.06	0.41	0.39	0.39	2.05	2.04	2.05	25
中期 (3-7)	5,799	100.24	100.36	4.94	0.68	0.60	0.60	4.85	4.83	4.85	27
長期 (7-)	6,949	91.59	91.75	16.59	0.95	1.40	1.32	13.76	13.65	13.66	29
長期 (7-11)	2,840	100.73	100.91	8.62	0.99	0.90	0.90	8.26	8.22	8.26	29
超長期 (11-)	4,109	85.28	85.42	22.11	0.92	1.80	1.66	18.25	18.09	18.07	28
AAA~BB 格	17,128	96.70	96.83	8.99	0.74	0.87	0.84	7.58	7.54	7.54	29
短期 (1-3)	4,140	100.01	100.09	2.06	0.41	0.39	0.39	2.05	2.04	2.05	25
中期 (3-7)	6,014	100.32	100.45	4.94	0.73	0.64	0.64	4.84	4.83	4.84	31
長期 (7-)	6,974	91.61	91.76	16.59	0.95	1.40	1.32	13.76	13.65	13.65	29
長期 (7-11)	2,840	100.73	100.91	8.62	0.99	0.90	0.90	8.26	8.22	8.26	29
超長期 (11-)	4,134	85.34	85.48	22.07	0.93	1.81	1.66	18.21	18.05	18.03	29
AAA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA 格	790	87.96	88.18	18.35	0.94	1.49	1.36	14.52	14.39	14.39	31
短期 (1-3)	20	101.79	102.11	2.26	1.21	0.40	0.40	2.23	2.23	2.23	24
中期 (3-7)	100	99.32	99.49	5.01	0.64	0.61	0.61	4.93	4.91	4.93	27
長期 (7-)	670	85.85	86.07	20.82	0.97	1.68	1.53	16.61	16.46	16.46	32
長期 (7-11)	212	101.58	101.83	8.73	1.09	0.92	0.93	8.33	8.29	8.32	31
超長期 (11-)	458	78.57	78.77	26.41	0.92	2.13	1.88	21.56	21.35	21.33	32
A 格	15,513	96.95	97.07	8.77	0.71	0.84	0.81	7.47	7.42	7.43	26
短期 (1-3)	3,776	100.02	100.09	2.07	0.38	0.37	0.37	2.06	2.05	2.06	23
中期 (3-7)	5,508	100.28	100.41	4.96	0.68	0.60	0.60	4.87	4.85	4.87	26
長期 (7-)	6,229	92.15	92.30	16.20	0.95	1.37	1.30	13.52	13.42	13.42	28
長期 (7-11)	2,579	100.70	100.87	8.61	0.98	0.89	0.89	8.25	8.21	8.25	29
超長期 (11-)	3,651	86.12	86.25	21.57	0.92	1.77	1.63	17.87	17.71	17.69	28
BBB 格	585	99.61	99.72	3.26	0.71	0.73	0.73	3.19	3.18	3.19	50
短期 (1-3)	344	99.85	99.96	1.92	0.67	0.62	0.62	1.90	1.90	1.90	48
中期 (3-7)	192	99.45	99.55	4.25	0.68	0.81	0.80	4.19	4.17	4.19	51
長期 (7-)	50	98.63	98.70	8.75	1.09	1.27	1.26	8.35	8.29	8.34	64
長期 (7-11)	50	98.63	98.70	8.75	1.09	1.27	1.26	8.35	8.29	8.34	64
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
BB 格	240	101.78	102.19	6.17	2.26	1.79	1.81	5.59	5.54	5.58	139
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	215	102.49	102.85	5.00	2.25	1.69	1.71	4.74	4.70	4.74	138
長期 (7-)	25	95.70	96.49	16.16	2.37	2.75	2.70	13.35	13.17	13.26	151
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	25	95.70	96.49	16.16	2.37	2.75	2.70	13.35	13.17	13.26	151
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	52,419	97.52	97.70	7.12	0.68	0.91	0.89	6.31	6.27	6.28	42
短期 (1-3)	16,468	99.74	99.84	2.07	0.42	0.53	0.53	2.05	2.05	2.05	39
中期 (3-7)	19,475	99.44	99.60	4.71	0.62	0.73	0.73	4.63	4.62	4.63	41
長期 (7-)	16,477	93.04	93.30	15.01	1.01	1.54	1.47	12.97	12.87	12.89	48
長期 (7-11)	7,076	97.66	97.90	8.63	0.88	1.20	1.17	8.29	8.24	8.29	56
超長期 (11-)	9,401	89.56	89.84	19.82	1.11	1.82	1.71	16.81	16.66	16.67	40

出所:NFRC

- 格付は、S&P の格付をもとに NFRC で分類

円建外債 最高格付別・ポートフォリオ指標 (2024年3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	1,364	99.61	99.83	3.59	0.83	0.93	0.92	3.50	3.49	3.50	68
短期(1-3)	693	99.83	100.03	2.30	0.71	0.79	0.79	2.28	2.27	2.28	62
中期(3-7)	600	99.56	99.80	4.42	0.92	1.02	1.02	4.33	4.30	4.32	72
長期(7-)	71	97.92	98.20	9.10	1.21	1.50	1.48	8.56	8.50	8.55	83
長期(7-11)	67	98.05	98.32	8.76	1.16	1.44	1.43	8.32	8.26	8.32	81
超長期(11-)	4	95.75	96.14	14.51	1.99	2.38	2.34	12.43	12.29	12.37	128
AAA~A格	3,267	99.35	99.64	3.85	1.10	1.23	1.22	3.68	3.65	3.67	95
短期(1-3)	1,557	100.01	100.30	2.21	1.10	1.06	1.06	2.18	2.17	2.18	91
中期(3-7)	1,434	98.89	99.14	4.22	0.95	1.23	1.22	4.13	4.10	4.13	93
長期(7-)	276	97.96	98.47	11.16	1.86	2.13	2.11	9.88	9.78	9.86	130
長期(7-11)	150	97.00	97.29	8.80	1.34	1.75	1.73	8.28	8.21	8.27	111
超長期(11-)	126	99.10	99.88	13.99	2.49	2.58	2.55	11.75	11.60	11.69	153
AAA~BBB格	3,652	99.31	99.60	3.84	1.10	1.22	1.22	3.66	3.63	3.66	95
短期(1-3)	1,784	100.00	100.29	2.14	1.09	1.06	1.06	2.12	2.10	2.12	90
中期(3-7)	1,534	98.95	99.21	4.25	0.97	1.23	1.22	4.16	4.13	4.16	93
長期(7-)	333	97.25	97.75	11.03	1.76	2.11	2.07	9.82	9.71	9.79	128
長期(7-11)	185	96.94	97.25	8.66	1.30	1.73	1.71	8.16	8.09	8.16	110
超長期(11-)	149	97.64	98.37	13.97	2.34	2.56	2.52	11.84	11.70	11.79	150
AAA~BB格	3,652	99.31	99.60	3.84	1.10	1.22	1.22	3.66	3.63	3.66	95
短期(1-3)	1,784	100.00	100.29	2.14	1.09	1.06	1.06	2.12	2.10	2.12	90
中期(3-7)	1,534	98.95	99.21	4.25	0.97	1.23	1.22	4.16	4.13	4.16	93
長期(7-)	333	97.25	97.75	11.03	1.76	2.11	2.07	9.82	9.71	9.79	128
長期(7-11)	185	96.94	97.25	8.66	1.30	1.73	1.71	8.16	8.09	8.16	110
超長期(11-)	149	97.64	98.37	13.97	2.34	2.56	2.52	11.84	11.70	11.79	150
AAA格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA格	1,364	99.61	99.83	3.59	0.83	0.93	0.92	3.50	3.49	3.50	68
短期(1-3)	693	99.83	100.03	2.30	0.71	0.79	0.79	2.28	2.27	2.28	62
中期(3-7)	600	99.56	99.80	4.42	0.92	1.02	1.02	4.33	4.30	4.32	72
長期(7-)	71	97.92	98.20	9.10	1.21	1.50	1.48	8.56	8.50	8.55	83
長期(7-11)	67	98.05	98.32	8.76	1.16	1.44	1.43	8.32	8.26	8.32	81
超長期(11-)	4	95.75	96.14	14.51	1.99	2.38	2.34	12.43	12.29	12.37	128
A格	1,903	99.16	99.50	4.03	1.30	1.44	1.43	3.80	3.77	3.79	115
短期(1-3)	865	100.16	100.52	2.13	1.42	1.29	1.29	2.10	2.08	2.10	114
中期(3-7)	834	98.41	98.67	4.08	0.98	1.38	1.37	3.99	3.96	3.99	109
長期(7-)	205	97.97	98.57	11.88	2.09	2.35	2.32	10.34	10.22	10.30	146
長期(7-11)	84	96.16	96.47	8.83	1.47	2.01	1.97	8.25	8.17	8.24	135
超長期(11-)	122	99.22	100.01	13.97	2.51	2.58	2.55	11.73	11.58	11.67	154
BBB格	384	98.97	99.31	3.76	1.10	1.19	1.18	3.53	3.50	3.53	93
短期(1-3)	227	99.91	100.22	1.69	1.02	1.00	1.00	1.68	1.67	1.68	88
中期(3-7)	101	99.78	100.14	4.70	1.19	1.23	1.23	4.56	4.53	4.56	91
長期(7-)	57	93.80	94.22	10.37	1.28	1.97	1.90	9.46	9.37	9.44	116
長期(7-11)	34	96.66	97.05	8.04	1.16	1.65	1.63	7.65	7.58	7.64	107
超長期(11-)	23	89.50	89.95	13.87	1.45	2.48	2.36	12.41	12.27	12.37	132
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 (2024年3月末、4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	1,364	99.61	99.83	3.59	0.83	0.93	0.92	3.50	3.49	3.50	68
短期 (1-3)	693	99.83	100.03	2.30	0.71	0.79	0.79	2.28	2.27	2.28	62
中期 (3-7)	600	99.56	99.80	4.42	0.92	1.02	1.02	4.33	4.30	4.32	72
長期 (7-)	71	97.92	98.20	9.10	1.21	1.50	1.48	8.56	8.50	8.55	83
長期 (7-11)	67	98.05	98.32	8.76	1.16	1.44	1.43	8.32	8.26	8.32	81
超長期 (11-)	4	95.75	96.14	14.51	1.99	2.38	2.34	12.43	12.29	12.37	128
AAA~A 格	3,243	99.34	99.63	3.87	1.10	1.23	1.22	3.69	3.67	3.69	95
短期 (1-3)	1,585	99.98	100.27	2.25	1.10	1.07	1.07	2.22	2.21	2.22	91
中期 (3-7)	1,382	98.89	99.13	4.26	0.96	1.24	1.23	4.17	4.15	4.17	94
長期 (7-)	276	97.96	98.47	11.16	1.86	2.13	2.11	9.88	9.78	9.86	130
長期 (7-11)	150	97.00	97.29	8.80	1.34	1.75	1.73	8.28	8.21	8.27	111
超長期 (11-)	126	99.10	99.88	13.99	2.49	2.58	2.55	11.75	11.60	11.69	153
AAA~BBB 格	3,628	99.30	99.60	3.86	1.10	1.22	1.22	3.68	3.65	3.67	95
短期 (1-3)	1,812	99.98	100.26	2.18	1.09	1.06	1.06	2.16	2.14	2.16	90
中期 (3-7)	1,482	98.95	99.20	4.29	0.98	1.24	1.23	4.20	4.17	4.20	93
長期 (7-)	333	97.25	97.75	11.03	1.76	2.11	2.07	9.82	9.71	9.79	128
長期 (7-11)	185	96.94	97.25	8.66	1.30	1.73	1.71	8.16	8.09	8.16	110
超長期 (11-)	149	97.64	98.37	13.97	2.34	2.56	2.52	11.84	11.70	11.79	150
AAA~BB 格	3,628	99.30	99.60	3.86	1.10	1.22	1.22	3.68	3.65	3.67	95
短期 (1-3)	1,812	99.98	100.26	2.18	1.09	1.06	1.06	2.16	2.14	2.16	90
中期 (3-7)	1,482	98.95	99.20	4.29	0.98	1.24	1.23	4.20	4.17	4.20	93
長期 (7-)	333	97.25	97.75	11.03	1.76	2.11	2.07	9.82	9.71	9.79	128
長期 (7-11)	185	96.94	97.25	8.66	1.30	1.73	1.71	8.16	8.09	8.16	110
超長期 (11-)	149	97.64	98.37	13.97	2.34	2.56	2.52	11.84	11.70	11.79	150
AAA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA 格	1,364	99.61	99.83	3.59	0.83	0.93	0.92	3.50	3.49	3.50	68
短期 (1-3)	693	99.83	100.03	2.30	0.71	0.79	0.79	2.28	2.27	2.28	62
中期 (3-7)	600	99.56	99.80	4.42	0.92	1.02	1.02	4.33	4.30	4.32	72
長期 (7-)	71	97.92	98.20	9.10	1.21	1.50	1.48	8.56	8.50	8.55	83
長期 (7-11)	67	98.05	98.32	8.76	1.16	1.44	1.43	8.32	8.26	8.32	81
超長期 (11-)	4	95.75	96.14	14.51	1.99	2.38	2.34	12.43	12.29	12.37	128
A 格	1,879	99.15	99.49	4.07	1.31	1.45	1.44	3.83	3.80	3.83	115
短期 (1-3)	892	100.11	100.46	2.21	1.40	1.28	1.28	2.18	2.16	2.18	112
中期 (3-7)	782	98.37	98.62	4.14	0.99	1.40	1.39	4.05	4.02	4.05	111
長期 (7-)	205	97.97	98.57	11.88	2.09	2.35	2.32	10.34	10.22	10.30	146
長期 (7-11)	84	96.16	96.47	8.83	1.47	2.01	1.97	8.25	8.17	8.24	135
超長期 (11-)	122	99.22	100.01	13.97	2.51	2.58	2.55	11.73	11.58	11.67	154
BBB 格	384	98.97	99.31	3.76	1.10	1.19	1.18	3.53	3.50	3.53	93
短期 (1-3)	227	99.91	100.22	1.69	1.02	1.00	1.00	1.68	1.67	1.68	88
中期 (3-7)	101	99.78	100.14	4.70	1.19	1.23	1.23	4.56	4.53	4.56	91
長期 (7-)	57	93.80	94.22	10.37	1.28	1.97	1.90	9.46	9.37	9.44	116
長期 (7-11)	34	96.66	97.05	8.04	1.16	1.65	1.63	7.65	7.58	7.64	107
超長期 (11-)	23	89.50	89.95	13.87	1.45	2.48	2.36	12.41	12.27	12.37	132
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 (2024年3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	288	99.61	99.77	3.38	0.75	0.85	0.85	3.32	3.31	3.32	62
短期 (1-3)	170	99.88	100.05	2.22	0.72	0.77	0.77	2.20	2.19	2.20	62
中期 (3-7)	104	99.39	99.54	4.60	0.78	0.93	0.93	4.52	4.50	4.52	61
長期 (7-)	14	97.97	98.04	8.63	0.94	1.24	1.23	8.30	8.25	8.30	61
長期 (7-11)	14	97.97	98.04	8.63	0.94	1.24	1.23	8.30	8.25	8.30	61
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AAA~A 格	2,142	99.92	100.22	3.70	1.06	1.07	1.07	3.57	3.55	3.57	81
短期 (1-3)	1,097	100.12	100.42	2.23	1.06	0.97	0.97	2.20	2.19	2.20	81
中期 (3-7)	893	99.43	99.68	4.25	0.93	1.07	1.07	4.17	4.14	4.16	78
長期 (7-)	152	101.34	101.91	11.06	1.76	1.72	1.74	9.90	9.81	9.87	93
長期 (7-11)	91	97.53	97.82	8.80	1.09	1.45	1.43	8.38	8.32	8.37	80
超長期 (11-)	62	106.92	107.93	14.38	2.73	2.08	2.15	11.92	11.79	11.86	111
AAA~BBB 格	3,652	99.31	99.60	3.84	1.10	1.22	1.22	3.66	3.63	3.66	95
短期 (1-3)	1,784	100.00	100.29	2.14	1.09	1.06	1.06	2.12	2.10	2.12	90
中期 (3-7)	1,534	98.95	99.21	4.25	0.97	1.23	1.22	4.16	4.13	4.16	93
長期 (7-)	333	97.25	97.75	11.03	1.76	2.11	2.07	9.82	9.71	9.79	128
長期 (7-11)	185	96.94	97.25	8.66	1.30	1.73	1.71	8.16	8.09	8.16	110
超長期 (11-)	149	97.64	98.37	13.97	2.34	2.56	2.52	11.84	11.70	11.79	150
AAA~BB 格	3,652	99.31	99.60	3.84	1.10	1.22	1.22	3.66	3.63	3.66	95
短期 (1-3)	1,784	100.00	100.29	2.14	1.09	1.06	1.06	2.12	2.10	2.12	90
中期 (3-7)	1,534	98.95	99.21	4.25	0.97	1.23	1.22	4.16	4.13	4.16	93
長期 (7-)	333	97.25	97.75	11.03	1.76	2.11	2.07	9.82	9.71	9.79	128
長期 (7-11)	185	96.94	97.25	8.66	1.30	1.73	1.71	8.16	8.09	8.16	110
超長期 (11-)	149	97.64	98.37	13.97	2.34	2.56	2.52	11.84	11.70	11.79	150
AAA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA 格	288	99.61	99.77	3.38	0.75	0.85	0.85	3.32	3.31	3.32	62
短期 (1-3)	170	99.88	100.05	2.22	0.72	0.77	0.77	2.20	2.19	2.20	62
中期 (3-7)	104	99.39	99.54	4.60	0.78	0.93	0.93	4.52	4.50	4.52	61
長期 (7-)	14	97.97	98.04	8.63	0.94	1.24	1.23	8.30	8.25	8.30	61
長期 (7-11)	14	97.97	98.04	8.63	0.94	1.24	1.23	8.30	8.25	8.30	61
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
A 格	1,854	99.96	100.29	3.75	1.10	1.10	1.10	3.61	3.59	3.61	84
短期 (1-3)	927	100.16	100.48	2.23	1.12	1.00	1.00	2.20	2.19	2.20	85
中期 (3-7)	789	99.43	99.70	4.21	0.95	1.09	1.09	4.12	4.10	4.12	80
長期 (7-)	139	101.67	102.29	11.30	1.84	1.76	1.78	10.05	9.96	10.02	96
長期 (7-11)	77	97.46	97.78	8.83	1.12	1.48	1.47	8.39	8.33	8.39	84
超長期 (11-)	62	106.92	107.93	14.38	2.73	2.08	2.15	11.92	11.79	11.86	111
BBB 格	1,510	98.44	98.73	4.04	1.17	1.45	1.43	3.79	3.76	3.78	116
短期 (1-3)	687	99.82	100.09	2.00	1.15	1.20	1.19	1.98	1.97	1.98	105
中期 (3-7)	642	98.28	98.54	4.25	1.02	1.45	1.44	4.15	4.12	4.15	115
長期 (7-)	181	93.81	94.24	11.00	1.77	2.46	2.38	9.74	9.62	9.71	159
長期 (7-11)	94	96.37	96.70	8.52	1.51	2.01	1.98	7.95	7.87	7.95	139
超長期 (11-)	87	91.05	91.59	13.68	2.05	2.96	2.83	11.78	11.61	11.73	183
BB 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
B 格以下	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
格付なし	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
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 (2024年3月末、4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	288	99.61	99.77	3.38	0.75	0.85	0.85	3.32	3.31	3.32	62
短期 (1-3)	170	99.88	100.05	2.22	0.72	0.77	0.77	2.20	2.19	2.20	62
中期 (3-7)	104	99.39	99.54	4.60	0.78	0.93	0.93	4.52	4.50	4.52	61
長期 (7-)	14	97.97	98.04	8.63	0.94	1.24	1.23	8.30	8.25	8.30	61
長期 (7-11)	14	97.97	98.04	8.63	0.94	1.24	1.23	8.30	8.25	8.30	61
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AAA~A 格	2,142	99.92	100.22	3.70	1.06	1.07	1.07	3.57	3.55	3.57	81
短期 (1-3)	1,097	100.12	100.42	2.23	1.06	0.97	0.97	2.20	2.19	2.20	81
中期 (3-7)	893	99.43	99.68	4.25	0.93	1.07	1.07	4.17	4.14	4.16	78
長期 (7-)	152	101.34	101.91	11.06	1.76	1.72	1.74	9.90	9.81	9.87	93
長期 (7-11)	91	97.53	97.82	8.80	1.09	1.45	1.43	8.38	8.32	8.37	80
超長期 (11-)	62	106.92	107.93	14.38	2.73	2.08	2.15	11.92	11.79	11.86	111
AAA~BBB 格	3,628	99.30	99.60	3.86	1.10	1.22	1.22	3.68	3.65	3.67	95
短期 (1-3)	1,812	99.98	100.26	2.18	1.09	1.06	1.06	2.16	2.14	2.16	90
中期 (3-7)	1,482	98.95	99.20	4.29	0.98	1.24	1.23	4.20	4.17	4.20	93
長期 (7-)	333	97.25	97.75	11.03	1.76	2.11	2.07	9.82	9.71	9.79	128
長期 (7-11)	185	96.94	97.25	8.66	1.30	1.73	1.71	8.16	8.09	8.16	110
超長期 (11-)	149	97.64	98.37	13.97	2.34	2.56	2.52	11.84	11.70	11.79	150
AAA~BB 格	3,628	99.30	99.60	3.86	1.10	1.22	1.22	3.68	3.65	3.67	95
短期 (1-3)	1,812	99.98	100.26	2.18	1.09	1.06	1.06	2.16	2.14	2.16	90
中期 (3-7)	1,482	98.95	99.20	4.29	0.98	1.24	1.23	4.20	4.17	4.20	93
長期 (7-)	333	97.25	97.75	11.03	1.76	2.11	2.07	9.82	9.71	9.79	128
長期 (7-11)	185	96.94	97.25	8.66	1.30	1.73	1.71	8.16	8.09	8.16	110
超長期 (11-)	149	97.64	98.37	13.97	2.34	2.56	2.52	11.84	11.70	11.79	150
AAA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA 格	288	99.61	99.77	3.38	0.75	0.85	0.85	3.32	3.31	3.32	62
短期 (1-3)	170	99.88	100.05	2.22	0.72	0.77	0.77	2.20	2.19	2.20	62
中期 (3-7)	104	99.39	99.54	4.60	0.78	0.93	0.93	4.52	4.50	4.52	61
長期 (7-)	14	97.97	98.04	8.63	0.94	1.24	1.23	8.30	8.25	8.30	61
長期 (7-11)	14	97.97	98.04	8.63	0.94	1.24	1.23	8.30	8.25	8.30	61
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
A 格	1,854	99.96	100.29	3.75	1.10	1.10	1.10	3.61	3.59	3.61	84
短期 (1-3)	927	100.16	100.48	2.23	1.12	1.00	1.00	2.20	2.19	2.20	85
中期 (3-7)	789	99.43	99.70	4.21	0.95	1.09	1.09	4.12	4.10	4.12	80
長期 (7-)	139	101.67	102.29	11.30	1.84	1.76	1.78	10.05	9.96	10.02	96
長期 (7-11)	77	97.46	97.78	8.83	1.12	1.48	1.47	8.39	8.33	8.39	84
超長期 (11-)	62	106.92	107.93	14.38	2.73	2.08	2.15	11.92	11.79	11.86	111
BBB 格	1,486	98.42	98.71	4.08	1.17	1.46	1.44	3.83	3.80	3.83	116
短期 (1-3)	715	99.76	100.03	2.11	1.13	1.19	1.19	2.09	2.07	2.09	104
中期 (3-7)	590	98.22	98.47	4.35	1.04	1.49	1.47	4.25	4.22	4.25	118
長期 (7-)	181	93.81	94.24	11.00	1.77	2.46	2.38	9.74	9.62	9.71	159
長期 (7-11)	94	96.37	96.70	8.52	1.51	2.01	1.98	7.95	7.87	7.95	139
超長期 (11-)	87	91.05	91.59	13.68	2.05	2.96	2.83	11.78	11.61	11.73	183
BB 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
B 格以下	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
格付なし	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
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 (2024年3月末)

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
AAA~AA 格	30	100.64	100.94	2.27	1.37	1.09	1.09	2.23	2.22	2.23	93
短期 (1-3)	30	100.64	100.94	2.27	1.37	1.09	1.09	2.23	2.22	2.23	93
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AAA~A 格	863	99.23	99.57	3.26	1.26	1.35	1.35	3.18	3.16	3.18	112
短期 (1-3)	413	100.15	100.58	2.02	1.56	1.35	1.35	1.99	1.98	1.99	120
中期 (3-7)	421	98.63	98.89	4.12	0.98	1.34	1.33	4.03	4.00	4.03	105
長期 (7-)	29	94.94	95.18	8.60	0.96	1.65	1.61	8.24	8.17	8.24	100
長期 (7-11)	29	94.94	95.18	8.60	0.96	1.65	1.61	8.24	8.17	8.24	100
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AAA~BBB 格	874	99.09	99.43	3.39	1.26	1.37	1.36	3.28	3.25	3.28	112
短期 (1-3)	413	100.15	100.58	2.02	1.56	1.35	1.35	1.99	1.98	1.99	120
中期 (3-7)	421	98.63	98.89	4.12	0.98	1.34	1.33	4.03	4.00	4.03	105
長期 (7-)	41	93.11	93.40	9.76	1.06	1.88	1.81	9.14	9.05	9.13	111
長期 (7-11)	29	94.94	95.18	8.60	0.96	1.65	1.61	8.24	8.17	8.24	100
超長期 (11-)	11	88.46	88.86	12.70	1.32	2.52	2.38	11.60	11.47	11.58	143
AAA~BB 格	874	99.09	99.43	3.39	1.26	1.37	1.36	3.28	3.25	3.28	112
短期 (1-3)	413	100.15	100.58	2.02	1.56	1.35	1.35	1.99	1.98	1.99	120
中期 (3-7)	421	98.63	98.89	4.12	0.98	1.34	1.33	4.03	4.00	4.03	105
長期 (7-)	41	93.11	93.40	9.76	1.06	1.88	1.81	9.14	9.05	9.13	111
長期 (7-11)	29	94.94	95.18	8.60	0.96	1.65	1.61	8.24	8.17	8.24	100
超長期 (11-)	11	88.46	88.86	12.70	1.32	2.52	2.38	11.60	11.47	11.58	143
AAA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA 格	30	100.64	100.94	2.27	1.37	1.09	1.09	2.23	2.22	2.23	93
短期 (1-3)	30	100.64	100.94	2.27	1.37	1.09	1.09	2.23	2.22	2.23	93
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
A 格	833	99.18	99.52	3.30	1.25	1.36	1.36	3.21	3.19	3.21	113
短期 (1-3)	383	100.12	100.55	2.00	1.58	1.37	1.37	1.97	1.96	1.97	122
中期 (3-7)	421	98.63	98.89	4.12	0.98	1.34	1.33	4.03	4.00	4.03	105
長期 (7-)	29	94.94	95.18	8.60	0.96	1.65	1.61	8.24	8.17	8.24	100
長期 (7-11)	29	94.94	95.18	8.60	0.96	1.65	1.61	8.24	8.17	8.24	100
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
BBB 格	11	88.46	88.86	12.70	1.32	2.52	2.38	11.60	11.47	11.58	143
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	11	88.46	88.86	12.70	1.32	2.52	2.38	11.60	11.47	11.58	143
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	11	88.46	88.86	12.70	1.32	2.52	2.38	11.60	11.47	11.58	143
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	2,778	99.38	99.66	3.98	1.05	1.18	1.17	3.78	3.75	3.78	89
短期 (1-3)	1,371	99.96	100.20	2.18	0.95	0.97	0.97	2.15	2.14	2.15	81
中期 (3-7)	1,114	99.07	99.33	4.30	0.96	1.19	1.18	4.21	4.18	4.21	89
長期 (7-)	293	97.82	98.35	11.20	1.86	2.13	2.11	9.90	9.80	9.87	130
長期 (7-11)	156	97.32	97.63	8.67	1.37	1.75	1.73	8.15	8.08	8.14	112
超長期 (11-)	137	98.40	99.16	14.08	2.42	2.57	2.53	11.86	11.71	11.80	151

出所:NFRC

- 格付は、R&I の格付をもとに NFRC で分類

円建外債 R&I 格付別・ポートフォリオ指標 (2024年3月末、4月ポートフォリオ)

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
AAA~AA 格	30	100.64	100.94	2.27	1.37	1.09	1.09	2.23	2.22	2.23	93
短期 (1-3)	30	100.64	100.94	2.27	1.37	1.09	1.09	2.23	2.22	2.23	93
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AAA~A 格	863	99.23	99.57	3.26	1.26	1.35	1.35	3.18	3.16	3.18	112
短期 (1-3)	413	100.15	100.58	2.02	1.56	1.35	1.35	1.99	1.98	1.99	120
中期 (3-7)	421	98.63	98.89	4.12	0.98	1.34	1.33	4.03	4.00	4.03	105
長期 (7-)	29	94.94	95.18	8.60	0.96	1.65	1.61	8.24	8.17	8.24	100
長期 (7-11)	29	94.94	95.18	8.60	0.96	1.65	1.61	8.24	8.17	8.24	100
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AAA~BBB 格	874	99.09	99.43	3.39	1.26	1.37	1.36	3.28	3.25	3.28	112
短期 (1-3)	413	100.15	100.58	2.02	1.56	1.35	1.35	1.99	1.98	1.99	120
中期 (3-7)	421	98.63	98.89	4.12	0.98	1.34	1.33	4.03	4.00	4.03	105
長期 (7-)	41	93.11	93.40	9.76	1.06	1.88	1.81	9.14	9.05	9.13	111
長期 (7-11)	29	94.94	95.18	8.60	0.96	1.65	1.61	8.24	8.17	8.24	100
超長期 (11-)	11	88.46	88.86	12.70	1.32	2.52	2.38	11.60	11.47	11.58	143
AAA~BB 格	874	99.09	99.43	3.39	1.26	1.37	1.36	3.28	3.25	3.28	112
短期 (1-3)	413	100.15	100.58	2.02	1.56	1.35	1.35	1.99	1.98	1.99	120
中期 (3-7)	421	98.63	98.89	4.12	0.98	1.34	1.33	4.03	4.00	4.03	105
長期 (7-)	41	93.11	93.40	9.76	1.06	1.88	1.81	9.14	9.05	9.13	111
長期 (7-11)	29	94.94	95.18	8.60	0.96	1.65	1.61	8.24	8.17	8.24	100
超長期 (11-)	11	88.46	88.86	12.70	1.32	2.52	2.38	11.60	11.47	11.58	143
AAA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA 格	30	100.64	100.94	2.27	1.37	1.09	1.09	2.23	2.22	2.23	93
短期 (1-3)	30	100.64	100.94	2.27	1.37	1.09	1.09	2.23	2.22	2.23	93
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
A 格	833	99.18	99.52	3.30	1.25	1.36	1.36	3.21	3.19	3.21	113
短期 (1-3)	383	100.12	100.55	2.00	1.58	1.37	1.37	1.97	1.96	1.97	122
中期 (3-7)	421	98.63	98.89	4.12	0.98	1.34	1.33	4.03	4.00	4.03	105
長期 (7-)	29	94.94	95.18	8.60	0.96	1.65	1.61	8.24	8.17	8.24	100
長期 (7-11)	29	94.94	95.18	8.60	0.96	1.65	1.61	8.24	8.17	8.24	100
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
BBB 格	11	88.46	88.86	12.70	1.32	2.52	2.38	11.60	11.47	11.58	143
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	11	88.46	88.86	12.70	1.32	2.52	2.38	11.60	11.47	11.58	143
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	11	88.46	88.86	12.70	1.32	2.52	2.38	11.60	11.47	11.58	143
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	2,754	99.37	99.65	4.01	1.06	1.18	1.17	3.80	3.78	3.80	89
短期 (1-3)	1,399	99.92	100.17	2.23	0.95	0.97	0.97	2.20	2.19	2.20	81
中期 (3-7)	1,062	99.07	99.32	4.36	0.97	1.19	1.19	4.26	4.24	4.26	89
長期 (7-)	293	97.82	98.35	11.20	1.86	2.13	2.11	9.90	9.80	9.87	130
長期 (7-11)	156	97.32	97.63	8.67	1.37	1.75	1.73	8.15	8.08	8.14	112
超長期 (11-)	137	98.40	99.16	14.08	2.42	2.57	2.53	11.86	11.71	11.80	151

出所:NFRC

- 格付は、R&Iの格付をもとに NFRC で分類

円建外債 JCR 格付別・ポートフォリオ指標 (2024年3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	260	99.69	99.91	3.69	1.03	1.07	1.07	3.56	3.54	3.56	81
短期 (1-3)	165	100.10	100.29	2.56	0.94	0.92	0.92	2.53	2.52	2.53	74
中期 (3-7)	73	99.63	99.92	4.51	1.12	1.20	1.20	4.39	4.37	4.39	90
長期 (7-)	22	96.80	97.06	9.39	1.36	1.77	1.74	8.66	8.58	8.64	108
長期 (7-11)	18	97.05	97.28	8.19	1.21	1.63	1.61	7.79	7.73	7.79	104
超長期 (11-)	4	95.75	96.14	14.51	1.99	2.38	2.34	12.43	12.29	12.37	128
AAA~A 格	1,105	99.44	99.84	4.50	1.47	1.48	1.47	4.15	4.11	4.14	116
短期 (1-3)	580	100.46	100.85	2.22	1.51	1.24	1.24	2.19	2.17	2.19	108
中期 (3-7)	340	98.49	98.76	4.22	1.05	1.41	1.40	4.12	4.09	4.12	111
長期 (7-)	186	98.00	98.63	12.12	2.14	2.39	2.36	10.49	10.36	10.45	148
長期 (7-11)	73	96.88	97.18	8.76	1.62	2.05	2.02	8.14	8.05	8.13	141
超長期 (11-)	113	98.73	99.56	14.28	2.48	2.60	2.57	11.96	11.81	11.90	153
AAA~BBB 格	1,106	99.44	99.83	4.50	1.47	1.48	1.47	4.15	4.12	4.14	116
短期 (1-3)	580	100.46	100.85	2.22	1.51	1.24	1.24	2.19	2.17	2.19	108
中期 (3-7)	341	98.48	98.75	4.23	1.05	1.41	1.40	4.12	4.09	4.12	111
長期 (7-)	186	98.00	98.63	12.12	2.14	2.39	2.36	10.49	10.36	10.45	148
長期 (7-11)	73	96.88	97.18	8.76	1.62	2.05	2.02	8.14	8.05	8.13	141
超長期 (11-)	113	98.73	99.56	14.28	2.48	2.60	2.57	11.96	11.81	11.90	153
AAA~BB 格	1,106	99.44	99.83	4.50	1.47	1.48	1.47	4.15	4.12	4.14	116
短期 (1-3)	580	100.46	100.85	2.22	1.51	1.24	1.24	2.19	2.17	2.19	108
中期 (3-7)	341	98.48	98.75	4.23	1.05	1.41	1.40	4.12	4.09	4.12	111
長期 (7-)	186	98.00	98.63	12.12	2.14	2.39	2.36	10.49	10.36	10.45	148
長期 (7-11)	73	96.88	97.18	8.76	1.62	2.05	2.02	8.14	8.05	8.13	141
超長期 (11-)	113	98.73	99.56	14.28	2.48	2.60	2.57	11.96	11.81	11.90	153
AAA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA 格	260	99.69	99.91	3.69	1.03	1.07	1.07	3.56	3.54	3.56	81
短期 (1-3)	165	100.10	100.29	2.56	0.94	0.92	0.92	2.53	2.52	2.53	74
中期 (3-7)	73	99.63	99.92	4.51	1.12	1.20	1.20	4.39	4.37	4.39	90
長期 (7-)	22	96.80	97.06	9.39	1.36	1.77	1.74	8.66	8.58	8.64	108
長期 (7-11)	18	97.05	97.28	8.19	1.21	1.63	1.61	7.79	7.73	7.79	104
超長期 (11-)	4	95.75	96.14	14.51	1.99	2.38	2.34	12.43	12.29	12.37	128
A 格	845	99.37	99.82	4.75	1.61	1.61	1.60	4.33	4.29	4.32	126
短期 (1-3)	415	100.60	101.07	2.09	1.73	1.36	1.36	2.05	2.04	2.05	122
中期 (3-7)	267	98.19	98.45	4.14	1.03	1.46	1.45	4.04	4.01	4.04	117
長期 (7-)	163	98.17	98.85	12.49	2.25	2.48	2.44	10.73	10.60	10.69	154
長期 (7-11)	55	96.82	97.15	8.95	1.75	2.20	2.16	8.25	8.16	8.24	153
超長期 (11-)	109	98.84	99.70	14.27	2.50	2.61	2.58	11.94	11.79	11.88	154
BBB 格	1	93.49	93.52	5.48	1.05	2.39	2.32	5.33	5.27	5.33	196
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	1	93.49	93.52	5.48	1.05	2.39	2.32	5.33	5.27	5.33	196
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	2,546	99.25	99.50	3.55	0.94	1.11	1.10	3.45	3.42	3.44	86
短期 (1-3)	1,204	99.78	100.02	2.10	0.90	0.97	0.97	2.08	2.07	2.08	82
中期 (3-7)	1,194	99.08	99.34	4.26	0.95	1.18	1.17	4.17	4.14	4.17	88
長期 (7-)	148	96.31	96.63	9.66	1.29	1.74	1.71	8.96	8.88	8.94	102
長期 (7-11)	112	96.98	97.29	8.59	1.10	1.53	1.51	8.18	8.12	8.18	90
超長期 (11-)	36	94.18	94.58	13.00	1.87	2.42	2.36	11.46	11.33	11.43	140

出所:NFRC

- 格付は、JCR の格付をもとに NFRC で分類

円建外債 JCR 格付別・ポートフォリオ指標 (2024年3月末、4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	260	99.69	99.91	3.69	1.03	1.07	1.07	3.56	3.54	3.56	81
短期 (1-3)	165	100.10	100.29	2.56	0.94	0.92	0.92	2.53	2.52	2.53	74
中期 (3-7)	73	99.63	99.92	4.51	1.12	1.20	1.20	4.39	4.37	4.39	90
長期 (7-)	22	96.80	97.06	9.39	1.36	1.77	1.74	8.66	8.58	8.64	108
長期 (7-11)	18	97.05	97.28	8.19	1.21	1.63	1.61	7.79	7.73	7.79	104
超長期 (11-)	4	95.75	96.14	14.51	1.99	2.38	2.34	12.43	12.29	12.37	128
AAA~A 格	1,081	99.44	99.83	4.58	1.49	1.49	1.48	4.22	4.18	4.21	116
短期 (1-3)	608	100.36	100.75	2.34	1.47	1.23	1.23	2.30	2.29	2.30	107
中期 (3-7)	288	98.40	98.66	4.43	1.10	1.46	1.45	4.32	4.29	4.32	115
長期 (7-)	186	98.00	98.63	12.12	2.14	2.39	2.36	10.49	10.36	10.45	148
長期 (7-11)	73	96.88	97.18	8.76	1.62	2.05	2.02	8.14	8.05	8.13	141
超長期 (11-)	113	98.73	99.56	14.28	2.48	2.60	2.57	11.96	11.81	11.90	153
AAA~BBB 格	1,082	99.43	99.82	4.58	1.49	1.49	1.48	4.22	4.18	4.21	116
短期 (1-3)	608	100.36	100.75	2.34	1.47	1.23	1.23	2.30	2.29	2.30	107
中期 (3-7)	289	98.38	98.64	4.43	1.10	1.47	1.46	4.32	4.29	4.32	115
長期 (7-)	186	98.00	98.63	12.12	2.14	2.39	2.36	10.49	10.36	10.45	148
長期 (7-11)	73	96.88	97.18	8.76	1.62	2.05	2.02	8.14	8.05	8.13	141
超長期 (11-)	113	98.73	99.56	14.28	2.48	2.60	2.57	11.96	11.81	11.90	153
AAA~BB 格	1,082	99.43	99.82	4.58	1.49	1.49	1.48	4.22	4.18	4.21	116
短期 (1-3)	608	100.36	100.75	2.34	1.47	1.23	1.23	2.30	2.29	2.30	107
中期 (3-7)	289	98.38	98.64	4.43	1.10	1.47	1.46	4.32	4.29	4.32	115
長期 (7-)	186	98.00	98.63	12.12	2.14	2.39	2.36	10.49	10.36	10.45	148
長期 (7-11)	73	96.88	97.18	8.76	1.62	2.05	2.02	8.14	8.05	8.13	141
超長期 (11-)	113	98.73	99.56	14.28	2.48	2.60	2.57	11.96	11.81	11.90	153
AAA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA 格	260	99.69	99.91	3.69	1.03	1.07	1.07	3.56	3.54	3.56	81
短期 (1-3)	165	100.10	100.29	2.56	0.94	0.92	0.92	2.53	2.52	2.53	74
中期 (3-7)	73	99.63	99.92	4.51	1.12	1.20	1.20	4.39	4.37	4.39	90
長期 (7-)	22	96.80	97.06	9.39	1.36	1.77	1.74	8.66	8.58	8.64	108
長期 (7-11)	18	97.05	97.28	8.19	1.21	1.63	1.61	7.79	7.73	7.79	104
超長期 (11-)	4	95.75	96.14	14.51	1.99	2.38	2.34	12.43	12.29	12.37	128
A 格	821	99.35	99.80	4.86	1.63	1.62	1.61	4.43	4.39	4.42	127
短期 (1-3)	443	100.46	100.92	2.26	1.66	1.35	1.35	2.22	2.20	2.22	119
中期 (3-7)	215	97.98	98.23	4.41	1.10	1.55	1.54	4.29	4.26	4.29	124
長期 (7-)	163	98.17	98.85	12.49	2.25	2.48	2.44	10.73	10.60	10.69	154
長期 (7-11)	55	96.82	97.15	8.95	1.75	2.20	2.16	8.25	8.16	8.24	153
超長期 (11-)	109	98.84	99.70	14.27	2.50	2.61	2.58	11.94	11.79	11.88	154
BBB 格	1	93.49	93.52	5.48	1.05	2.39	2.32	5.33	5.27	5.33	196
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	1	93.49	93.52	5.48	1.05	2.39	2.32	5.33	5.27	5.33	196
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	2,546	99.25	99.50	3.55	0.94	1.11	1.10	3.45	3.42	3.44	86
短期 (1-3)	1,204	99.78	100.02	2.10	0.90	0.97	0.97	2.08	2.07	2.08	82
中期 (3-7)	1,194	99.08	99.34	4.26	0.95	1.18	1.17	4.17	4.14	4.17	88
長期 (7-)	148	96.31	96.63	9.66	1.29	1.74	1.71	8.96	8.88	8.94	102
長期 (7-11)	112	96.98	97.29	8.59	1.10	1.53	1.51	8.18	8.12	8.18	90
超長期 (11-)	36	94.18	94.58	13.00	1.87	2.42	2.36	11.46	11.33	11.43	140

出所:NFRC

- 格付は、JCR の格付をもとに NFRC で分類

円建外債 Moody's 格付別・ポートフォリオ指標 (2024年3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	1,189	99.56	99.78	3.54	0.78	0.90	0.90	3.47	3.45	3.47	65
短期 (1-3)	580	99.73	99.93	2.22	0.64	0.76	0.75	2.20	2.19	2.20	60
中期 (3-7)	553	99.55	99.79	4.40	0.90	1.00	1.00	4.31	4.29	4.31	70
長期 (7-)	56	97.92	98.18	8.83	1.07	1.37	1.36	8.41	8.36	8.41	73
長期 (7-11)	56	97.92	98.18	8.83	1.07	1.37	1.36	8.41	8.36	8.41	73
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AAA~A 格	2,156	99.81	100.08	3.81	0.97	1.04	1.04	3.68	3.66	3.67	77
短期 (1-3)	1,057	100.00	100.25	2.28	0.87	0.87	0.87	2.26	2.25	2.26	71
中期 (3-7)	932	99.35	99.61	4.25	0.93	1.09	1.09	4.16	4.14	4.16	80
長期 (7-)	168	101.15	101.69	11.02	1.79	1.77	1.78	9.86	9.77	9.83	98
長期 (7-11)	96	97.35	97.64	8.82	1.10	1.47	1.45	8.40	8.34	8.39	83
超長期 (11-)	72	106.25	107.13	13.98	2.72	2.13	2.18	11.66	11.53	11.60	117
AAA~BBB 格	3,261	99.30	99.57	4.01	1.02	1.16	1.15	3.82	3.79	3.82	87
短期 (1-3)	1,498	99.96	100.20	2.21	0.90	0.91	0.91	2.19	2.18	2.19	76
中期 (3-7)	1,437	99.06	99.31	4.28	0.97	1.20	1.19	4.18	4.16	4.18	90
長期 (7-)	326	97.34	97.84	11.10	1.78	2.11	2.07	9.87	9.76	9.84	127
長期 (7-11)	177	97.09	97.40	8.69	1.31	1.72	1.70	8.19	8.12	8.18	108
超長期 (11-)	149	97.64	98.37	13.97	2.34	2.56	2.52	11.84	11.70	11.79	150
AAA~BB 格	3,261	99.30	99.57	4.01	1.02	1.16	1.15	3.82	3.79	3.82	87
短期 (1-3)	1,498	99.96	100.20	2.21	0.90	0.91	0.91	2.19	2.18	2.19	76
中期 (3-7)	1,437	99.06	99.31	4.28	0.97	1.20	1.19	4.18	4.16	4.18	90
長期 (7-)	326	97.34	97.84	11.10	1.78	2.11	2.07	9.87	9.76	9.84	127
長期 (7-11)	177	97.09	97.40	8.69	1.31	1.72	1.70	8.19	8.12	8.18	108
超長期 (11-)	149	97.64	98.37	13.97	2.34	2.56	2.52	11.84	11.70	11.79	150
AAA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA 格	1,189	99.56	99.78	3.54	0.78	0.90	0.90	3.47	3.45	3.47	65
短期 (1-3)	580	99.73	99.93	2.22	0.64	0.76	0.75	2.20	2.19	2.20	60
中期 (3-7)	553	99.55	99.79	4.40	0.90	1.00	1.00	4.31	4.29	4.31	70
長期 (7-)	56	97.92	98.18	8.83	1.07	1.37	1.36	8.41	8.36	8.41	73
長期 (7-11)	56	97.92	98.18	8.83	1.07	1.37	1.36	8.41	8.36	8.41	73
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
A 格	967	100.12	100.45	4.14	1.21	1.21	1.21	3.93	3.90	3.92	91
短期 (1-3)	477	100.33	100.63	2.36	1.16	1.02	1.02	2.33	2.32	2.33	85
中期 (3-7)	379	99.06	99.34	4.02	0.99	1.22	1.21	3.93	3.91	3.93	94
長期 (7-)	112	102.76	103.44	12.12	2.15	1.95	1.98	10.55	10.44	10.51	110
長期 (7-11)	40	96.55	96.88	8.82	1.13	1.61	1.59	8.37	8.31	8.37	96
超長期 (11-)	72	106.25	107.13	13.98	2.72	2.13	2.18	11.66	11.53	11.60	117
BBB 格	1,104	98.30	98.57	4.40	1.11	1.39	1.37	4.10	4.07	4.10	107
短期 (1-3)	442	99.86	100.08	2.06	0.96	1.01	1.01	2.03	2.02	2.03	86
中期 (3-7)	505	98.51	98.76	4.33	1.03	1.40	1.39	4.23	4.20	4.23	109
長期 (7-)	157	93.27	93.74	11.19	1.76	2.50	2.41	9.87	9.75	9.84	161
長期 (7-11)	80	96.77	97.12	8.53	1.56	2.02	1.99	7.94	7.86	7.93	139
超長期 (11-)	77	89.61	90.21	13.97	1.97	3.04	2.89	12.04	11.87	11.99	186
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	391	99.38	99.86	2.40	1.81	1.78	1.78	2.33	2.31	2.33	161
短期 (1-3)	286	100.22	100.77	1.75	2.11	1.80	1.80	1.72	1.70	1.72	167
中期 (3-7)	97	97.36	97.66	3.87	0.98	1.72	1.70	3.79	3.76	3.79	143
長期 (7-)	8	93.63	93.74	7.91	1.15	2.09	2.03	7.56	7.49	7.56	148
長期 (7-11)	8	93.63	93.74	7.91	1.15	2.09	2.03	7.56	7.49	7.56	148
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

出所:NFRC

- 格付は、Moody's の格付をもとに NFRC で分類

円建外債 Moody's 格付別・ポートフォリオ指標 (2024年3月末、4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	1,189	99.56	99.78	3.54	0.78	0.90	0.90	3.47	3.45	3.47	65
短期 (1-3)	580	99.73	99.93	2.22	0.64	0.76	0.75	2.20	2.19	2.20	60
中期 (3-7)	553	99.55	99.79	4.40	0.90	1.00	1.00	4.31	4.29	4.31	70
長期 (7-)	56	97.92	98.18	8.83	1.07	1.37	1.36	8.41	8.36	8.41	73
長期 (7-11)	56	97.92	98.18	8.83	1.07	1.37	1.36	8.41	8.36	8.41	73
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AAA~A 格	2,156	99.81	100.08	3.81	0.97	1.04	1.04	3.68	3.66	3.67	77
短期 (1-3)	1,057	100.00	100.25	2.28	0.87	0.87	0.87	2.26	2.25	2.26	71
中期 (3-7)	932	99.35	99.61	4.25	0.93	1.09	1.09	4.16	4.14	4.16	80
長期 (7-)	168	101.15	101.69	11.02	1.79	1.77	1.78	9.86	9.77	9.83	98
長期 (7-11)	96	97.35	97.64	8.82	1.10	1.47	1.45	8.40	8.34	8.39	83
超長期 (11-)	72	106.25	107.13	13.98	2.72	2.13	2.18	11.66	11.53	11.60	117
AAA~BBB 格	3,237	99.30	99.57	4.03	1.02	1.16	1.15	3.84	3.81	3.84	87
短期 (1-3)	1,526	99.93	100.17	2.26	0.90	0.92	0.92	2.24	2.23	2.24	76
中期 (3-7)	1,385	99.06	99.31	4.32	0.98	1.20	1.20	4.23	4.20	4.23	90
長期 (7-)	326	97.34	97.84	11.10	1.78	2.11	2.07	9.87	9.76	9.84	127
長期 (7-11)	177	97.09	97.40	8.69	1.31	1.72	1.70	8.19	8.12	8.18	108
超長期 (11-)	149	97.64	98.37	13.97	2.34	2.56	2.52	11.84	11.70	11.79	150
AAA~BB 格	3,237	99.30	99.57	4.03	1.02	1.16	1.15	3.84	3.81	3.84	87
短期 (1-3)	1,526	99.93	100.17	2.26	0.90	0.92	0.92	2.24	2.23	2.24	76
中期 (3-7)	1,385	99.06	99.31	4.32	0.98	1.20	1.20	4.23	4.20	4.23	90
長期 (7-)	326	97.34	97.84	11.10	1.78	2.11	2.07	9.87	9.76	9.84	127
長期 (7-11)	177	97.09	97.40	8.69	1.31	1.72	1.70	8.19	8.12	8.18	108
超長期 (11-)	149	97.64	98.37	13.97	2.34	2.56	2.52	11.84	11.70	11.79	150
AAA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA 格	1,189	99.56	99.78	3.54	0.78	0.90	0.90	3.47	3.45	3.47	65
短期 (1-3)	580	99.73	99.93	2.22	0.64	0.76	0.75	2.20	2.19	2.20	60
中期 (3-7)	553	99.55	99.79	4.40	0.90	1.00	1.00	4.31	4.29	4.31	70
長期 (7-)	56	97.92	98.18	8.83	1.07	1.37	1.36	8.41	8.36	8.41	73
長期 (7-11)	56	97.92	98.18	8.83	1.07	1.37	1.36	8.41	8.36	8.41	73
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
A 格	967	100.12	100.45	4.14	1.21	1.21	1.21	3.93	3.90	3.92	91
短期 (1-3)	477	100.33	100.63	2.36	1.16	1.02	1.02	2.33	2.32	2.33	85
中期 (3-7)	379	99.06	99.34	4.02	0.99	1.22	1.21	3.93	3.91	3.93	94
長期 (7-)	112	102.76	103.44	12.12	2.15	1.95	1.98	10.55	10.44	10.51	110
長期 (7-11)	40	96.55	96.88	8.82	1.13	1.61	1.59	8.37	8.31	8.37	96
超長期 (11-)	72	106.25	107.13	13.98	2.72	2.13	2.18	11.66	11.53	11.60	117
BBB 格	1,080	98.27	98.54	4.47	1.11	1.40	1.38	4.17	4.14	4.17	107
短期 (1-3)	469	99.77	100.00	2.22	0.94	1.02	1.02	2.19	2.18	2.19	86
中期 (3-7)	453	98.45	98.69	4.48	1.07	1.43	1.42	4.37	4.34	4.37	112
長期 (7-)	157	93.27	93.74	11.19	1.76	2.50	2.41	9.87	9.75	9.84	161
長期 (7-11)	80	96.77	97.12	8.53	1.56	2.02	1.99	7.94	7.86	7.93	139
超長期 (11-)	77	89.61	90.21	13.97	1.97	3.04	2.89	12.04	11.87	11.99	186
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	391	99.38	99.86	2.40	1.81	1.78	1.78	2.33	2.31	2.33	161
短期 (1-3)	286	100.22	100.77	1.75	2.11	1.80	1.80	1.72	1.70	1.72	167
中期 (3-7)	97	97.36	97.66	3.87	0.98	1.72	1.70	3.79	3.76	3.79	143
長期 (7-)	8	93.63	93.74	7.91	1.15	2.09	2.03	7.56	7.49	7.56	148
長期 (7-11)	8	93.63	93.74	7.91	1.15	2.09	2.03	7.56	7.49	7.56	148
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

出所:NFRC

- 格付は、Moody's の格付をもとに NFRC で分類

円建外債 S&P 格付別・ポートフォリオ指標 (2024年3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	240	99.60	99.73	3.64	0.73	0.82	0.81	3.57	3.55	3.57	56
短期 (1-3)	129	99.94	100.07	2.32	0.69	0.72	0.72	2.30	2.30	2.30	55
中期 (3-7)	98	99.39	99.51	4.67	0.74	0.89	0.89	4.59	4.57	4.59	57
長期 (7-)	14	97.97	98.04	8.63	0.94	1.24	1.23	8.30	8.25	8.30	61
長期 (7-11)	14	97.97	98.04	8.63	0.94	1.24	1.23	8.30	8.25	8.30	61
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AAA~A 格	2,041	99.81	100.08	3.83	0.95	1.02	1.02	3.70	3.68	3.70	75
短期 (1-3)	974	99.98	100.22	2.33	0.84	0.86	0.86	2.31	2.30	2.31	69
中期 (3-7)	917	99.36	99.61	4.24	0.93	1.08	1.08	4.15	4.13	4.15	79
長期 (7-)	150	101.45	102.03	11.11	1.78	1.72	1.74	9.93	9.84	9.90	93
長期 (7-11)	88	97.64	97.92	8.83	1.11	1.45	1.43	8.40	8.34	8.39	80
超長期 (11-)	62	106.92	107.93	14.38	2.73	2.08	2.15	11.92	11.79	11.86	111
AAA~BBB 格	3,490	99.25	99.53	3.93	1.04	1.20	1.19	3.75	3.72	3.74	92
短期 (1-3)	1,637	99.92	100.17	2.19	0.96	0.99	0.99	2.17	2.15	2.17	83
中期 (3-7)	1,522	98.95	99.21	4.25	0.97	1.23	1.22	4.16	4.13	4.16	93
長期 (7-)	331	97.28	97.77	11.05	1.77	2.11	2.08	9.83	9.72	9.80	128
長期 (7-11)	182	96.98	97.29	8.67	1.31	1.74	1.71	8.17	8.10	8.16	110
超長期 (11-)	149	97.64	98.37	13.97	2.34	2.56	2.52	11.84	11.70	11.79	150
AAA~BB 格	3,490	99.25	99.53	3.93	1.04	1.20	1.19	3.75	3.72	3.74	92
短期 (1-3)	1,637	99.92	100.17	2.19	0.96	0.99	0.99	2.17	2.15	2.17	83
中期 (3-7)	1,522	98.95	99.21	4.25	0.97	1.23	1.22	4.16	4.13	4.16	93
長期 (7-)	331	97.28	97.77	11.05	1.77	2.11	2.08	9.83	9.72	9.80	128
長期 (7-11)	182	96.98	97.29	8.67	1.31	1.74	1.71	8.17	8.10	8.16	110
超長期 (11-)	149	97.64	98.37	13.97	2.34	2.56	2.52	11.84	11.70	11.79	150
AAA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA 格	240	99.60	99.73	3.64	0.73	0.82	0.81	3.57	3.55	3.57	56
短期 (1-3)	129	99.94	100.07	2.32	0.69	0.72	0.72	2.30	2.30	2.30	55
中期 (3-7)	98	99.39	99.51	4.67	0.74	0.89	0.89	4.59	4.57	4.59	57
長期 (7-)	14	97.97	98.04	8.63	0.94	1.24	1.23	8.30	8.25	8.30	61
長期 (7-11)	14	97.97	98.04	8.63	0.94	1.24	1.23	8.30	8.25	8.30	61
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
A 格	1,801	99.84	100.13	3.86	0.98	1.05	1.05	3.72	3.70	3.72	78
短期 (1-3)	845	99.99	100.24	2.33	0.86	0.88	0.88	2.31	2.30	2.31	71
中期 (3-7)	820	99.36	99.62	4.18	0.95	1.11	1.10	4.10	4.07	4.10	82
長期 (7-)	136	101.80	102.44	11.36	1.86	1.77	1.79	10.08	9.99	10.05	97
長期 (7-11)	75	97.58	97.90	8.86	1.14	1.48	1.47	8.41	8.35	8.41	84
超長期 (11-)	62	106.92	107.93	14.38	2.73	2.08	2.15	11.92	11.79	11.86	111
BBB 格	1,449	98.45	98.75	4.06	1.17	1.45	1.43	3.81	3.77	3.80	115
短期 (1-3)	663	99.83	100.11	1.98	1.14	1.18	1.18	1.96	1.94	1.96	104
中期 (3-7)	605	98.33	98.60	4.27	1.03	1.45	1.44	4.17	4.14	4.17	115
長期 (7-)	181	93.81	94.24	11.00	1.77	2.46	2.38	9.74	9.62	9.71	159
長期 (7-11)	94	96.37	96.70	8.52	1.51	2.01	1.98	7.95	7.87	7.95	139
超長期 (11-)	87	91.05	91.59	13.68	2.05	2.96	2.83	11.78	11.61	11.73	183
BB 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
B 格以下	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
格付なし	162	100.60	101.25	1.90	2.42	1.76	1.76	1.84	1.83	1.84	163
短期 (1-3)	147	100.91	101.59	1.60	2.57	1.80	1.80	1.57	1.55	1.57	169
中期 (3-7)	13	98.28	98.68	4.32	0.97	1.35	1.34	4.22	4.20	4.22	105
長期 (7-)	2	93.47	93.55	7.85	0.51	1.44	1.39	7.70	7.64	7.70	85
長期 (7-11)	2	93.47	93.55	7.85	0.51	1.44	1.39	7.70	7.64	7.70	85
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

出所:NFRC

- 格付は、S&P の格付をもとに NFRC で分類

円建外債 S&P 格付別・ポートフォリオ指標 (2024年3月末、4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	240	99.60	99.73	3.64	0.73	0.82	0.81	3.57	3.55	3.57	56
短期 (1-3)	129	99.94	100.07	2.32	0.69	0.72	0.72	2.30	2.30	2.30	55
中期 (3-7)	98	99.39	99.51	4.67	0.74	0.89	0.89	4.59	4.57	4.59	57
長期 (7-)	14	97.97	98.04	8.63	0.94	1.24	1.23	8.30	8.25	8.30	61
長期 (7-11)	14	97.97	98.04	8.63	0.94	1.24	1.23	8.30	8.25	8.30	61
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AAA~A 格	2,041	99.81	100.08	3.83	0.95	1.02	1.02	3.70	3.68	3.70	75
短期 (1-3)	974	99.98	100.22	2.33	0.84	0.86	0.86	2.31	2.30	2.31	69
中期 (3-7)	917	99.36	99.61	4.24	0.93	1.08	1.08	4.15	4.13	4.15	79
長期 (7-)	150	101.45	102.03	11.11	1.78	1.72	1.74	9.93	9.84	9.90	93
長期 (7-11)	88	97.64	97.92	8.83	1.11	1.45	1.43	8.40	8.34	8.39	80
超長期 (11-)	62	106.92	107.93	14.38	2.73	2.08	2.15	11.92	11.79	11.86	111
AAA~BBB 格	3,466	99.24	99.52	3.95	1.04	1.20	1.19	3.76	3.74	3.76	92
短期 (1-3)	1,665	99.89	100.15	2.23	0.96	0.99	0.99	2.21	2.20	2.21	83
中期 (3-7)	1,470	98.95	99.21	4.29	0.98	1.23	1.23	4.20	4.17	4.20	93
長期 (7-)	331	97.28	97.77	11.05	1.77	2.11	2.08	9.83	9.72	9.80	128
長期 (7-11)	182	96.98	97.29	8.67	1.31	1.74	1.71	8.17	8.10	8.16	110
超長期 (11-)	149	97.64	98.37	13.97	2.34	2.56	2.52	11.84	11.70	11.79	150
AAA~BB 格	3,466	99.24	99.52	3.95	1.04	1.20	1.19	3.76	3.74	3.76	92
短期 (1-3)	1,665	99.89	100.15	2.23	0.96	0.99	0.99	2.21	2.20	2.21	83
中期 (3-7)	1,470	98.95	99.21	4.29	0.98	1.23	1.23	4.20	4.17	4.20	93
長期 (7-)	331	97.28	97.77	11.05	1.77	2.11	2.08	9.83	9.72	9.80	128
長期 (7-11)	182	96.98	97.29	8.67	1.31	1.74	1.71	8.17	8.10	8.16	110
超長期 (11-)	149	97.64	98.37	13.97	2.34	2.56	2.52	11.84	11.70	11.79	150
AAA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA 格	240	99.60	99.73	3.64	0.73	0.82	0.81	3.57	3.55	3.57	56
短期 (1-3)	129	99.94	100.07	2.32	0.69	0.72	0.72	2.30	2.30	2.30	55
中期 (3-7)	98	99.39	99.51	4.67	0.74	0.89	0.89	4.59	4.57	4.59	57
長期 (7-)	14	97.97	98.04	8.63	0.94	1.24	1.23	8.30	8.25	8.30	61
長期 (7-11)	14	97.97	98.04	8.63	0.94	1.24	1.23	8.30	8.25	8.30	61
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
A 格	1,801	99.84	100.13	3.86	0.98	1.05	1.05	3.72	3.70	3.72	78
短期 (1-3)	845	99.99	100.24	2.33	0.86	0.88	0.88	2.31	2.30	2.31	71
中期 (3-7)	820	99.36	99.62	4.18	0.95	1.11	1.10	4.10	4.07	4.10	82
長期 (7-)	136	101.80	102.44	11.36	1.86	1.77	1.79	10.08	9.99	10.05	97
長期 (7-11)	75	97.58	97.90	8.86	1.14	1.48	1.47	8.41	8.35	8.41	84
超長期 (11-)	62	106.92	107.93	14.38	2.73	2.08	2.15	11.92	11.79	11.86	111
BBB 格	1,425	98.43	98.72	4.11	1.18	1.45	1.44	3.85	3.82	3.85	115
短期 (1-3)	691	99.77	100.05	2.09	1.12	1.18	1.18	2.07	2.06	2.07	103
中期 (3-7)	553	98.27	98.53	4.39	1.06	1.49	1.47	4.28	4.25	4.28	117
長期 (7-)	181	93.81	94.24	11.00	1.77	2.46	2.38	9.74	9.62	9.71	159
長期 (7-11)	94	96.37	96.70	8.52	1.51	2.01	1.98	7.95	7.87	7.95	139
超長期 (11-)	87	91.05	91.59	13.68	2.05	2.96	2.83	11.78	11.61	11.73	183
BB 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
B 格以下	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
格付なし	162	100.60	101.25	1.90	2.42	1.76	1.76	1.84	1.83	1.84	163
短期 (1-3)	147	100.91	101.59	1.60	2.57	1.80	1.80	1.57	1.55	1.57	169
中期 (3-7)	13	98.28	98.68	4.32	0.97	1.35	1.34	4.22	4.20	4.22	105
長期 (7-)	2	93.47	93.55	7.85	0.51	1.44	1.39	7.70	7.64	7.70	85
長期 (7-11)	2	93.47	93.55	7.85	0.51	1.44	1.39	7.70	7.64	7.70	85
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	2024 年 3 月末
銘柄数	12,974	14,003	14,825	15,436	15,639	16,113
額面 (10 億円)	956,369	972,326	1,018,210	1,056,757	1,085,263	1,124,834
時価単価 (円)	109.39	108.39	106.48	104.19	101.51	98.40
利含単価 (円)	109.53	108.52	106.59	104.30	101.61	98.50
残存年数 (年)	9.68	9.84	9.89	10.01	10.16	10.21
利率 (%)	0.95	0.89	0.83	0.79	0.77	0.78
単利 (%)	0.02	0.08	0.14	0.27	0.43	0.73
複利 (%)	0.02	0.08	0.14	0.27	0.43	0.72
Dur (年)	9.29	9.47	9.36	9.31	9.18	8.93
M-Dur	9.28	9.46	9.34	9.29	9.15	8.88
E-Dur	9.26	9.45	9.33	9.29	9.15	8.89
Tspd(bp)	4	5	4	3	6	4

出所:NFRFC

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 か月間は組入銘柄は固定される。

累積投資収益指数の計算方法

ある時点における投資収益指数は以下の計算式から算出される。

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

$BPIE_{today}$: 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、「2024 年 2 月の月末営業日から 2024 年 3 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 2024 年 3 月の月末営業日までの投資収益率(年率換算,%)」を指す。
- 「前年末からの投資収益率」は、「2023 年 12 月の月末営業日から 2024 年 3 月の月末営業日までの投資収益率(年率換算,%)」を指す。

月間投資収益率

- 2024 年 2 月の月末営業日から 2024 年 3 月の月末営業日までの投資収益率(年率換算,%)
- 2024 年 2 月の月末営業日において、3 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 3 月ポートフォリオの、右ページには 4 月ポートフォリオの、2024 年 3 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、2024 年 3 月末(暦上)における残存年数(至最終償還日)で区分。ただし 4 月ポートフォリオでは、2024 年 4 月末(暦上)における残存年数(至最終償還日)で区分。
- NOMURA-BPI は、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社の商標または登録商標です。

NOMURA-BPI/Extended のデータ提供について

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

Quick-IS

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

REUTERS

NMSBPI メニュー

Bloomberg

NBPI(GO) メニュー

時事通信社

BPIXG/12400

NFRC Web ページ

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

ディスクレイマー

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

「インデックス・ライセンスについて」

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

本資料は、お客様への情報提供を目的として、NFRC が作成したものです。

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

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

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

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

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

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

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