

## NOMURA-BPI

Global Markets Research

2024年7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

#### 月間投資収益率 (2024年6月末)

累積投資 収益指数	前月末からの投資収益率			過去からの期間投資収益率	
	トータル	キャピタル	インカム	前年度末	前年末
総合 357.755	3.58	2.76	0.82	-9.83	-5.91

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(%)

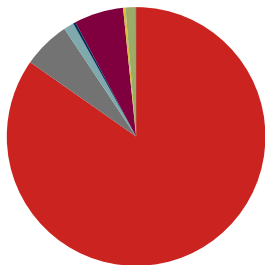
#### ポートフォリオ指標 (2024年6月末)

	翌月ポート (2024年7月)	当月ポート (2024年6月)	差
額面[兆円]	1138.23	1131.03	7.21
デュレーション[年]	8.75	8.72	0.03
修正デュレーション	8.69	8.66	0.03
時価単価[円]	95.71	95.70	0.00
利含単価[円]	95.85	95.85	0.00
残存年数[年]	10.27	10.24	0.03
利率[%]	0.79	0.79	0.00
単利[%]	1.01	1.00	0.00
複利[%]	0.97	0.97	0.00
Tスプレッド[bp]	4	4	0

出所: NFRC

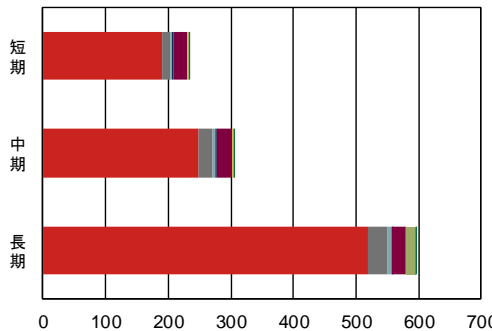
(注) デュレーション・修正デュレーションは経過利子込時価総額加重平均、単利・複利・Tスプレッドは時価総額加重平均、それ以外は額面加重平均。

#### 銘柄別額面構成 (2024年6月末)



出所: NFRC

#### 残存別額面構成 (2024年6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	84.7%	5.9%	1.3%	0.3%	6.2%	0.3%	1.2%	0.1%
全体	958.32	66.87	14.39	3.44	69.79	3.38	14.14	0.70
短期	190.68	12.84	3.42	2.02	21.09	1.70	-	0.21
中期	247.50	24.29	4.55	1.24	25.14	1.37	-	0.30
長期	520.14	29.75	6.42	0.18	23.56	0.32	14.14	0.19

出所: NFRC

(兆円)

## 目次

銘柄別・投資収益率 投資収益指数 . . . . .	2
総合 残存別・投資収益率 投資収益指数 . . . . .	3
国債 残存別・投資収益率 投資収益指数 . . . . .	4
「除く MBS」残存別・投資収益率 投資収益指数 . . . . .	6
「除く ABS」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6月末)

	累積投資 収益指数	前月末からの投資収益率			過去からの投資収益率	
		トータル	キャピタル	インカム	前年度末	前年末
総合	357.755	3.58	2.76	0.82	-9.83	-5.91
国債	367.658	3.54	2.69	0.85	-10.47	-6.35
地方債	385.446	4.17	3.56	0.62	-6.30	-3.70
政保債	359.874	3.60	2.88	0.73	-8.62	-4.86
金融債	272.337	3.12	2.87	0.25	-1.59	-1.28
事業債	381.486	3.88	3.14	0.74	-5.89	-3.03
円建外債	391.703	3.65	2.61	1.04	0.13	0.72
MBS	122.865	2.51	1.86	0.65	-7.91	-4.75
ABS	112.698	3.99	3.25	0.73	-4.13	-2.59

出所:NFRC

投資収益率は年率換算 (%)

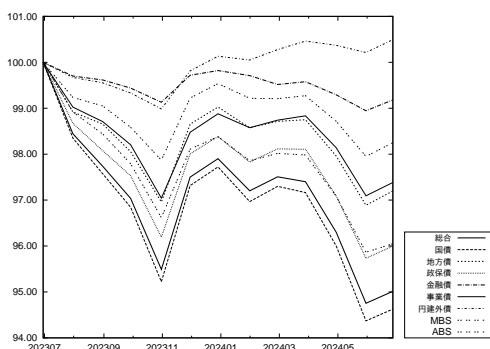
銘柄別・累積投資収益指数の推移

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
2023/06/30	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
2024/03/29	366.739	377.512	391.595	367.776	273.423	387.176	391.578	125.336	113.872
2024/04/30	362.596	373.000	388.461	363.973	272.639	384.451	391.225	124.185	113.234
2024/05/31	356.774	366.662	384.217	358.882	271.686	380.353	390.609	122.629	112.355
2024/06/03	356.897	366.780	384.455	359.014	271.749	380.499	390.713	122.700	112.419
2024/06/04	357.597	367.524	385.170	359.636	271.954	381.065	391.244	122.827	112.575
2024/06/05	358.569	368.566	385.981	360.504	272.228	381.853	391.450	123.091	112.764
2024/06/06	360.202	370.348	387.128	361.920	272.453	382.975	392.102	123.532	112.987
2024/06/07	359.774	369.892	386.709	361.554	272.329	382.638	391.900	123.397	112.895
2024/06/10	357.963	367.935	385.277	359.946	271.970	381.305	391.252	122.921	112.597
2024/06/11	358.199	368.187	385.480	360.162	272.039	381.490	391.451	122.989	112.643
2024/06/12	359.114	369.165	386.304	360.982	272.305	382.223	391.777	123.231	112.830
2024/06/13	359.739	369.840	386.789	361.531	272.421	382.679	392.038	123.406	112.926
2024/06/14	360.663	370.822	387.684	362.365	272.691	383.437	392.344	123.680	113.132
2024/06/17	360.422	370.530	387.744	362.174	272.803	383.375	392.735	123.678	113.176
2024/06/18	359.945	370.003	387.445	361.766	272.803	383.089	392.564	123.567	113.131
2024/06/19	360.418	370.528	387.705	362.184	272.835	383.382	392.696	123.658	113.177
2024/06/20	360.139	370.236	387.375	361.918	272.775	383.164	392.619	123.545	113.106
2024/06/21	359.506	369.547	386.896	361.385	272.642	382.750	392.395	123.373	113.001
2024/06/24	359.099	369.096	386.648	361.033	272.649	382.523	392.249	123.264	112.969
2024/06/25	358.818	368.791	386.456	360.800	272.635	382.308	392.243	123.173	112.931
2024/06/26	358.105	368.012	385.923	360.174	272.562	381.858	392.057	122.991	112.828
2024/06/27	356.903	366.735	384.788	359.095	272.207	380.875	391.472	122.630	112.568
2024/06/28	357.755	367.658	385.446	359.874	272.337	381.486	391.703	122.865	112.698

出所:NFRC

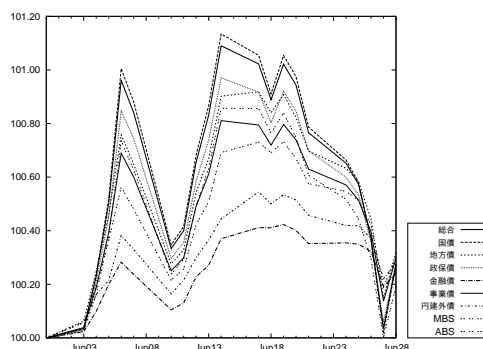
1983年12月末=100。MBSセクターは2003年3月末=100。ABSセクターは2008年3月末=100

指数の推移 (月次) 2023年6月末=100に補正。



出所:NFRC

指数の推移 (日次) 2024年5月末=100に補正。



出所:NFRC

総合 残存別・投資収益率(2024年6月末)

	累積投資 収益指数	前月末からの投資収益率			過去からの投資収益率	
		トータル	キャピタル	インカム	前年度末	前年末
総合	357.755	3.58	2.76	0.82	-9.83	-5.91
短期 (1-3)	234.252	2.19	1.82	0.38	-0.67	-0.71
中期 (3-7)	334.973	4.10	3.46	0.64	-3.33	-2.51
長期 (7-)	520.633	3.89	2.78	1.11	-17.04	-9.84
長期 (7-11)	190.709	4.46	3.49	0.97	-8.19	-4.79
超長期 (11-)	229.152	3.54	2.34	1.20	-22.25	-12.79
(11-15)	219.682	3.26	2.22	1.04	-14.79	-7.98
(15-)	234.445	3.64	2.39	1.26	-24.92	-14.50

出所:NFRC

投資収益率は年率換算(%)

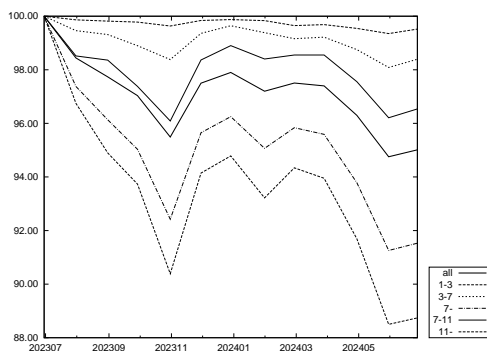
総合 残存別・投資収益指数の推移

総合 年/月/日	全体	短期 (1-3)	中期 (3-7)	長期 (7-)	長期*			
					(7-11)	超長期*	(11-15)*	(15-)*
2023/06/30	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
2024/03/29	366.739	234.647	337.774	543.729	194.683	242.610	228.094	249.975
2024/04/30	362.596	234.310	336.192	533.463	192.717	236.775	224.313	243.291
2024/05/31	356.774	233.859	333.922	519.085	190.058	228.531	219.134	233.792
2024/06/03	356.897	233.877	334.086	519.281	190.267	228.518	219.415	233.667
2024/06/04	357.597	233.973	334.570	520.792	190.748	229.236	220.046	234.423
2024/06/05	358.569	234.133	335.120	522.968	191.227	230.425	220.906	235.746
2024/06/06	360.202	234.232	335.585	527.186	191.901	232.913	222.308	238.667
2024/06/07	359.774	234.164	335.336	526.229	191.572	232.477	221.896	238.219
2024/06/10	357.963	234.010	334.531	521.847	190.653	230.050	220.267	235.469
2024/06/11	358.199	234.053	334.647	522.387	190.799	230.325	220.521	235.754
2024/06/12	359.114	234.189	335.177	524.439	191.369	231.360	221.325	236.885
2024/06/13	359.739	234.237	335.400	526.003	191.700	232.224	221.813	237.899
2024/06/14	360.663	234.370	335.968	528.053	192.316	233.225	222.582	238.996
2024/06/17	360.422	234.439	336.173	527.111	192.455	232.459	222.329	238.028
2024/06/18	359.945	234.459	336.095	525.785	192.259	231.664	221.918	237.080
2024/06/19	360.418	234.461	336.193	527.063	192.354	232.498	222.364	238.069
2024/06/20	360.139	234.445	336.028	526.416	192.078	232.241	221.877	237.899
2024/06/21	359.506	234.375	335.756	524.891	191.744	231.407	221.231	236.986
2024/06/24	359.099	234.401	335.720	523.724	191.587	230.697	220.746	236.185
2024/06/25	358.818	234.403	335.644	522.976	191.451	230.268	220.498	235.684
2024/06/26	358.105	234.377	335.471	521.093	191.091	229.199	219.797	234.467
2024/06/27	356.903	234.199	334.720	518.446	190.299	227.905	218.748	233.069
2024/06/28	357.755	234.252	334.973	520.633	190.709	229.152	219.682	234.445

出所:NFRC

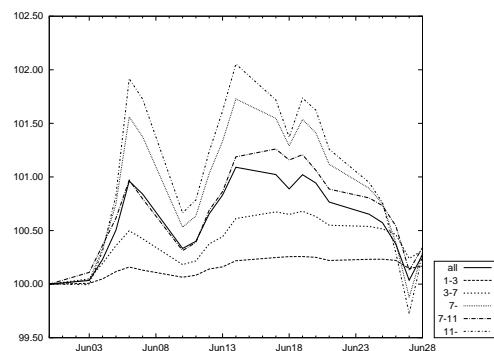
\* は 1995年12月末=100。それ以外は、1983年12月末=100。

指数の推移(月次) 2023年6月末=100に補正。



出所:NFRC

指数の推移(日次) 2024年5月末=100に補正。



出所:NFRC

国債 残存別・投資収益率 (2024年6月末)

	累積投資 収益指数	前月末からの投資収益率			過去からの投資収益率	
		トータル	キャピタル	インカム	前年度末	前年末
国債	367.658	3.54	2.69	0.85	-10.47	-6.35
短期 (1-3)	220.855	2.12	1.75	0.37	-0.74	-0.78
中期 (3-7)	333.447	4.04	3.39	0.65	-3.43	-2.64
長期 (7-)	529.824	3.84	2.70	1.14	-17.70	-10.32
長期 (7-11)	189.023	4.39	3.41	0.98	-8.33	-4.96
超長期 (11-)	227.526	3.52	2.28	1.23	-23.19	-13.42
(11-15)	217.488	3.10	2.04	1.05	-14.99	-8.20
(15-)	233.177	3.67	2.37	1.30	-26.13	-15.29

出所:NFRC

投資収益率は年率換算 (%)

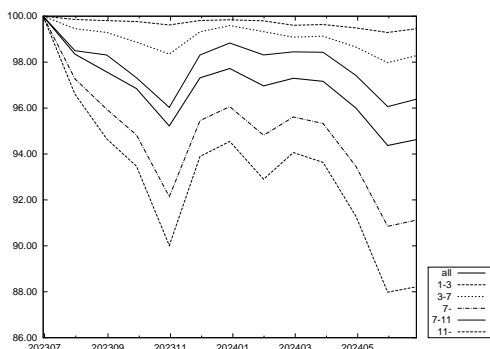
国債 残存別・投資収益指数の推移

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-)*
2023/06/30	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
2024/03/29	377.512	221.262	336.327	554.290	193.031	241.486	225.933	249.426
2024/04/30	373.000	220.931	334.713	543.451	191.054	235.449	222.150	242.446
2024/05/31	366.662	220.496	332.417	528.266	188.388	226.914	216.973	232.523
2024/06/03	366.780	220.512	332.582	528.439	188.594	226.884	217.251	232.374
2024/06/04	367.524	220.602	333.068	530.010	189.073	227.617	217.869	233.158
2024/06/05	368.566	220.753	333.621	532.293	189.550	228.841	218.727	234.531
2024/06/06	370.348	220.845	334.084	536.753	190.221	231.420	220.124	237.586
2024/06/07	369.892	220.780	333.832	535.763	189.891	230.978	219.712	237.129
2024/06/10	367.935	220.634	333.024	531.153	188.974	228.474	218.091	234.265
2024/06/11	368.187	220.675	333.140	531.717	189.120	228.755	218.345	234.560
2024/06/12	369.165	220.803	333.673	533.858	189.688	229.816	219.144	235.730
2024/06/13	369.840	220.847	333.895	535.503	190.017	230.709	219.628	236.786
2024/06/14	370.822	220.973	334.463	537.628	190.627	231.728	220.388	237.914
2024/06/17	370.530	221.037	334.668	536.588	190.768	230.913	220.128	236.878
2024/06/18	370.003	221.056	334.588	535.179	190.572	230.086	219.720	235.883
2024/06/19	370.528	221.057	334.686	536.549	190.667	230.958	220.169	236.926
2024/06/20	370.236	221.041	334.518	535.896	190.392	230.709	219.683	236.765
2024/06/21	369.547	220.973	334.238	534.285	190.051	229.848	219.027	235.818
2024/06/24	369.096	220.997	334.200	533.046	189.894	229.110	218.541	234.978
2024/06/25	368.791	220.999	334.124	532.262	189.760	228.668	218.297	234.456
2024/06/26	368.012	220.973	333.948	530.275	189.402	227.562	217.599	233.185
2024/06/27	366.735	220.805	333.195	527.527	188.615	226.242	216.557	231.748
2024/06/28	367.658	220.855	333.447	529.824	189.023	227.526	217.488	233.177

出所:NFRC

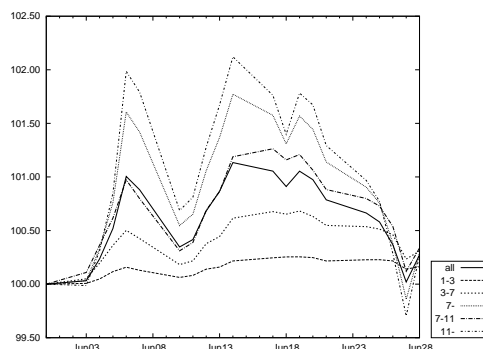
\* は 1995年12月末=100。それ以外は、1983年12月末=100。

指数の推移 (月次) 2023年6月末=100に補正。



出所:NFRC

指数の推移 (日次) 2024年5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6月末)

	累積投資 収益指数	前月末からの投資収益率			過去からの投資収益率	
		トータル	キャピタル	インカム	前年度末	前年末
除く MBS	357.634	3.60	2.77	0.82	-9.85	-5.93
短期 (1-3)	234.252	2.19	1.82	0.38	-0.67	-0.71
中期 (3-7)	334.973	4.10	3.46	0.64	-3.33	-2.51
長期 (7-)	522.362	3.92	2.80	1.12	-17.26	-9.97
長期 (7-11)	190.702	4.46	3.49	0.97	-8.19	-4.80
超長期 (11-)	230.741	3.58	2.36	1.22	-22.80	-13.10
(11-15)	219.671	3.26	2.22	1.04	-14.79	-7.99
(15-)	236.248	3.71	2.42	1.29	-25.82	-15.02

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(%)

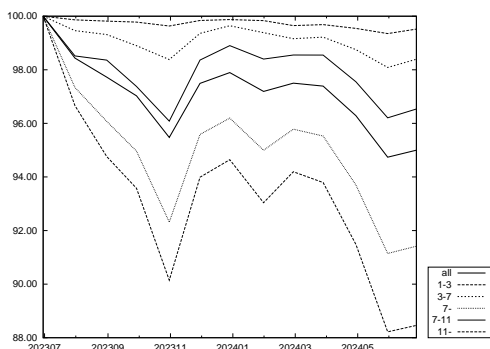
「除く MBS」残存別・投資収益指数の推移

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-)*
2023/06/30	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
2024/03/29	366.638	234.647	337.774	545.852	194.679	244.650	228.083	252.505
2024/04/30	362.486	234.310	336.192	535.416	192.712	238.624	224.302	245.515
2024/05/31	356.649	233.859	333.922	520.795	190.051	230.108	219.123	235.578
2024/06/03	356.771	233.877	334.086	520.990	190.260	230.089	219.404	235.438
2024/06/04	357.476	233.973	334.570	522.530	190.741	230.831	220.035	236.228
2024/06/05	358.450	234.133	335.120	524.741	191.221	232.057	220.896	237.607
2024/06/06	360.087	234.232	335.585	529.031	191.896	234.630	222.297	240.668
2024/06/07	359.658	234.164	335.336	528.061	191.566	234.183	221.885	240.205
2024/06/10	357.843	234.010	334.531	523.605	190.646	231.677	220.256	237.331
2024/06/11	358.079	234.053	334.647	524.153	190.792	231.960	220.511	237.627
2024/06/12	358.996	234.189	335.177	526.238	191.363	233.026	221.314	238.804
2024/06/13	359.622	234.237	335.400	527.828	191.694	233.918	221.802	239.864
2024/06/14	360.548	234.370	335.968	529.908	192.311	234.945	222.571	241.001
2024/06/17	360.303	234.439	336.173	528.939	192.450	234.143	222.318	239.971
2024/06/18	359.825	234.459	336.095	527.586	192.254	233.318	221.907	238.976
2024/06/19	360.300	234.461	336.193	528.892	192.349	234.185	222.353	240.017
2024/06/20	360.022	234.445	336.028	528.238	192.072	233.925	221.866	239.848
2024/06/21	359.388	234.375	335.756	526.688	191.738	233.065	221.220	238.897
2024/06/24	358.980	234.401	335.720	525.499	191.581	232.328	220.735	238.055
2024/06/25	358.699	234.403	335.644	524.740	191.444	231.886	220.487	237.532
2024/06/26	357.983	234.377	335.471	522.822	191.084	230.781	219.786	236.258
2024/06/27	356.780	234.199	334.720	520.138	190.292	229.452	218.737	234.810
2024/06/28	357.634	234.252	334.973	522.362	190.702	230.741	219.671	236.248

出所:NFRC

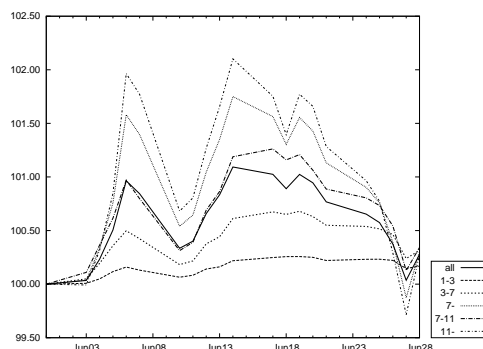
\* は 1995 年 12 月末=100。それ以外は、1983 年 12 月末=100。

指数の推移(月次) 2023年6月末=100に補正。



出所:NFRC

指数の推移(日次) 2024年5月末=100に補正。



出所:NFRC

「除く ABS」残存別・投資収益率(2024年6月末)

	累積投資 収益指数	前月末からの投資収益率			過去からの投資収益率	
		トータル	キャピタル	インカム	前年度末	前年末
除く ABS	357.778	3.58	2.76	0.82	-9.83	-5.92
短期 (1-3)	234.212	2.19	1.82	0.38	-0.67	-0.71
中期 (3-7)	334.969	4.10	3.46	0.64	-3.33	-2.51
長期 (7-)	520.631	3.89	2.78	1.11	-17.04	-9.84
長期 (7-11)	190.702	4.46	3.49	0.97	-8.19	-4.79
超長期 (11-)	229.150	3.54	2.34	1.20	-22.25	-12.79
(11-15)	219.674	3.26	2.22	1.04	-14.79	-7.99
(15-)	234.447	3.64	2.39	1.26	-24.92	-14.50

出所:NFRC

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

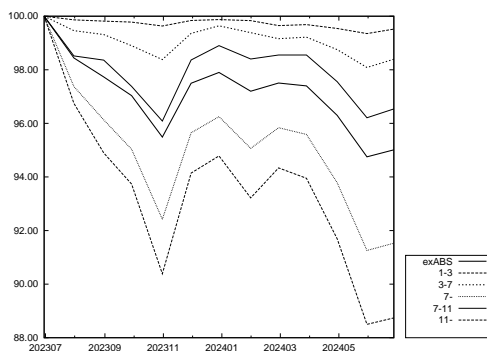
「除く ABS」残存別 投資収益指数の推移

除く ABS 年/月/日	全体	短期 (1-3)	中期 (3-7)	長期 (7-)	長期*			
					(7-11)	超長期*	(11-15)*	(15-)*
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
2024/03/29	366.767	234.607	337.771	543.730	194.677	242.609	228.086	249.977
2024/04/30	362.622	234.270	336.189	533.462	192.711	236.773	224.305	243.293
2024/05/31	356.797	233.819	333.919	519.083	190.052	228.529	219.126	233.794
2024/06/03	356.921	233.837	334.083	519.279	190.261	228.516	219.407	233.668
2024/06/04	357.621	233.932	334.567	520.790	190.742	229.234	220.038	234.425
2024/06/05	358.593	234.093	335.116	522.967	191.221	230.423	220.898	235.748
2024/06/06	360.227	234.191	335.581	527.184	191.895	232.911	222.300	238.669
2024/06/07	359.799	234.124	335.332	526.227	191.565	232.475	221.888	238.220
2024/06/10	357.987	233.970	334.527	521.845	190.647	230.047	220.259	235.470
2024/06/11	358.223	234.013	334.643	522.385	190.793	230.323	220.513	235.756
2024/06/12	359.139	234.149	335.174	524.437	191.363	231.358	221.317	236.886
2024/06/13	359.763	234.196	335.396	526.002	191.694	232.222	221.805	237.901
2024/06/14	360.688	234.330	335.964	528.052	192.310	233.223	222.573	238.998
2024/06/17	360.446	234.399	336.170	527.110	192.449	232.456	222.321	238.030
2024/06/18	359.969	234.419	336.091	525.783	192.253	231.661	221.910	237.082
2024/06/19	360.442	234.420	336.189	527.061	192.348	232.496	222.356	238.071
2024/06/20	360.163	234.404	336.024	526.414	192.072	232.239	221.869	237.900
2024/06/21	359.530	234.335	335.753	524.889	191.737	231.405	221.223	236.988
2024/06/24	359.123	234.361	335.716	523.722	191.581	230.694	220.738	236.186
2024/06/25	358.842	234.363	335.641	522.974	191.444	230.265	220.489	235.685
2024/06/26	358.129	234.337	335.467	521.091	191.084	229.197	219.789	234.469
2024/06/27	356.927	234.158	334.716	518.443	190.293	227.902	218.740	233.071
2024/06/28	357.778	234.212	334.969	520.631	190.702	229.150	219.674	234.447

出所:NFRC

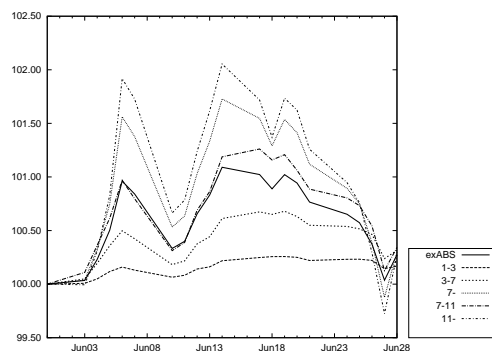
\* は 1995年12月末=100。それ以外は、1983年12月末=100。

指数の推移(月次) 2023年6月末=100に補正。



出所:NFRC

指数の推移(日次) 2024年5月末=100に補正。



出所:NFRC



「除く国債」残存別・投資収益率(2024年6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	169.024	3.84	3.16	0.68	-6.22	-3.47
短期(1-3)	134.158	2.52	2.12	0.40	-0.38	-0.41
中期(3-7)	166.193	4.38	3.78	0.60	-2.85	-1.93
長期(7-)	228.931	4.19	3.27	0.92	-12.31	-6.48
長期(7-11)	196.886	4.93	4.05	0.88	-7.23	-3.64
超長期(11-)	232.396	3.71	2.78	0.94	-15.46	-8.24

出所:NFRC

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

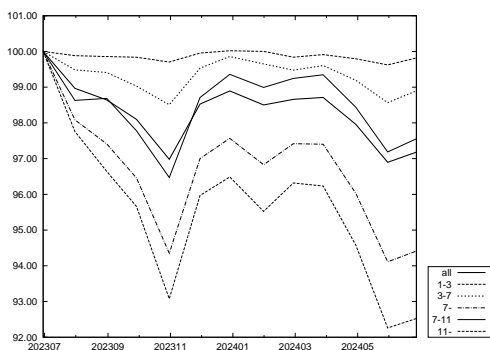
「除く国債」残存別・投資収益指数の推移

除く国債 年/月/日	全体	短期 (1-3)	中期 (3-7)	長期 (7-)	長期*	超長期*
					(7-11)	(11-)
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
2024/03/29	171.686	134.285	167.381	236.179	200.502	241.710
2024/04/30	170.374	134.128	166.682	232.838	198.664	237.544
2024/05/31	168.527	133.899	165.636	228.198	196.144	231.736
2024/06/03	168.609	133.912	165.714	228.364	196.366	231.845
2024/06/04	168.878	133.968	165.945	228.929	196.848	232.421
2024/06/05	169.227	134.060	166.205	229.683	197.325	233.316
2024/06/06	169.737	134.120	166.434	231.032	198.004	235.050
2024/06/07	169.572	134.083	166.321	230.659	197.686	234.669
2024/06/10	168.962	133.996	165.937	229.185	196.785	232.895
2024/06/11	169.049	134.021	165.993	229.379	196.921	233.115
2024/06/12	169.386	134.098	166.244	230.122	197.497	233.918
2024/06/13	169.596	134.128	166.354	230.652	197.830	234.548
2024/06/14	169.954	134.205	166.630	231.436	198.466	235.373
2024/06/17	169.950	134.248	166.730	231.267	198.592	234.996
2024/06/18	169.818	134.260	166.697	230.860	198.403	234.461
2024/06/19	169.943	134.261	166.744	231.215	198.493	234.984
2024/06/20	169.823	134.253	166.671	230.912	198.218	234.688
2024/06/21	169.623	134.221	166.556	230.421	197.937	234.083
2024/06/24	169.513	134.236	166.543	230.060	197.791	233.592
2024/06/25	169.423	134.239	166.506	229.801	197.636	233.278
2024/06/26	169.204	134.228	166.428	229.184	197.277	232.522
2024/06/27	168.741	134.126	166.067	228.183	196.479	231.458
2024/06/28	169.024	134.158	166.193	228.931	196.886	232.396

出所:NFRC

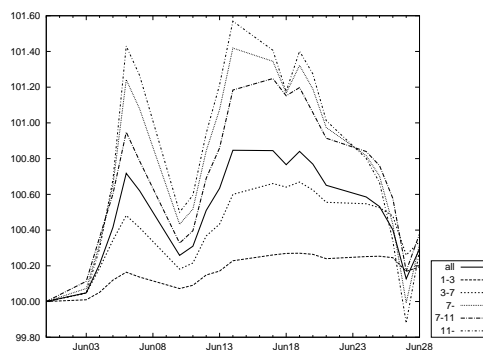
\*は1995年12月末=100。それ以外は、1993年12月末=100。

指数の推移(月次) 2023年6月末=100に補正。



出所:NFRC

指数の推移(日次) 2024年5月末=100に補正。



出所:NFRC

## 銘柄 残存別・月間投資収益率(2024年6月末)

	全体	短期 (1-3)	中期 (3-7)	長期 (7-)	月間投資収益率	
					(7-11)	(11-)
総合	3.58	2.19	4.10	3.89	4.46	3.54
国債	3.54	2.12	4.04	3.84	4.39	3.52
30年国債	3.20	-	4.29	3.18	4.25	3.07
20年国債	3.91	2.30	4.14	4.05	4.14	3.99
10年国債	3.79	2.26	4.05	4.63	4.63	-
5年国債	2.99	2.25	3.86	-	-	-
中期国債	1.44	1.44	-	-	-	-
地方債	4.17	2.36	4.28	4.91	5.14	4.66
東京都債	3.82	2.19	4.08	4.53	4.72	4.23
五大都市債	3.77	2.26	3.96	4.25	4.65	4.03
その他地方債	4.09	2.33	4.17	4.85	4.90	4.78
政保債	3.60	2.32	4.21	3.88	4.27	3.70
公営企業債券	3.15	2.28	4.14	-	-	-
その他政保債	3.67	2.33	4.22	3.88	4.27	3.70
金融債	3.12	2.42	4.03	4.95	4.95	-
特定金融債	-	-	-	-	-	-
事業債	3.88	2.69	4.54	4.30	4.74	3.91
円建外債	3.65	2.21	3.96	10.36	7.64	13.45
MBS	2.51	-	-	2.51	2.78	2.51
ABS	3.99	2.58	4.63	4.62	5.36	3.60

出所:NFRFC

## 「除く(銘柄)」残存別・月間投資収益率(2024年6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	3.84	2.52	4.38	4.19	4.93	3.71
除く30年国債	3.65	2.19	4.10	4.18	4.48	3.89
除く20年国債	3.47	2.18	4.09	3.80	4.65	3.31
除く10年国債	3.51	2.17	4.14	3.75	4.34	3.54
除く5年国債	3.66	2.17	4.15	3.89	4.46	3.54
除く中期国債	3.65	2.32	4.10	3.89	4.46	3.54
除く地方債	3.55	2.18	4.09	3.83	4.41	3.50
除く東京都債	3.58	2.19	4.10	3.89	4.46	3.54
除く五大都市債	3.58	2.19	4.10	3.89	4.46	3.54
除くその他地方債	3.56	2.19	4.10	3.85	4.44	3.51
除く政保債	3.58	2.19	4.10	3.89	4.46	3.54
除く公営企業債券	3.59	2.19	4.10	3.89	4.46	3.54
除くその他政保債	3.58	2.19	4.10	3.89	4.46	3.54
除く金融債	3.59	2.19	4.10	3.89	4.46	3.54
除く特定金融債	3.58	2.19	4.10	3.89	4.46	3.54
除く事業債	3.56	2.14	4.06	3.87	4.45	3.53
除く円建外債	3.58	2.19	4.10	3.88	4.46	3.54
除くMBS	3.60	2.19	4.10	3.92	4.46	3.58
除くABS	3.58	2.19	4.10	3.89	4.46	3.54
除くMBS・ABS	3.60	2.19	4.10	3.92	4.46	3.58

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(%)。
- ・「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6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	3.88	2.69	4.54	4.30	4.74	3.91
水産・農林業	4.24	-	4.24	-	-	-
鉱業	4.16	1.94	5.15	5.52	5.52	-
建設業	3.65	2.54	4.21	4.53	5.02	3.84
食料品	3.61	2.53	4.54	4.36	4.69	3.81
繊維製品	4.39	2.17	5.19	5.06	4.72	5.38
パルプ・紙	2.88	2.17	4.02	2.07	-0.48	4.86
化学	4.05	3.09	4.37	4.70	4.99	4.31
医薬品	4.08	2.56	4.27	4.79	5.85	1.79
石油・石炭製品	4.24	1.98	4.35	5.30	5.50	4.19
ゴム製品	3.71	2.87	4.04	5.95	5.95	-
ガラス・土石製品	4.39	3.00	5.38	4.92	4.80	5.21
鉄鋼	3.86	2.63	4.43	5.58	5.71	4.76
非鉄金属	4.04	2.93	4.56	4.55	4.55	-
金属製品	3.14	2.19	3.52	5.19	5.19	-
機械	3.91	2.79	4.55	5.04	5.04	-
電気機器	3.98	2.51	4.71	5.34	5.34	-
輸送用機器	3.74	3.07	4.49	4.16	4.75	3.26
精密機器	3.99	2.63	4.86	5.10	5.10	-
その他製品	3.81	2.40	4.28	4.41	5.01	4.18
電気・ガス業	2.82	2.61	3.90	2.03	0.92	3.14
陸運業	3.90	2.42	4.45	4.01	5.33	3.34
海運業	3.54	3.26	3.77	3.13	3.13	-
空運業	7.16	4.39	7.93	9.65	8.22	10.05
倉庫・運輸関連業	5.69	1.94	6.09	6.33	3.57	10.51
情報・通信業	4.89	3.07	6.13	6.06	6.55	4.88
卸売業	4.48	2.84	4.69	4.93	5.23	4.15
小売業	3.70	2.22	4.13	6.66	7.21	4.60
銀行業	3.65	2.76	4.54	4.76	4.76	-
証券・商品先物取引業	3.60	3.05	5.21	5.93	5.93	-
保険業	3.73	3.01	4.01	5.28	5.28	-
その他金融業	3.67	2.64	4.39	5.20	5.28	4.51
不動産業	4.88	2.67	4.56	6.37	5.93	7.01
サービス業	9.93	5.64	7.38	23.63	28.19	6.61
財投機関債	4.08	2.51	4.71	4.73	6.11	4.11

出所:NFRC

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

## 事業債 円建外債 格付別・月間投資収益率(2024年6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	3.87	2.65	4.51	4.38	4.79	4.03
AAA～A 格	3.87	2.65	4.51	4.37	4.78	4.01
AAA～AA 格	3.78	2.52	4.42	4.26	4.61	4.01
AAA 格	3.76	2.47	4.60	4.84	5.57	3.50
AA 格	3.78	2.53	4.36	4.20	4.42	4.04
A 格	4.09	2.94	4.69	4.71	5.18	4.04
BBB 格	4.17	2.85	5.01	7.95	6.49	9.89
事業債 全体	3.88	2.69	4.54	4.30	4.74	3.91
AAA～A 格	3.88	2.68	4.54	4.29	4.74	3.91
AAA～AA 格	3.80	2.54	4.44	4.25	4.59	4.00
AAA 格	3.76	2.47	4.60	4.84	5.57	3.50
AA 格	3.81	2.56	4.39	4.18	4.40	4.04
A 格	4.10	3.03	4.77	4.43	5.08	3.46
BBB 格	3.87	3.14	4.57	5.47	5.54	5.32
円建外債 全体	3.65	2.21	3.96	10.36	7.64	13.45
AAA～A 格	3.55	2.21	3.79	10.22	7.55	13.41
AAA～AA 格	3.04	2.08	3.75	6.62	6.19	13.54
AAA 格	-	-	-	-	-	-
AA 格	3.04	2.08	3.75	6.62	6.19	13.54
A 格	3.95	2.31	3.83	11.48	8.65	13.40
BBB 格	4.75	2.25	5.82	11.41	8.49	13.68

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6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-)
<b>事業債</b>						
AAA~AA格	3.80	2.54	4.44	4.25	4.59	4.00
AAA~A格	3.88	2.68	4.54	4.29	4.74	3.91
AAA~BBB格	3.88	2.69	4.54	4.30	4.74	3.91
AAA~BB格	3.88	2.69	4.54	4.30	4.74	3.91
AAA格	3.76	2.47	4.60	4.84	5.57	3.50
AA格	3.81	2.56	4.39	4.18	4.40	4.04
A格	4.10	3.03	4.77	4.43	5.08	3.46
BBB格	3.87	3.14	4.57	5.47	5.54	5.32
BB格	-	-	-	-	-	-
B格以下	-	-	-	-	-	-
格付なし	-	-	-	-	-	-
<b>円建外債</b>						
AAA~AA格	3.04	2.08	3.75	6.62	6.19	13.54
AAA~A格	3.55	2.21	3.79	10.22	7.55	13.41
AAA~BBB格	3.65	2.21	3.96	10.36	7.64	13.45
AAA~BB格	3.65	2.21	3.96	10.36	7.64	13.45
AAA格	-	-	-	-	-	-
AA格	3.04	2.08	3.75	6.62	6.19	13.54
A格	3.95	2.31	3.83	11.48	8.65	13.40
BBB格	4.75	2.25	5.82	11.41	8.49	13.68
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6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-)
<b>事業債</b>						
AAA~AA格	3.73	2.48	4.42	4.28	5.26	3.40
AAA~A格	3.88	2.67	4.55	4.32	4.80	3.90
AAA~BBB格	3.88	2.69	4.54	4.29	4.74	3.91
AAA~BB格	3.88	2.69	4.54	4.30	4.74	3.91
AAA格	-	-	-	-	-	-
AA格	3.73	2.48	4.42	4.28	5.26	3.40
A格	3.92	2.72	4.58	4.32	4.73	3.97
BBB格	3.72	3.00	4.40	3.53	2.87	4.26
BB格	5.13	-	5.07	5.73	-	5.73
B格以下	-	-	-	-	-	-
格付なし	-	-	-	-	-	-
<b>円建外債</b>						
AAA~AA格	3.30	2.31	4.31	7.72	7.72	-
AAA~A格	3.57	2.42	3.88	10.08	8.00	12.92
AAA~BBB格	3.65	2.21	3.96	10.36	7.64	13.45
AAA~BB格	3.65	2.21	3.96	10.36	7.64	13.45
AAA格	-	-	-	-	-	-
AA格	3.30	2.31	4.31	7.72	7.72	-
A格	3.61	2.44	3.81	10.31	8.05	12.92
BBB格	3.77	1.84	4.08	10.65	7.20	13.88
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&amp;I 格付別・月間投資収益率(2024年6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-)
<b>事業債</b>						
AAA~AA 格	3.97	2.53	4.55	4.59	5.55	3.97
AAA~A 格	3.77	2.60	4.46	4.10	4.40	3.87
AAA~BBB 格	3.78	2.62	4.47	4.12	4.43	3.87
AAA~BB 格	3.78	2.62	4.47	4.12	4.43	3.87
AAA 格	3.27	2.56	4.09	3.86	4.50	2.21
AA 格	3.98	2.52	4.57	4.59	5.57	3.97
A 格	3.47	2.71	4.34	3.17	2.85	3.59
BBB 格	4.99	3.71	5.20	9.95	11.81	5.32
BB 格	-	-	-	-	-	-
B 格以下	-	-	-	-	-	-
格付なし	4.94	3.34	5.18	7.08	8.12	5.08
<b>円建外債</b>						
AAA~AA 格	2.59	2.59	-	-	-	-
AAA~A 格	3.14	2.08	3.76	8.04	8.04	-
AAA~BBB 格	3.26	2.08	3.76	9.26	8.04	12.67
AAA~BB 格	3.26	2.08	3.76	9.26	8.04	12.67
AAA 格	-	-	-	-	-	-
AA 格	2.59	2.59	-	-	-	-
A 格	3.16	2.04	3.76	8.04	8.04	-
BBB 格	12.67	-	-	12.67	-	12.67
BB 格	-	-	-	-	-	-
B 格以下	-	-	-	-	-	-
格付なし	3.76	2.24	4.04	10.52	7.55	13.50

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6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-)
<b>事業債</b>						
AAA~AA 格	3.63	2.52	4.38	4.02	3.76	4.40
AAA~A 格	3.83	2.68	4.55	4.24	4.43	3.98
AAA~BBB 格	3.83	2.69	4.55	4.25	4.43	3.98
AAA~BB 格	3.83	2.69	4.55	4.25	4.43	3.98
AAA 格	3.80	2.47	4.64	4.84	5.57	3.50
AA 格	3.54	2.56	4.22	3.74	3.05	4.65
A 格	4.30	3.11	4.96	4.70	5.82	3.11
BBB 格	3.80	3.11	4.54	5.44	5.54	5.32
BB 格	-	-	-	-	-	-
B 格以下	-	-	-	-	-	-
格付なし	3.96	2.69	4.53	4.34	5.22	3.87
<b>円建外債</b>						
AAA~AA 格	0.75	0.41	0.73	3.55	1.25	13.54
AAA~A 格	4.20	2.12	3.74	11.11	7.04	13.72
AAA~BBB 格	4.21	2.12	3.75	11.11	7.04	13.72
AAA~BB 格	4.21	2.12	3.75	11.11	7.04	13.72
AAA 格	-	-	-	-	-	-
AA 格	0.75	0.41	0.73	3.55	1.25	13.54
A 格	5.43	2.91	4.78	12.15	8.98	13.72
BBB 格	6.59	-	6.59	-	-	-
BB 格	-	-	-	-	-	-
B 格以下	-	-	-	-	-	-
格付なし	3.42	2.25	4.01	9.28	8.09	12.55

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6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-)
<b>事業債</b>						
AAA~AA格	-	-	-	-	-	-
AAA~A格	3.82	2.56	4.42	4.33	4.48	4.25
AAA~BBB格	3.81	2.56	4.40	4.24	4.23	4.25
AAA~BB格	3.81	2.56	4.40	4.24	4.23	4.25
AAA格	-	-	-	-	-	-
AA格	-	-	-	-	-	-
A格	3.82	2.56	4.42	4.33	4.48	4.25
BBB格	3.59	2.47	4.31	2.93	1.41	4.31
BB格	-	-	-	-	-	-
B格以下	-	-	-	-	-	-
格付なし	3.93	2.75	4.61	4.33	5.00	3.61
<b>円建外債</b>						
AAA~AA格	3.56	2.57	4.17	7.92	7.92	-
AAA~A格	3.61	2.39	3.90	10.07	8.03	12.65
AAA~BBB格	3.77	2.21	4.05	10.41	7.61	13.45
AAA~BB格	3.77	2.21	4.05	10.41	7.61	13.45
AAA格	-	-	-	-	-	-
AA格	3.56	2.57	4.17	7.92	7.92	-
A格	3.66	2.19	3.39	11.11	8.19	12.65
BBB格	4.11	1.73	4.33	10.86	6.95	14.32
BB格	-	-	-	-	-	-
B格以下	-	-	-	-	-	-
格付なし	2.26	2.17	1.77	8.21	8.21	-

出所:NFRC

- 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NFRCで分類

## 事業債 円建外債 S&amp;P 格付別・月間投資収益率(2024年6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-)
<b>事業債</b>						
AAA~AA格	4.17	2.86	4.37	4.23	4.69	3.97
AAA~A格	3.98	2.48	4.52	4.47	5.00	4.00
AAA~BBB格	3.96	2.49	4.52	4.47	5.00	4.00
AAA~BB格	3.98	2.49	4.54	4.48	5.00	4.02
AAA格	-	-	-	-	-	-
AA格	4.17	2.86	4.37	4.23	4.69	3.97
A格	3.97	2.47	4.52	4.49	5.03	4.01
BBB格	3.52	2.62	4.48	5.04	5.12	4.76
BB格	5.13	-	5.07	5.73	-	5.73
B格以下	-	-	-	-	-	-
格付なし	3.85	2.74	4.55	4.22	4.63	3.87
<b>円建外債</b>						
AAA~AA格	3.48	2.34	4.33	7.72	7.72	-
AAA~A格	3.59	2.41	3.88	10.11	8.01	12.92
AAA~BBB格	3.66	2.18	3.95	10.38	7.64	13.45
AAA~BB格	3.66	2.18	3.95	10.38	7.64	13.45
AAA格	-	-	-	-	-	-
AA格	3.48	2.34	4.33	7.72	7.72	-
A格	3.60	2.42	3.82	10.35	8.07	12.92
BBB格	3.77	1.78	4.08	10.65	7.20	13.88
BB格	-	-	-	-	-	-
B格以下	-	-	-	-	-	-
格付なし	3.26	2.90	4.52	7.54	7.54	-

出所:NFRC

- 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NFRC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6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	1,131,025	95.70	95.85	10.24	0.79	1.00	0.97	8.72	8.66	8.68	4
短期(1-3)	231,952	100.06	100.12	2.00	0.38	0.34	0.34	1.99	1.99	1.99	5
中期(3-7)	304,392	100.25	100.35	4.86	0.65	0.60	0.60	4.78	4.77	4.78	5
長期(7-)	594,681	91.68	91.87	16.21	1.03	1.51	1.45	13.79	13.68	13.70	4
長期(7-11)	204,805	100.34	100.49	8.76	0.98	0.95	0.96	8.40	8.35	8.39	3
超長期(11-)	389,876	87.13	87.34	20.12	1.05	1.85	1.74	17.05	16.89	16.91	4
(11-15)	94,016	95.27	95.47	12.98	0.99	1.41	1.38	12.13	12.05	12.11	4
(15-)	295,861	84.55	84.76	22.39	1.07	2.00	1.87	18.81	18.63	18.64	4
国債	958,319	95.62	95.76	10.75	0.82	1.01	0.97	9.11	9.05	9.06	1
短期(1-3)	190,678	100.14	100.20	2.00	0.38	0.30	0.30	1.99	1.98	1.99	1
中期(3-7)	247,505	100.54	100.63	4.89	0.66	0.55	0.56	4.80	4.79	4.80	0
長期(7-)	520,137	91.63	91.82	16.76	1.05	1.53	1.45	14.21	14.10	14.12	1
長期(7-11)	177,373	100.72	100.86	8.80	1.00	0.92	0.93	8.42	8.38	8.42	0
超長期(11-)	342,763	86.92	87.13	20.87	1.08	1.89	1.76	17.68	17.52	17.53	1
(11-15)	82,224	95.76	95.95	13.05	1.01	1.38	1.35	12.19	12.11	12.17	1
(15-)	260,539	84.13	84.35	23.34	1.10	2.07	1.90	19.65	19.46	19.46	1
地方債	66,869	96.83	96.96	7.39	0.60	0.86	0.87	6.80	6.76	6.77	10
短期(1-3)	12,837	99.92	100.00	2.03	0.38	0.39	0.39	2.02	2.02	2.02	10
中期(3-7)	24,286	99.12	99.23	4.96	0.50	0.66	0.65	4.88	4.87	4.88	9
長期(7-)	29,746	93.63	93.81	11.69	0.77	1.26	1.28	10.65	10.57	10.59	11
政保債	14,390	95.78	95.98	9.13	0.70	0.95	0.91	7.82	7.76	7.79	7
短期(1-3)	3,416	99.66	99.69	1.85	0.18	0.34	0.33	1.85	1.84	1.85	6
中期(3-7)	4,552	100.07	100.25	4.47	0.56	0.58	0.58	4.40	4.39	4.40	6
長期(7-)	6,422	90.67	90.99	16.30	1.07	1.60	1.51	13.96	13.85	13.89	8
金融債	3,439	98.62	98.67	3.12	0.25	0.67	0.66	3.07	3.06	3.07	26
短期(1-3)	2,025	99.19	99.22	2.02	0.15	0.54	0.54	2.02	2.01	2.02	25
中期(3-7)	1,236	98.25	98.33	4.18	0.37	0.78	0.77	4.14	4.12	4.14	27
長期(7-)	178	94.83	94.92	8.22	0.59	1.30	1.27	8.01	7.96	8.01	41
事業債	69,788	95.69	95.86	7.47	0.71	1.13	1.09	6.38	6.33	6.35	38
短期(1-3)	21,091	99.56	99.65	2.02	0.43	0.64	0.64	2.01	2.00	2.01	35
中期(3-7)	25,142	98.75	98.91	4.70	0.67	0.93	0.92	4.61	4.59	4.61	38
長期(7-)	23,555	88.96	89.21	15.32	1.01	1.85	1.73	12.84	12.72	12.74	41
長期(7-11)	10,058	96.62	96.82	8.56	0.93	1.39	1.36	8.21	8.15	8.20	46
超長期(11-)	13,497	83.26	83.53	20.36	1.06	2.25	2.05	16.84	16.66	16.67	37
円建外債	3,385	98.93	99.16	3.80	1.04	1.27	1.26	3.61	3.58	3.61	80
短期(1-3)	1,697	99.69	99.89	2.15	0.94	1.06	1.06	2.12	2.11	2.12	75
中期(3-7)	1,372	98.71	98.96	4.19	0.98	1.30	1.29	4.09	4.07	4.09	79
長期(7-)	315	95.78	96.12	11.00	1.81	2.32	2.26	9.76	9.65	9.73	115
長期(7-11)	166	96.19	96.54	8.57	1.35	1.89	1.85	8.07	7.99	8.06	96
超長期(11-)	149	95.33	95.65	13.72	2.34	2.81	2.73	11.67	11.52	11.61	138
MBS	14,137	94.50	94.53	7.35	0.63	0.86	1.33	6.83	6.79	7.06	22
ABS	699	95.63	95.79	5.64	0.70	1.30	1.26	5.21	5.17	5.20	66
短期(1-3)	209	99.63	99.76	1.86	0.71	0.88	0.88	1.85	1.84	1.85	60
中期(3-7)	299	97.11	97.27	4.95	0.65	1.23	1.21	4.85	4.82	4.85	66
長期(7-)	191	88.92	89.11	10.86	0.78	1.95	1.83	9.95	9.85	9.93	75

出所:NFRIC



## 「除く」銘柄 残存別・ポートフォリオ指標 (2024年6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	1,116,888	95.72	95.86	10.28	0.79	1.01	0.97	8.75	8.68	8.70	4
短期 (1-3)	231,952	100.06	100.12	2.00	0.38	0.34	0.34	1.99	1.99	1.99	5
中期 (3-7)	304,392	100.25	100.35	4.86	0.65	0.60	0.60	4.78	4.77	4.78	5
長期 (7-)	580,544	91.61	91.81	16.42	1.04	1.53	1.45	13.96	13.85	13.87	3
長期 (7-11)	204,612	100.34	100.50	8.77	0.98	0.95	0.96	8.40	8.36	8.40	3
超長期 (11-)	375,932	86.86	87.08	20.59	1.07	1.89	1.76	17.46	17.30	17.31	3
(11-15)	94,016	95.27	95.47	12.98	0.99	1.41	1.38	12.13	12.05	12.11	4
(15-)	281,917	84.06	84.28	23.13	1.09	2.07	1.90	19.47	19.28	19.27	3
除く ABS	1,130,326	95.70	95.85	10.24	0.79	1.00	0.97	8.72	8.66	8.68	4
短期 (1-3)	231,743	100.06	100.12	2.00	0.38	0.34	0.34	1.99	1.99	1.99	5
中期 (3-7)	304,093	100.25	100.36	4.86	0.65	0.60	0.60	4.78	4.77	4.78	5
長期 (7-)	594,490	91.68	91.87	16.21	1.03	1.51	1.45	13.79	13.68	13.70	4
長期 (7-11)	204,700	100.34	100.50	8.76	0.98	0.95	0.96	8.40	8.36	8.39	3
超長期 (11-)	389,791	87.13	87.34	20.12	1.05	1.85	1.74	17.05	16.89	16.92	4
(11-15)	93,958	95.28	95.48	12.98	0.99	1.41	1.38	12.13	12.05	12.11	4
(15-)	295,833	84.55	84.76	22.39	1.07	2.00	1.87	18.81	18.63	18.64	4
除く MBS・ABS	1,116,189	95.72	95.86	10.28	0.79	1.00	0.97	8.75	8.69	8.70	4
短期 (1-3)	231,743	100.06	100.12	2.00	0.38	0.34	0.34	1.99	1.99	1.99	5
中期 (3-7)	304,093	100.25	100.36	4.86	0.65	0.60	0.60	4.78	4.77	4.78	5
長期 (7-)	580,353	91.61	91.81	16.43	1.04	1.53	1.45	13.96	13.85	13.87	3
長期 (7-11)	204,507	100.34	100.50	8.77	0.98	0.95	0.96	8.40	8.36	8.40	3
超長期 (11-)	375,847	86.86	87.08	20.59	1.07	1.89	1.76	17.46	17.30	17.31	3
(11-15)	93,958	95.28	95.48	12.98	0.99	1.41	1.38	12.13	12.05	12.11	4
(15-)	281,889	84.06	84.28	23.13	1.09	2.07	1.90	19.47	19.28	19.27	3
除く 国債	172,706	96.16	96.31	7.40	0.66	0.98	1.00	6.57	6.53	6.56	24
短期 (1-3)	41,274	99.66	99.75	2.01	0.40	0.55	0.55	2.00	2.00	2.00	26
中期 (3-7)	56,887	98.99	99.13	4.77	0.59	0.79	0.79	4.69	4.67	4.69	24
長期 (7-)	74,545	92.07	92.25	12.40	0.85	1.40	1.45	10.85	10.76	10.83	23
長期 (7-11)	27,432	97.89	98.10	8.55	0.86	1.15	1.14	8.22	8.17	8.21	24
超長期 (11-)	47,113	88.68	88.84	14.64	0.84	1.56	1.66	12.54	12.42	12.52	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6月末、7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	1,138,233	95.71	95.85	10.27	0.79	1.01	0.97	8.75	8.69	8.71	4
短期 (1-3)	231,360	100.06	100.13	2.03	0.39	0.35	0.35	2.02	2.01	2.02	5
中期 (3-7)	307,047	100.23	100.34	4.88	0.65	0.60	0.60	4.80	4.78	4.80	5
長期 (7-)	599,825	91.71	91.90	16.21	1.03	1.51	1.45	13.79	13.68	13.70	4
長期 (7-11)	207,976	100.31	100.47	8.79	0.98	0.96	0.96	8.42	8.38	8.41	3
超長期 (11-)	391,850	87.14	87.35	20.15	1.05	1.85	1.74	17.06	16.91	16.93	4
(11-15)	94,383	95.24	95.44	12.99	0.99	1.41	1.38	12.14	12.05	12.11	4
(15-)	297,467	84.57	84.78	22.42	1.07	2.01	1.88	18.82	18.64	18.65	4
国債	965,641	95.63	95.77	10.77	0.82	1.01	0.97	9.13	9.06	9.08	1
短期 (1-3)	190,464	100.15	100.21	2.01	0.38	0.30	0.30	2.00	2.00	2.00	1
中期 (3-7)	249,992	100.53	100.62	4.89	0.66	0.55	0.56	4.80	4.79	4.80	0
長期 (7-)	525,186	91.65	91.84	16.74	1.05	1.53	1.44	14.20	14.08	14.11	1
長期 (7-11)	180,561	100.67	100.82	8.81	0.99	0.93	0.93	8.44	8.40	8.43	0
超長期 (11-)	344,625	86.93	87.14	20.90	1.08	1.89	1.76	17.69	17.53	17.54	1
(11-15)	82,480	95.75	95.95	13.06	1.01	1.38	1.35	12.19	12.11	12.17	1
(15-)	262,145	84.15	84.37	23.36	1.10	2.07	1.90	19.66	19.47	19.47	1
地方債	67,059	96.83	96.96	7.44	0.60	0.87	0.88	6.85	6.81	6.82	10
短期 (1-3)	12,816	99.90	99.98	2.09	0.37	0.40	0.40	2.08	2.07	2.08	10
中期 (3-7)	24,534	99.07	99.18	5.02	0.50	0.66	0.66	4.95	4.93	4.95	9
長期 (7-)	29,710	93.65	93.83	11.75	0.78	1.27	1.29	10.70	10.62	10.64	11
政保債	14,162	95.70	95.91	9.36	0.71	0.97	0.93	8.03	7.97	8.00	7
短期 (1-3)	3,316	99.64	99.69	2.04	0.20	0.36	0.36	2.03	2.03	2.03	6
中期 (3-7)	4,347	100.14	100.32	4.56	0.58	0.59	0.59	4.49	4.48	4.49	6
長期 (7-)	6,499	90.71	91.02	16.30	1.07	1.60	1.51	13.98	13.86	13.91	8
金融債	3,443	98.62	98.67	3.18	0.26	0.67	0.67	3.14	3.12	3.14	27
短期 (1-3)	2,030	99.16	99.19	2.09	0.16	0.55	0.55	2.08	2.07	2.08	25
中期 (3-7)	1,235	98.27	98.35	4.25	0.38	0.79	0.78	4.21	4.19	4.21	28
長期 (7-)	178	94.83	94.92	8.22	0.59	1.30	1.27	8.01	7.96	8.01	41
事業債	69,496	95.67	95.83	7.58	0.72	1.14	1.10	6.48	6.43	6.45	38
短期 (1-3)	20,725	99.54	99.63	2.11	0.44	0.66	0.65	2.10	2.09	2.10	35
中期 (3-7)	25,246	98.70	98.86	4.78	0.67	0.94	0.93	4.69	4.67	4.69	38
長期 (7-)	23,525	89.00	89.24	15.41	1.02	1.86	1.74	12.91	12.79	12.81	41
長期 (7-11)	10,044	96.69	96.90	8.67	0.97	1.41	1.38	8.30	8.24	8.29	47
超長期 (11-)	13,480	83.27	83.54	20.43	1.07	2.25	2.05	16.89	16.72	16.72	36
円建外債	3,549	98.97	99.19	3.98	1.06	1.28	1.27	3.77	3.74	3.76	80
短期 (1-3)	1,783	99.68	99.88	2.22	0.93	1.06	1.06	2.20	2.19	2.20	74
中期 (3-7)	1,408	98.78	99.00	4.33	1.02	1.31	1.31	4.23	4.20	4.23	80
長期 (7-)	357	96.19	96.51	11.33	1.85	2.31	2.26	9.98	9.87	9.95	112
長期 (7-11)	193	96.62	96.95	8.75	1.43	1.90	1.87	8.21	8.13	8.20	95
超長期 (11-)	165	95.68	96.00	14.33	2.36	2.79	2.72	12.08	11.92	12.01	132
MBS	14,185	94.52	94.55	7.38	0.63	0.86	1.33	6.86	6.81	7.08	22
ABS	697	95.62	95.78	5.68	0.71	1.31	1.27	5.24	5.20	5.24	66
短期 (1-3)	227	99.53	99.67	1.98	0.69	0.89	0.89	1.97	1.96	1.97	60
中期 (3-7)	285	96.92	97.08	5.15	0.66	1.25	1.23	5.04	5.01	5.04	66
長期 (7-)	185	88.81	89.00	11.01	0.81	1.97	1.85	10.07	9.97	10.05	76

出所:NFRIC

## 「除く」銘柄 残存別・ポートフォリオ指標 (2024年6月末、7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	1,124,047	95.72	95.86	10.31	0.80	1.01	0.97	8.77	8.71	8.73	4
短期 (1-3)	231,360	100.06	100.13	2.03	0.39	0.35	0.35	2.02	2.01	2.02	5
中期 (3-7)	307,047	100.23	100.34	4.88	0.65	0.60	0.60	4.80	4.78	4.80	5
長期 (7-)	585,640	91.64	91.83	16.42	1.04	1.53	1.45	13.96	13.85	13.87	3
長期 (7-11)	207,783	100.31	100.47	8.80	0.98	0.96	0.96	8.42	8.38	8.42	3
超長期 (11-)	377,857	86.87	87.08	20.62	1.07	1.89	1.76	17.47	17.31	17.32	3
(11-15)	94,383	95.24	95.44	12.99	0.99	1.41	1.38	12.14	12.05	12.11	4
(15-)	283,475	84.08	84.30	23.16	1.09	2.07	1.91	19.48	19.29	19.29	3
除く ABS	1,137,535	95.71	95.85	10.27	0.79	1.01	0.97	8.75	8.69	8.71	4
短期 (1-3)	231,133	100.06	100.13	2.03	0.39	0.35	0.35	2.02	2.01	2.02	5
中期 (3-7)	306,762	100.24	100.34	4.88	0.65	0.60	0.60	4.80	4.78	4.80	5
長期 (7-)	599,640	91.71	91.90	16.21	1.03	1.51	1.45	13.79	13.68	13.70	4
長期 (7-11)	207,874	100.31	100.47	8.79	0.98	0.96	0.96	8.42	8.38	8.41	3
超長期 (11-)	391,766	87.14	87.35	20.15	1.05	1.85	1.74	17.06	16.91	16.93	4
(11-15)	94,327	95.25	95.44	12.99	0.99	1.41	1.38	12.14	12.05	12.11	4
(15-)	297,439	84.57	84.78	22.42	1.07	2.01	1.88	18.82	18.64	18.65	4
除く MBS・ABS	1,123,350	95.72	95.86	10.31	0.80	1.01	0.97	8.77	8.71	8.73	4
短期 (1-3)	231,133	100.06	100.13	2.03	0.39	0.35	0.35	2.02	2.01	2.02	5
中期 (3-7)	306,762	100.24	100.34	4.88	0.65	0.60	0.60	4.80	4.78	4.80	5
長期 (7-)	585,455	91.64	91.83	16.42	1.04	1.53	1.45	13.96	13.85	13.87	3
長期 (7-11)	207,681	100.31	100.47	8.80	0.98	0.96	0.96	8.42	8.38	8.42	3
超長期 (11-)	377,774	86.87	87.09	20.62	1.07	1.89	1.76	17.47	17.31	17.33	3
(11-15)	94,327	95.25	95.44	12.99	0.99	1.41	1.38	12.14	12.05	12.11	4
(15-)	283,447	84.08	84.30	23.16	1.09	2.07	1.91	19.48	19.29	19.29	3
除く 国債	172,591	96.15	96.30	7.49	0.66	0.99	1.01	6.65	6.61	6.64	24
短期 (1-3)	40,896	99.65	99.74	2.10	0.41	0.56	0.56	2.09	2.08	2.09	26
中期 (3-7)	57,056	98.95	99.09	4.85	0.59	0.80	0.79	4.77	4.75	4.77	24
長期 (7-)	74,639	92.10	92.28	12.45	0.86	1.40	1.46	10.90	10.81	10.88	23
長期 (7-11)	27,415	97.93	98.15	8.64	0.89	1.16	1.15	8.30	8.25	8.29	24
超長期 (11-)	47,225	88.71	88.87	14.67	0.84	1.56	1.66	12.56	12.45	12.54	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6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	69,788	95.69	95.86	7.47	0.71	1.13	1.09	6.38	6.33	6.35	38
短期 (1-3)	21,091	99.56	99.65	2.02	0.43	0.64	0.64	2.01	2.00	2.01	35
中期 (3-7)	25,142	98.75	98.91	4.70	0.67	0.93	0.92	4.61	4.59	4.61	38
長期 (7-)	23,555	88.96	89.21	15.32	1.01	1.85	1.73	12.84	12.72	12.74	41
長期 (7-11)	10,058	96.62	96.82	8.56	0.93	1.39	1.36	8.21	8.15	8.20	46
超長期 (11-)	13,497	83.26	83.53	20.36	1.06	2.25	2.05	16.84	16.66	16.67	37
水産・農林業	33	99.36	99.56	4.35	0.86	1.02	1.01	4.26	4.24	4.26	50
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	33	99.36	99.56	4.35	0.86	1.02	1.01	4.26	4.24	4.26	50
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
鉱業	30	96.08	96.13	5.24	0.21	0.92	0.90	5.14	5.11	5.14	33
短期 (1-3)	10	99.18	99.21	1.72	0.08	0.56	0.56	1.71	1.71	1.71	29
中期 (3-7)	10	95.15	95.24	6.71	0.30	1.08	1.05	6.64	6.61	6.64	35
長期 (7-)	10	93.91	93.96	7.30	0.25	1.16	1.12	7.23	7.19	7.23	36
長期 (7-11)	10	93.91	93.96	7.30	0.25	1.16	1.12	7.23	7.19	7.23	36
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
建設業	1,231	97.66	97.73	4.39	0.43	0.88	0.86	4.22	4.20	4.22	36
短期 (1-3)	434	99.25	99.29	2.02	0.24	0.60	0.60	2.02	2.01	2.02	31
中期 (3-7)	647	98.08	98.17	4.45	0.49	0.90	0.89	4.39	4.37	4.39	37
長期 (7-)	150	91.27	91.30	11.01	0.75	1.62	1.54	10.36	10.27	10.35	42
長期 (7-11)	84	95.61	95.66	8.54	0.78	1.36	1.34	8.26	8.21	8.26	44
超長期 (11-)	66	85.74	85.76	14.14	0.71	1.99	1.84	13.33	13.21	13.31	41
食料品	1,484	97.58	97.69	4.85	0.47	0.90	0.89	4.60	4.57	4.60	34
短期 (1-3)	646	99.30	99.36	2.10	0.29	0.61	0.61	2.09	2.08	2.09	30
中期 (3-7)	528	97.96	98.06	4.63	0.45	0.90	0.89	4.57	4.55	4.57	35
長期 (7-)	310	93.38	93.56	10.94	0.89	1.56	1.50	10.21	10.13	10.19	39
長期 (7-11)	190	96.66	96.80	8.80	0.88	1.31	1.29	8.47	8.41	8.46	36
超長期 (11-)	120	88.18	88.44	14.34	0.92	1.99	1.87	13.23	13.11	13.19	43
繊維製品	275	97.93	98.07	4.38	0.48	0.87	0.85	4.16	4.14	4.16	35
短期 (1-3)	70	99.53	99.61	1.42	0.23	0.51	0.51	1.41	1.41	1.41	29
中期 (3-7)	169	98.60	98.74	3.98	0.47	0.83	0.82	3.93	3.92	3.93	34
長期 (7-)	36	91.66	91.92	11.99	1.03	1.80	1.72	11.12	11.02	11.10	50
長期 (7-11)	16	98.40	98.52	9.41	1.29	1.49	1.47	8.87	8.81	8.87	48
超長期 (11-)	20	86.27	86.64	14.05	0.83	2.10	1.95	13.16	13.03	13.13	52
パルプ・紙	359	96.47	96.56	4.95	0.44	1.05	1.02	4.65	4.62	4.64	47
短期 (1-3)	149	99.13	99.18	1.96	0.29	0.72	0.72	1.96	1.95	1.96	43
中期 (3-7)	140	97.33	97.42	4.81	0.44	1.00	0.98	4.75	4.72	4.75	44
長期 (7-)	70	89.12	89.29	11.54	0.75	1.92	1.81	10.77	10.67	10.75	65
長期 (7-11)	35	92.92	92.98	7.92	0.62	1.69	1.64	7.72	7.66	7.72	80
超長期 (11-)	35	85.32	85.59	15.16	0.88	2.16	2.00	14.07	13.93	14.03	48
化学	2,148	95.44	95.52	5.79	0.48	1.12	1.08	5.35	5.32	5.35	46
短期 (1-3)	652	99.15	99.20	2.18	0.28	0.66	0.66	2.17	2.16	2.17	35
中期 (3-7)	903	97.52	97.60	4.69	0.44	0.97	0.96	4.63	4.61	4.63	42
長期 (7-)	593	88.18	88.31	11.44	0.74	1.92	1.79	10.51	10.41	10.49	66
長期 (7-11)	320	94.42	94.54	8.07	0.66	1.46	1.42	7.84	7.79	7.84	58
超長期 (11-)	273	80.87	81.00	15.40	0.83	2.55	2.30	14.16	13.99	14.11	79
医薬品	718	95.54	95.68	6.29	0.49	1.10	1.07	5.89	5.85	5.88	40
短期 (1-3)	178	99.44	99.52	2.03	0.30	0.57	0.57	2.03	2.02	2.03	27
中期 (3-7)	175	98.70	98.86	4.30	0.53	0.84	0.83	4.24	4.23	4.24	32
長期 (7-)	365	92.12	92.29	9.33	0.56	1.51	1.45	8.76	8.69	8.75	51
長期 (7-11)	265	93.99	94.09	7.35	0.43	1.33	1.29	7.23	7.18	7.23	52
超長期 (11-)	100	87.14	87.53	14.57	0.91	2.03	1.89	13.13	13.00	13.07	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6月末、7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	69,496	95.67	95.83	7.58	0.72	1.14	1.10	6.48	6.43	6.45	38
短期 (1-3)	20,725	99.54	99.63	2.11	0.44	0.66	0.65	2.10	2.09	2.10	35
中期 (3-7)	25,246	98.70	98.86	4.78	0.67	0.94	0.93	4.69	4.67	4.69	38
長期 (7-)	23,525	89.00	89.24	15.41	1.02	1.86	1.74	12.91	12.79	12.81	41
長期 (7-11)	10,044	96.69	96.90	8.67	0.97	1.41	1.38	8.30	8.24	8.29	47
超長期 (11-)	13,480	83.27	83.54	20.43	1.07	2.25	2.05	16.89	16.72	16.72	36
水産・農林業	33	99.36	99.56	4.35	0.86	1.02	1.01	4.26	4.24	4.26	50
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	33	99.36	99.56	4.35	0.86	1.02	1.01	4.26	4.24	4.26	50
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
鉱業	30	96.08	96.13	5.24	0.21	0.92	0.90	5.14	5.11	5.14	33
短期 (1-3)	10	99.18	99.21	1.72	0.08	0.56	0.56	1.71	1.71	1.71	29
中期 (3-7)	10	95.15	95.24	6.71	0.30	1.08	1.05	6.64	6.61	6.64	35
長期 (7-)	10	93.91	93.96	7.30	0.25	1.16	1.12	7.23	7.19	7.23	36
長期 (7-11)	10	93.91	93.96	7.30	0.25	1.16	1.12	7.23	7.19	7.23	36
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
建設業	1,186	97.58	97.64	4.52	0.44	0.89	0.88	4.34	4.32	4.34	36
短期 (1-3)	418	99.17	99.22	2.20	0.26	0.63	0.63	2.19	2.18	2.19	32
中期 (3-7)	618	98.04	98.12	4.51	0.49	0.90	0.89	4.45	4.43	4.45	37
長期 (7-)	150	91.27	91.30	11.01	0.75	1.62	1.54	10.36	10.27	10.35	42
長期 (7-11)	84	95.61	95.66	8.54	0.78	1.36	1.34	8.26	8.21	8.26	44
超長期 (11-)	66	85.74	85.76	14.14	0.71	1.99	1.84	13.33	13.21	13.31	41
食料品	1,449	97.53	97.62	4.94	0.47	0.91	0.90	4.69	4.66	4.69	34
短期 (1-3)	627	99.25	99.30	2.18	0.28	0.62	0.62	2.17	2.16	2.17	31
中期 (3-7)	512	97.93	98.03	4.68	0.45	0.90	0.89	4.62	4.60	4.62	35
長期 (7-)	310	93.38	93.56	10.94	0.89	1.56	1.50	10.21	10.13	10.19	39
長期 (7-11)	190	96.66	96.80	8.80	0.88	1.31	1.29	8.47	8.41	8.46	36
超長期 (11-)	120	88.18	88.44	14.34	0.92	1.99	1.87	13.23	13.11	13.19	43
繊維製品	235	97.61	97.76	4.94	0.52	0.94	0.93	4.70	4.68	4.70	37
短期 (1-3)	90	99.13	99.26	2.66	0.32	0.66	0.65	2.65	2.64	2.65	30
中期 (3-7)	109	98.31	98.44	4.50	0.52	0.92	0.91	4.44	4.42	4.44	38
長期 (7-)	36	91.66	91.92	11.99	1.03	1.80	1.72	11.12	11.02	11.10	50
長期 (7-11)	16	98.40	98.52	9.41	1.29	1.49	1.47	8.87	8.81	8.87	48
超長期 (11-)	20	86.27	86.64	14.05	0.83	2.10	1.95	13.16	13.03	13.13	52
パルプ・紙	344	96.33	96.42	5.12	0.45	1.07	1.05	4.81	4.78	4.81	48
短期 (1-3)	144	98.98	99.04	2.14	0.32	0.79	0.78	2.13	2.12	2.13	47
中期 (3-7)	130	97.29	97.37	4.95	0.44	0.98	0.97	4.88	4.86	4.88	41
長期 (7-)	70	89.12	89.29	11.54	0.75	1.92	1.81	10.77	10.67	10.75	65
長期 (7-11)	35	92.92	92.98	7.92	0.62	1.69	1.64	7.72	7.66	7.72	80
超長期 (11-)	35	85.32	85.59	15.16	0.88	2.16	2.00	14.07	13.93	14.03	48
化学	2,148	95.44	95.52	5.79	0.48	1.12	1.08	5.35	5.32	5.35	46
短期 (1-3)	657	99.15	99.20	2.18	0.28	0.66	0.66	2.18	2.17	2.18	35
中期 (3-7)	908	97.48	97.56	4.72	0.44	0.97	0.96	4.66	4.64	4.66	42
長期 (7-)	583	88.08	88.20	11.52	0.75	1.94	1.81	10.58	10.47	10.55	67
長期 (7-11)	310	94.43	94.55	8.10	0.68	1.47	1.43	7.87	7.82	7.87	58
超長期 (11-)	273	80.87	81.00	15.40	0.83	2.55	2.30	14.16	13.99	14.11	79
医薬品	718	95.54	95.68	6.29	0.49	1.10	1.07	5.89	5.85	5.88	40
短期 (1-3)	178	99.44	99.52	2.03	0.30	0.57	0.57	2.03	2.02	2.03	27
中期 (3-7)	175	98.70	98.86	4.30	0.53	0.84	0.83	4.24	4.23	4.24	32
長期 (7-)	365	92.12	92.29	9.33	0.56	1.51	1.45	8.76	8.69	8.75	51
長期 (7-11)	265	93.99	94.09	7.35	0.43	1.33	1.29	7.23	7.18	7.23	52
超長期 (11-)	100	87.14	87.53	14.57	0.91	2.03	1.89	13.13	13.00	13.07	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 (2/4) (2024年6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	96.14	96.24	6.13	0.55	1.14	1.11	5.78	5.74	5.77	46
短期 (1-3)	70	99.38	99.45	1.58	0.20	0.57	0.57	1.58	1.57	1.58	33
中期 (3-7)	85	97.43	97.56	4.69	0.42	0.95	0.94	4.62	4.60	4.62	40
長期 (7-)	150	93.89	93.99	9.06	0.79	1.53	1.48	8.53	8.47	8.52	56
長期 (7-11)	125	95.36	95.45	7.75	0.72	1.39	1.36	7.54	7.48	7.53	55
超長期 (11-)	25	86.56	86.73	15.61	1.13	2.32	2.16	14.02	13.86	13.95	64
ゴム製品	330	98.02	98.10	4.03	0.39	0.86	0.85	3.96	3.94	3.96	37
短期 (1-3)	140	99.13	99.18	2.36	0.28	0.65	0.65	2.35	2.34	2.35	32
中期 (3-7)	160	97.56	97.64	4.74	0.41	0.94	0.93	4.69	4.67	4.69	38
長期 (7-)	30	95.30	95.47	8.08	0.74	1.39	1.36	7.83	7.77	7.82	52
長期 (7-11)	30	95.30	95.47	8.08	0.74	1.39	1.36	7.83	7.77	7.82	52
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
ガラス・土石製品	277	96.22	96.31	5.44	0.48	1.04	1.01	5.09	5.05	5.08	42
短期 (1-3)	98	99.30	99.33	2.02	0.26	0.60	0.60	2.01	2.00	2.01	31
中期 (3-7)	102	97.42	97.49	4.62	0.43	0.99	0.98	4.56	4.54	4.56	45
長期 (7-)	77	90.74	90.92	10.86	0.81	1.72	1.63	10.08	10.00	10.07	53
長期 (7-11)	52	95.51	95.64	8.72	0.82	1.40	1.37	8.41	8.36	8.41	45
超長期 (11-)	25	80.77	81.06	15.35	0.80	2.51	2.26	14.21	14.05	14.17	73
鉄鋼	483	98.17	98.25	4.14	0.51	0.91	0.90	4.01	3.99	4.01	42
短期 (1-3)	190	99.27	99.33	2.01	0.29	0.64	0.64	2.01	2.00	2.01	34
中期 (3-7)	230	98.08	98.16	4.44	0.55	0.97	0.97	4.39	4.36	4.39	45
長期 (7-)	63	95.14	95.32	9.46	1.02	1.56	1.52	8.90	8.83	8.89	54
長期 (7-11)	53	97.02	97.23	8.61	1.03	1.43	1.41	8.22	8.17	8.22	51
超長期 (11-)	10	85.19	85.23	13.96	0.95	2.36	2.19	13.01	12.87	12.98	77
非鉄金属	380	97.92	98.05	4.53	0.47	0.94	0.93	4.42	4.40	4.42	40
短期 (1-3)	120	98.95	99.01	2.31	0.25	0.71	0.71	2.30	2.29	2.30	38
中期 (3-7)	200	98.03	98.15	4.60	0.54	0.97	0.96	4.53	4.51	4.53	43
長期 (7-)	60	95.49	95.81	8.74	0.72	1.32	1.29	8.44	8.39	8.44	36
長期 (7-11)	60	95.49	95.81	8.74	0.72	1.32	1.29	8.44	8.39	8.44	36
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
金属製品	175	98.35	98.46	3.49	0.39	0.83	0.82	3.43	3.42	3.43	39
短期 (1-3)	60	99.34	99.40	1.64	0.22	0.60	0.60	1.63	1.63	1.63	35
中期 (3-7)	106	98.09	98.22	4.15	0.46	0.91	0.90	4.10	4.08	4.10	41
長期 (7-)	9	94.80	95.03	8.16	0.70	1.42	1.38	7.92	7.87	7.92	52
長期 (7-11)	9	94.80	95.03	8.16	0.70	1.42	1.38	7.92	7.87	7.92	52
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
機械	1,333	97.82	97.91	4.20	0.41	0.89	0.88	4.11	4.09	4.11	39
短期 (1-3)	541	99.19	99.24	2.06	0.27	0.65	0.65	2.05	2.04	2.05	36
中期 (3-7)	559	97.57	97.67	4.63	0.44	0.95	0.94	4.57	4.54	4.57	41
長期 (7-)	233	95.25	95.41	8.18	0.65	1.31	1.28	7.95	7.90	7.95	42
長期 (7-11)	233	95.25	95.41	8.18	0.65	1.31	1.28	7.95	7.90	7.95	42
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
電気機器	2,185	98.37	98.49	4.16	0.49	0.87	0.86	4.06	4.04	4.06	37
短期 (1-3)	790	99.43	99.50	1.93	0.31	0.61	0.60	1.92	1.91	1.92	32
中期 (3-7)	1,130	98.01	98.13	4.62	0.50	0.93	0.92	4.56	4.53	4.56	39
長期 (7-)	265	96.76	97.02	8.88	1.00	1.43	1.41	8.48	8.42	8.48	47
長期 (7-11)	265	96.76	97.02	8.88	1.00	1.43	1.41	8.48	8.42	8.48	47
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
輸送用機器	1,140	97.16	97.26	4.57	0.40	0.93	0.92	4.36	4.34	4.36	39
短期 (1-3)	544	99.06	99.14	2.16	0.27	0.70	0.70	2.15	2.14	2.15	39
中期 (3-7)	382	97.62	97.72	4.73	0.43	0.93	0.92	4.67	4.64	4.67	38
長期 (7-)	214	91.52	91.66	10.40	0.68	1.58	1.51	9.86	9.79	9.86	44
長期 (7-11)	124	95.47	95.56	8.43	0.69	1.31	1.28	8.19	8.13	8.18	39
超長期 (11-)	90	86.08	86.29	13.10	0.67	2.00	1.86	12.43	12.31	12.41	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6月末、7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	295	96.02	96.12	6.30	0.56	1.16	1.14	5.95	5.90	5.94	47
短期 (1-3)	70	99.30	99.39	1.87	0.24	0.61	0.61	1.86	1.85	1.86	34
中期 (3-7)	105	96.30	96.42	5.52	0.39	1.06	1.04	5.43	5.40	5.43	43
長期 (7-)	120	93.85	93.94	9.56	0.90	1.60	1.55	8.93	8.86	8.91	58
長期 (7-11)	95	95.77	95.84	7.97	0.84	1.43	1.40	7.72	7.66	7.71	57
超長期 (11-)	25	86.56	86.73	15.61	1.13	2.32	2.16	14.02	13.86	13.95	64
ゴム製品	330	98.02	98.10	4.03	0.39	0.86	0.85	3.96	3.94	3.96	37
短期 (1-3)	140	99.13	99.18	2.36	0.28	0.65	0.65	2.35	2.34	2.35	32
中期 (3-7)	160	97.56	97.64	4.74	0.41	0.94	0.93	4.69	4.67	4.69	38
長期 (7-)	30	95.30	95.47	8.08	0.74	1.39	1.36	7.83	7.77	7.82	52
長期 (7-11)	30	95.30	95.47	8.08	0.74	1.39	1.36	7.83	7.77	7.82	52
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
ガラス・土石製品	277	96.22	96.31	5.44	0.48	1.04	1.01	5.09	5.05	5.08	42
短期 (1-3)	98	99.30	99.33	2.02	0.26	0.60	0.60	2.01	2.00	2.01	31
中期 (3-7)	102	97.42	97.49	4.62	0.43	0.99	0.98	4.56	4.54	4.56	45
長期 (7-)	77	90.74	90.92	10.86	0.81	1.72	1.63	10.08	10.00	10.07	53
長期 (7-11)	52	95.51	95.64	8.72	0.82	1.40	1.37	8.41	8.36	8.41	45
超長期 (11-)	25	80.77	81.06	15.35	0.80	2.51	2.26	14.21	14.05	14.17	73
鉄鋼	453	98.06	98.14	4.35	0.53	0.94	0.93	4.21	4.19	4.21	43
短期 (1-3)	160	99.18	99.23	2.20	0.30	0.67	0.67	2.19	2.18	2.19	35
中期 (3-7)	230	98.08	98.16	4.44	0.55	0.97	0.97	4.39	4.36	4.39	45
長期 (7-)	63	95.14	95.32	9.46	1.02	1.56	1.52	8.90	8.83	8.89	54
長期 (7-11)	53	97.02	97.23	8.61	1.03	1.43	1.41	8.22	8.17	8.22	51
超長期 (11-)	10	85.19	85.23	13.96	0.95	2.36	2.19	13.01	12.87	12.98	77
非鉄金属	380	97.92	98.05	4.53	0.47	0.94	0.93	4.42	4.40	4.42	40
短期 (1-3)	130	98.95	99.02	2.36	0.27	0.73	0.72	2.35	2.34	2.35	39
中期 (3-7)	190	97.98	98.10	4.68	0.54	0.97	0.96	4.62	4.59	4.62	42
長期 (7-)	60	95.49	95.81	8.74	0.72	1.32	1.29	8.44	8.39	8.44	36
長期 (7-11)	60	95.49	95.81	8.74	0.72	1.32	1.29	8.44	8.39	8.44	36
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
金属製品	150	98.13	98.24	3.90	0.42	0.88	0.87	3.84	3.82	3.84	40
短期 (1-3)	35	99.10	99.13	2.06	0.23	0.67	0.67	2.06	2.05	2.06	37
中期 (3-7)	106	98.09	98.22	4.15	0.46	0.91	0.90	4.10	4.08	4.10	41
長期 (7-)	9	94.80	95.03	8.16	0.70	1.42	1.38	7.92	7.87	7.92	52
長期 (7-11)	9	94.80	95.03	8.16	0.70	1.42	1.38	7.92	7.87	7.92	52
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
機械	1,308	97.79	97.88	4.26	0.41	0.90	0.88	4.17	4.14	4.17	39
短期 (1-3)	516	99.16	99.22	2.10	0.27	0.66	0.66	2.10	2.09	2.10	35
中期 (3-7)	559	97.57	97.67	4.63	0.44	0.95	0.94	4.57	4.54	4.57	41
長期 (7-)	233	95.25	95.41	8.18	0.65	1.31	1.28	7.95	7.90	7.95	42
長期 (7-11)	233	95.25	95.41	8.18	0.65	1.31	1.28	7.95	7.90	7.95	42
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
電気機器	2,085	98.31	98.43	4.31	0.51	0.89	0.88	4.21	4.19	4.21	38
短期 (1-3)	780	99.34	99.42	2.17	0.33	0.64	0.64	2.16	2.15	2.16	33
中期 (3-7)	1,040	97.92	98.04	4.76	0.51	0.95	0.94	4.69	4.67	4.69	39
長期 (7-)	265	96.76	97.02	8.88	1.00	1.43	1.41	8.48	8.42	8.48	47
長期 (7-11)	265	96.76	97.02	8.88	1.00	1.43	1.41	8.48	8.42	8.48	47
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
輸送用機器	1,130	97.14	97.23	4.60	0.40	0.94	0.92	4.39	4.37	4.39	39
短期 (1-3)	534	99.04	99.11	2.18	0.26	0.70	0.70	2.17	2.16	2.17	39
中期 (3-7)	392	97.52	97.62	4.79	0.43	0.94	0.93	4.72	4.70	4.72	38
長期 (7-)	204	91.41	91.56	10.56	0.70	1.60	1.52	10.01	9.93	10.00	43
長期 (7-11)	114	95.62	95.72	8.55	0.72	1.31	1.28	8.29	8.24	8.29	38
超長期 (11-)	90	86.08	86.29	13.10	0.67	2.00	1.86	12.43	12.31	12.41	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6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	265	98.11	98.22	4.36	0.55	0.94	0.93	4.24	4.22	4.24	43
短期 (1-3)	105	99.56	99.63	2.09	0.36	0.60	0.59	2.08	2.07	2.08	30
中期 (3-7)	125	97.57	97.69	5.13	0.60	1.07	1.06	5.05	5.02	5.05	49
長期 (7-)	35	95.72	95.91	8.38	0.97	1.56	1.53	8.04	7.98	8.04	65
長期 (7-11)	35	95.72	95.91	8.38	0.97	1.56	1.53	8.04	7.98	8.04	65
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
その他製品	215	95.24	95.36	6.40	0.48	1.09	1.05	5.95	5.91	5.94	38
短期 (1-3)	55	99.27	99.36	1.71	0.32	0.72	0.72	1.70	1.69	1.70	46
中期 (3-7)	100	97.82	97.91	5.21	0.49	0.93	0.92	5.14	5.12	5.14	34
長期 (7-)	60	87.26	87.44	12.69	0.61	1.76	1.64	11.89	11.79	11.87	37
長期 (7-11)	15	96.27	96.44	7.19	0.55	1.11	1.09	7.04	7.01	7.04	34
超長期 (11-)	45	84.25	84.44	14.53	0.63	2.01	1.85	13.73	13.61	13.71	38
電気・ガス業	12,342	94.66	94.84	8.01	0.77	1.30	1.25	7.02	6.96	6.99	47
短期 (1-3)	2,824	99.58	99.68	2.07	0.46	0.65	0.65	2.06	2.05	2.06	35
中期 (3-7)	4,167	98.30	98.47	4.92	0.73	1.06	1.05	4.81	4.79	4.81	50
長期 (7-)	5,351	89.24	89.46	13.54	0.97	1.88	1.77	11.81	11.70	11.76	52
長期 (7-11)	2,494	95.90	96.11	8.65	0.94	1.49	1.46	8.28	8.22	8.28	55
超長期 (11-)	2,857	83.42	83.65	17.81	0.99	2.28	2.09	15.36	15.19	15.26	50
陸運業	6,095	90.37	90.64	13.27	0.99	1.49	1.38	10.11	10.01	10.00	35
短期 (1-3)	832	100.37	100.55	1.94	0.73	0.59	0.59	1.92	1.92	1.92	30
中期 (3-7)	1,650	100.68	100.96	5.10	1.09	0.89	0.89	4.95	4.92	4.95	33
長期 (7-)	3,613	83.36	83.65	19.62	1.01	2.07	1.87	15.22	15.06	15.02	37
長期 (7-11)	1,020	98.63	98.94	8.79	1.11	1.28	1.28	8.35	8.30	8.35	35
超長期 (11-)	2,593	77.35	77.64	23.88	0.98	2.47	2.17	18.66	18.44	18.37	37
海運業	141	98.84	99.07	4.92	0.88	1.05	1.05	4.76	4.73	4.76	49
短期 (1-3)	25	101.11	101.21	1.84	1.26	0.70	0.70	1.82	1.81	1.82	42
中期 (3-7)	86	98.23	98.43	4.50	0.59	1.00	0.99	4.44	4.42	4.44	47
長期 (7-)	30	98.71	99.14	8.69	1.41	1.51	1.50	8.16	8.10	8.15	59
長期 (7-11)	30	98.71	99.14	8.69	1.41	1.51	1.50	8.16	8.10	8.15	59
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
空運業	235	91.70	91.79	7.45	0.72	1.65	1.56	6.62	6.55	6.61	80
短期 (1-3)	90	99.37	99.47	2.13	0.65	0.96	0.95	2.12	2.11	2.12	64
中期 (3-7)	40	95.77	95.82	4.86	0.36	1.27	1.24	4.81	4.78	4.81	69
長期 (7-)	105	83.58	83.67	12.99	0.92	2.53	2.31	12.00	11.86	11.98	100
長期 (7-11)	20	96.26	96.29	8.97	1.20	1.68	1.65	8.52	8.45	8.51	71
超長期 (11-)	85	80.59	80.70	13.94	0.86	2.77	2.50	12.98	12.82	12.95	108
倉庫・運輸関連業	159	95.05	95.18	6.59	0.56	1.28	1.24	6.24	6.20	6.24	55
短期 (1-3)	17	99.79	99.83	1.34	0.40	0.58	0.58	1.34	1.34	1.34	36
中期 (3-7)	95	96.33	96.44	5.30	0.45	1.18	1.16	5.22	5.19	5.22	57
長期 (7-)	47	90.68	90.91	11.16	0.85	1.80	1.71	10.42	10.33	10.41	57
長期 (7-11)	27	95.71	96.02	8.58	0.94	1.56	1.52	8.22	8.15	8.21	62
超長期 (11-)	20	84.01	84.14	14.59	0.72	2.16	1.98	13.75	13.62	13.72	51
情報・通信業	2,225	96.77	96.98	4.52	0.86	1.44	1.41	4.19	4.15	4.18	90
短期 (1-3)	874	99.28	99.42	1.90	0.62	1.00	0.99	1.88	1.87	1.88	71
中期 (3-7)	984	97.45	97.67	4.64	0.89	1.44	1.42	4.52	4.49	4.52	89
長期 (7-)	368	88.98	89.31	10.46	1.34	2.64	2.48	9.30	9.18	9.28	144
長期 (7-11)	250	92.77	93.08	8.48	1.16	2.18	2.10	8.03	7.94	8.02	121
超長期 (11-)	118	80.94	81.28	14.66	1.73	3.76	3.40	12.41	12.20	12.34	198
卸売業	1,279	97.76	97.99	6.51	0.89	1.10	1.08	6.12	6.09	6.12	38
短期 (1-3)	200	100.60	100.77	2.06	0.98	0.69	0.69	2.04	2.03	2.04	40
中期 (3-7)	600	99.36	99.59	4.86	0.80	0.94	0.94	4.76	4.73	4.76	39
長期 (7-)	479	94.58	94.82	10.44	0.98	1.49	1.44	9.73	9.66	9.72	37
長期 (7-11)	334	98.19	98.42	8.76	1.04	1.27	1.26	8.36	8.31	8.35	34
超長期 (11-)	145	86.26	86.54	14.32	0.82	2.06	1.92	13.34	13.21	13.31	47

出所:NFRC

- 東証 33 業種分類を参考に NFRC で分類



## 事業債 業種別・ポートフォリオ指標 (3/4) (2024年6月末、7月ポートフォリオ)

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
精密機器	240	97.94	98.05	4.70	0.58	0.99	0.98	4.58	4.55	4.58	44
短期 (1-3)	80	99.50	99.57	2.41	0.39	0.63	0.62	2.40	2.39	2.40	29
中期 (3-7)	125	97.57	97.69	5.13	0.60	1.07	1.06	5.05	5.02	5.05	49
長期 (7-)	35	95.72	95.91	8.38	0.97	1.56	1.53	8.04	7.98	8.04	65
長期 (7-11)	35	95.72	95.91	8.38	0.97	1.56	1.53	8.04	7.98	8.04	65
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
その他製品	190	94.66	94.78	7.11	0.52	1.17	1.13	6.63	6.59	6.63	39
短期 (1-3)	30	98.92	99.00	2.27	0.41	0.88	0.88	2.26	2.25	2.26	56
中期 (3-7)	100	97.82	97.91	5.21	0.49	0.93	0.92	5.14	5.12	5.14	34
長期 (7-)	60	87.26	87.44	12.69	0.61	1.76	1.64	11.89	11.79	11.87	37
長期 (7-11)	15	96.27	96.44	7.19	0.55	1.11	1.09	7.04	7.01	7.04	34
超長期 (11-)	45	84.25	84.44	14.53	0.63	2.01	1.85	13.73	13.61	13.71	38
電気・ガス業	12,232	94.60	94.77	8.22	0.79	1.32	1.27	7.21	7.15	7.19	48
短期 (1-3)	2,672	99.53	99.63	2.22	0.47	0.67	0.67	2.21	2.20	2.21	35
中期 (3-7)	4,107	98.24	98.42	5.00	0.73	1.07	1.06	4.89	4.87	4.89	50
長期 (7-)	5,453	89.43	89.65	13.59	0.99	1.88	1.77	11.85	11.73	11.79	52
長期 (7-11)	2,640	95.93	96.15	8.78	0.97	1.50	1.48	8.39	8.33	8.39	55
超長期 (11-)	2,813	83.33	83.54	18.09	1.00	2.29	2.10	15.58	15.41	15.47	49
陸運業	6,085	90.35	90.63	13.36	1.00	1.50	1.39	10.19	10.10	10.09	35
短期 (1-3)	787	100.38	100.57	2.03	0.76	0.60	0.60	2.01	2.00	2.01	31
中期 (3-7)	1,690	100.66	100.94	5.15	1.09	0.90	0.90	5.00	4.98	5.00	33
長期 (7-)	3,608	83.34	83.63	19.69	1.02	2.08	1.87	15.28	15.12	15.08	37
長期 (7-11)	1,025	98.61	98.92	8.91	1.12	1.30	1.29	8.46	8.41	8.46	35
超長期 (11-)	2,583	77.28	77.56	23.96	0.98	2.47	2.17	18.73	18.51	18.43	37
海運業	163	98.83	99.05	5.34	0.92	1.09	1.08	5.15	5.12	5.15	48
短期 (1-3)	20	101.42	101.50	2.03	1.46	0.72	0.72	2.01	2.00	2.01	42
中期 (3-7)	103	98.41	98.60	4.57	0.63	1.00	0.99	4.50	4.48	4.50	46
長期 (7-)	40	98.62	98.97	8.99	1.38	1.51	1.50	8.44	8.38	8.43	56
長期 (7-11)	40	98.62	98.97	8.99	1.38	1.51	1.50	8.44	8.38	8.43	56
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
空運業	315	93.52	93.63	8.31	0.98	1.71	1.64	7.48	7.41	7.47	79
短期 (1-3)	90	99.37	99.47	2.13	0.65	0.96	0.95	2.12	2.11	2.12	64
中期 (3-7)	40	95.77	95.82	4.86	0.36	1.27	1.24	4.81	4.78	4.81	69
長期 (7-)	185	90.19	90.31	12.06	1.28	2.22	2.10	10.97	10.85	10.94	88
長期 (7-11)	85	98.34	98.47	9.68	1.53	1.74	1.72	9.01	8.94	9.00	71
超長期 (11-)	100	83.26	83.38	14.08	1.07	2.71	2.48	12.92	12.76	12.89	106
倉庫・運輸関連業	159	95.05	95.18	6.59	0.56	1.28	1.24	6.24	6.20	6.24	55
短期 (1-3)	17	99.79	99.83	1.34	0.40	0.58	0.58	1.34	1.34	1.34	36
中期 (3-7)	105	96.03	96.15	5.46	0.46	1.22	1.20	5.37	5.34	5.37	60
長期 (7-)	37	90.02	90.24	12.30	0.93	1.84	1.74	11.42	11.32	11.41	49
長期 (7-11)	17	97.29	97.63	9.51	1.18	1.50	1.48	8.99	8.93	8.98	48
超長期 (11-)	20	84.01	84.14	14.59	0.72	2.16	1.98	13.75	13.62	13.72	51
情報・通信業	2,199	96.74	96.94	4.69	0.89	1.47	1.44	4.34	4.31	4.34	91
短期 (1-3)	810	99.22	99.36	2.06	0.66	1.04	1.04	2.04	2.03	2.04	74
中期 (3-7)	1,052	97.42	97.64	4.76	0.91	1.45	1.43	4.63	4.60	4.63	88
長期 (7-)	338	88.66	88.99	10.76	1.40	2.72	2.55	9.52	9.40	9.50	148
長期 (7-11)	220	92.78	93.10	8.67	1.23	2.23	2.15	8.18	8.09	8.17	124
超長期 (11-)	118	80.94	81.28	14.66	1.73	3.76	3.40	12.41	12.20	12.34	198
卸売業	1,279	97.76	97.99	6.51	0.89	1.10	1.08	6.12	6.09	6.12	38
短期 (1-3)	220	100.46	100.62	2.15	0.92	0.69	0.69	2.13	2.12	2.13	39
中期 (3-7)	605	99.49	99.73	5.01	0.84	0.96	0.95	4.90	4.87	4.90	39
長期 (7-)	454	94.16	94.39	10.63	0.95	1.51	1.46	9.92	9.84	9.90	37
長期 (7-11)	309	97.87	98.07	8.90	1.02	1.29	1.27	8.50	8.44	8.49	33
超長期 (11-)	145	86.26	86.54	14.32	0.82	2.06	1.92	13.34	13.21	13.31	47

出所:NFRC

- 東証 33 業種分類を参考に NFRC で分類

## 事業債 業種別・ポートフォリオ指標 (4/4) (2024年6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	1,224	98.61	98.70	4.09	0.57	0.87	0.86	3.94	3.92	3.94	38
短期 (1-3)	499	99.53	99.57	1.81	0.36	0.59	0.59	1.80	1.80	1.80	32
中期 (3-7)	548	98.75	98.87	4.30	0.60	0.92	0.91	4.24	4.22	4.24	41
長期 (7-)	177	95.57	95.73	9.86	1.03	1.52	1.48	9.27	9.20	9.26	46
長期 (7-11)	137	97.85	98.06	8.66	1.07	1.39	1.37	8.27	8.21	8.26	46
超長期 (11-)	40	87.75	87.77	13.93	0.88	2.01	1.88	13.07	12.95	13.05	46
銀行業	1,377	100.27	100.49	3.43	1.23	1.05	1.05	3.34	3.32	3.34	63
短期 (1-3)	687	101.09	101.34	1.99	1.44	0.93	0.94	1.96	1.95	1.96	65
中期 (3-7)	672	99.55	99.74	4.77	1.02	1.16	1.16	4.64	4.62	4.64	62
長期 (7-)	18	96.20	96.27	8.68	0.83	1.32	1.29	8.38	8.32	8.37	38
長期 (7-11)	18	96.20	96.27	8.68	0.83	1.32	1.29	8.38	8.32	8.37	38
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
証券、商品先物取引業	1,083	99.35	99.52	2.43	0.88	1.09	1.08	2.40	2.38	2.40	75
短期 (1-3)	805	99.57	99.74	1.90	0.87	1.03	1.03	1.89	1.88	1.89	75
中期 (3-7)	274	98.79	98.98	3.90	0.90	1.23	1.22	3.83	3.81	3.83	75
長期 (7-)	5	93.18	93.46	8.18	0.90	1.86	1.80	7.87	7.80	7.87	94
長期 (7-11)	5	93.18	93.46	8.18	0.90	1.86	1.80	7.87	7.80	7.87	94
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
保険業	335	98.15	98.22	3.70	0.38	0.86	0.85	3.63	3.61	3.63	40
短期 (1-3)	155	98.83	98.86	2.34	0.19	0.70	0.70	2.33	2.33	2.33	37
中期 (3-7)	130	98.66	98.75	3.57	0.45	0.84	0.83	3.54	3.52	3.54	39
長期 (7-)	50	94.74	94.89	8.30	0.75	1.46	1.42	8.04	7.98	8.04	55
長期 (7-11)	50	94.74	94.89	8.30	0.75	1.46	1.42	8.04	7.98	8.04	55
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
その他金融業	6,056	98.14	98.22	3.92	0.44	0.87	0.86	3.81	3.79	3.81	40
短期 (1-3)	2,772	99.24	99.30	2.00	0.31	0.69	0.68	2.00	1.99	2.00	39
中期 (3-7)	2,599	98.02	98.12	4.62	0.50	0.93	0.92	4.56	4.54	4.56	38
長期 (7-)	686	94.17	94.28	8.98	0.75	1.47	1.42	8.57	8.51	8.56	49
長期 (7-11)	608	95.43	95.55	8.29	0.72	1.37	1.33	8.04	7.99	8.04	46
超長期 (11-)	78	84.28	84.43	14.37	0.96	2.42	2.23	13.24	13.09	13.20	78
不動産業	2,620	94.87	95.04	7.71	0.72	1.25	1.21	6.68	6.63	6.66	46
短期 (1-3)	466	99.42	99.52	2.11	0.40	0.70	0.69	2.10	2.09	2.10	39
中期 (3-7)	1,118	98.06	98.21	4.66	0.60	0.99	0.98	4.58	4.56	4.58	44
長期 (7-)	1,036	89.38	89.60	13.53	0.98	1.84	1.73	11.46	11.35	11.39	52
長期 (7-11)	563	96.55	96.74	8.63	0.97	1.42	1.39	8.27	8.21	8.26	49
超長期 (11-)	473	80.84	81.09	19.36	1.00	2.45	2.21	16.00	15.82	15.84	58
サービス業	819	90.70	90.79	4.85	0.59	2.12	1.90	4.30	4.24	4.30	139
短期 (1-3)	307	98.40	98.47	1.80	0.33	1.08	1.07	1.79	1.77	1.79	80
中期 (3-7)	302	96.41	96.54	4.75	0.46	1.24	1.20	4.68	4.65	4.68	66
長期 (7-)	210	71.21	71.30	9.44	1.14	5.92	4.97	8.64	8.43	8.63	400
長期 (7-11)	160	74.07	74.15	8.32	1.04	5.59	4.79	7.84	7.66	7.84	393
超長期 (11-)	50	62.06	62.19	13.00	1.45	7.19	5.65	11.70	11.39	11.66	430
財投機関債	20,432	95.55	95.75	9.50	0.78	1.06	1.01	7.86	7.80	7.80	17
短期 (1-3)	5,687	99.75	99.84	2.04	0.34	0.46	0.46	2.03	2.02	2.03	16
中期 (3-7)	6,094	100.06	100.25	4.63	0.72	0.69	0.69	4.54	4.52	4.54	16
長期 (7-)	8,652	89.62	89.90	17.84	1.12	1.78	1.67	14.72	14.58	14.58	19
長期 (7-11)	2,422	99.44	99.65	8.66	1.01	1.09	1.08	8.28	8.23	8.27	17
超長期 (11-)	6,230	85.81	86.12	21.41	1.16	2.09	1.94	17.62	17.44	17.43	19

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6月末、7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	1,214	98.59	98.68	4.11	0.56	0.87	0.86	3.97	3.94	3.96	38
短期 (1-3)	489	99.50	99.54	1.82	0.34	0.59	0.59	1.82	1.81	1.82	32
中期 (3-7)	548	98.75	98.87	4.30	0.60	0.92	0.91	4.24	4.22	4.24	41
長期 (7-)	177	95.57	95.73	9.86	1.03	1.52	1.48	9.27	9.20	9.26	46
長期 (7-11)	137	97.85	98.06	8.66	1.07	1.39	1.37	8.27	8.21	8.26	46
超長期 (11-)	40	87.75	87.77	13.93	0.88	2.01	1.88	13.07	12.95	13.05	46
銀行業	1,337	100.29	100.51	3.51	1.26	1.06	1.06	3.41	3.39	3.41	63
短期 (1-3)	667	101.20	101.47	2.07	1.51	0.94	0.95	2.04	2.04	2.04	65
中期 (3-7)	652	99.47	99.65	4.83	1.01	1.17	1.17	4.70	4.67	4.70	62
長期 (7-)	18	96.20	96.27	8.68	0.83	1.32	1.29	8.38	8.32	8.37	38
長期 (7-11)	18	96.20	96.27	8.68	0.83	1.32	1.29	8.38	8.32	8.37	38
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
証券、商品先物取引業	1,031	99.32	99.48	2.50	0.87	1.09	1.08	2.47	2.45	2.47	74
短期 (1-3)	775	99.54	99.70	1.99	0.87	1.04	1.04	1.97	1.96	1.97	75
中期 (3-7)	252	98.74	98.90	3.97	0.87	1.21	1.20	3.91	3.88	3.90	72
長期 (7-)	5	93.18	93.46	8.18	0.90	1.86	1.80	7.87	7.80	7.87	94
長期 (7-11)	5	93.18	93.46	8.18	0.90	1.86	1.80	7.87	7.80	7.87	94
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
保険業	335	98.15	98.22	3.70	0.38	0.86	0.85	3.63	3.61	3.63	40
短期 (1-3)	165	98.84	98.87	2.38	0.20	0.70	0.70	2.38	2.37	2.38	36
中期 (3-7)	120	98.64	98.72	3.61	0.46	0.84	0.84	3.58	3.56	3.58	39
長期 (7-)	50	94.74	94.89	8.30	0.75	1.46	1.42	8.04	7.98	8.04	55
長期 (7-11)	50	94.74	94.89	8.30	0.75	1.46	1.42	8.04	7.98	8.04	55
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
その他金融業	6,150	98.17	98.25	3.96	0.45	0.88	0.87	3.85	3.83	3.85	40
短期 (1-3)	2,833	99.23	99.30	2.06	0.31	0.69	0.69	2.05	2.05	2.05	39
中期 (3-7)	2,652	98.02	98.12	4.71	0.52	0.94	0.93	4.64	4.62	4.64	39
長期 (7-)	666	94.23	94.35	9.06	0.77	1.48	1.42	8.64	8.57	8.63	48
長期 (7-11)	588	95.55	95.66	8.36	0.74	1.36	1.33	8.10	8.04	8.09	45
超長期 (11-)	78	84.28	84.43	14.37	0.96	2.42	2.23	13.24	13.09	13.20	78
不動産業	2,620	94.86	95.03	7.82	0.73	1.26	1.22	6.78	6.73	6.76	46
短期 (1-3)	531	99.33	99.44	2.34	0.42	0.72	0.72	2.33	2.32	2.33	39
中期 (3-7)	1,038	97.93	98.07	4.84	0.61	1.02	1.01	4.75	4.73	4.75	46
長期 (7-)	1,051	89.58	89.80	13.52	1.00	1.84	1.72	11.46	11.36	11.40	51
長期 (7-11)	578	96.73	96.92	8.74	1.00	1.41	1.39	8.36	8.30	8.35	47
超長期 (11-)	473	80.84	81.09	19.36	1.00	2.45	2.21	16.00	15.82	15.84	58
サービス業	769	90.11	90.20	5.09	0.61	2.24	2.01	4.54	4.48	4.54	147
短期 (1-3)	267	98.17	98.22	1.99	0.36	1.19	1.17	1.98	1.96	1.98	88
中期 (3-7)	292	96.32	96.45	4.81	0.47	1.26	1.22	4.74	4.71	4.74	67
長期 (7-)	210	71.21	71.30	9.44	1.14	5.92	4.97	8.64	8.43	8.63	400
長期 (7-11)	160	74.07	74.15	8.32	1.04	5.59	4.79	7.84	7.66	7.84	393
超長期 (11-)	50	62.06	62.19	13.00	1.45	7.19	5.65	11.70	11.39	11.66	430
財投機関債	20,628	95.59	95.79	9.49	0.79	1.06	1.01	7.86	7.80	7.81	17
短期 (1-3)	5,687	99.78	99.87	2.06	0.35	0.46	0.46	2.05	2.05	2.05	16
中期 (3-7)	6,387	99.92	100.10	4.71	0.70	0.70	0.70	4.62	4.60	4.62	16
長期 (7-)	8,554	89.58	89.86	18.00	1.14	1.79	1.68	14.84	14.70	14.71	19
長期 (7-11)	2,302	99.69	99.91	8.77	1.06	1.10	1.09	8.36	8.32	8.36	17
超長期 (11-)	6,252	85.85	86.16	21.40	1.16	2.09	1.93	17.61	17.43	17.42	19

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6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	73,172	95.84	96.01	7.30	0.73	1.14	1.10	6.24	6.20	6.22	40
短期 (1-3)	22,788	99.57	99.67	2.03	0.47	0.68	0.67	2.02	2.01	2.02	38
中期 (3-7)	26,514	98.74	98.91	4.67	0.69	0.95	0.94	4.58	4.56	4.58	41
長期 (7-)	23,871	89.05	89.30	15.26	1.02	1.86	1.74	12.79	12.67	12.70	42
長期 (7-11)	10,225	96.61	96.82	8.56	0.94	1.40	1.37	8.21	8.15	8.20	47
超長期 (11-)	13,646	83.39	83.66	20.29	1.08	2.26	2.06	16.77	16.60	16.60	38
AAA~A 格	72,305	95.81	95.98	7.34	0.73	1.13	1.10	6.28	6.23	6.25	40
短期 (1-3)	22,340	99.57	99.67	2.03	0.46	0.67	0.67	2.02	2.01	2.02	37
中期 (3-7)	26,189	98.75	98.92	4.67	0.68	0.94	0.94	4.58	4.56	4.58	40
長期 (7-)	23,777	89.05	89.29	15.28	1.02	1.86	1.74	12.81	12.69	12.71	42
長期 (7-11)	10,174	96.62	96.83	8.56	0.94	1.40	1.37	8.21	8.15	8.20	47
超長期 (11-)	13,603	83.38	83.66	20.31	1.08	2.26	2.06	16.79	16.61	16.62	38
AAA~AA 格	51,383	95.49	95.66	8.12	0.71	1.08	1.04	6.78	6.73	6.74	30
短期 (1-3)	15,272	99.65	99.74	2.04	0.41	0.58	0.58	2.03	2.03	2.03	28
中期 (3-7)	17,768	99.09	99.24	4.69	0.67	0.85	0.84	4.61	4.59	4.61	31
長期 (7-)	18,344	88.55	88.79	16.49	1.00	1.80	1.68	13.58	13.45	13.46	30
長期 (7-11)	7,119	97.37	97.56	8.56	0.89	1.25	1.23	8.22	8.17	8.22	33
超長期 (11-)	11,225	82.95	83.23	21.53	1.07	2.21	2.02	17.56	17.38	17.37	28
AAA 格	10,900	96.96	97.04	5.58	0.38	0.77	0.75	4.80	4.77	4.78	20
短期 (1-3)	4,380	99.34	99.37	1.99	0.16	0.49	0.48	1.99	1.99	1.99	19
中期 (3-7)	4,550	98.48	98.58	4.58	0.42	0.74	0.73	4.53	4.51	4.52	20
長期 (7-)	1,970	88.17	88.33	15.85	0.80	1.60	1.47	12.55	12.44	12.42	24
長期 (7-11)	1,168	96.44	96.55	8.35	0.65	1.13	1.11	8.12	8.07	8.11	23
超長期 (11-)	802	76.12	76.36	26.76	1.02	2.46	2.14	20.71	20.48	20.36	24
AA 格	40,484	95.10	95.29	8.80	0.80	1.17	1.12	7.33	7.27	7.28	32
短期 (1-3)	10,892	99.78	99.89	2.06	0.51	0.62	0.62	2.05	2.04	2.05	32
中期 (3-7)	13,218	99.29	99.47	4.73	0.75	0.89	0.88	4.63	4.61	4.63	34
長期 (7-)	16,374	88.59	88.85	16.57	1.03	1.83	1.70	13.70	13.58	13.59	31
長期 (7-11)	5,951	97.55	97.76	8.60	0.94	1.27	1.25	8.24	8.19	8.24	35
超長期 (11-)	10,423	83.48	83.76	21.12	1.08	2.20	2.01	17.34	17.16	17.16	28
A 格	20,922	96.60	96.78	5.45	0.76	1.27	1.23	5.05	5.01	5.04	64
短期 (1-3)	7,068	99.39	99.51	2.00	0.57	0.86	0.86	1.99	1.98	1.99	57
中期 (3-7)	8,421	98.05	98.23	4.63	0.72	1.14	1.13	4.54	4.51	4.54	60
長期 (7-)	5,433	90.73	90.97	11.20	1.07	2.05	1.93	10.25	10.15	10.23	81
長期 (7-11)	3,055	94.87	95.11	8.58	1.05	1.77	1.70	8.17	8.10	8.17	80
超長期 (11-)	2,379	85.43	85.66	14.56	1.09	2.44	2.26	13.22	13.07	13.18	81
BBB 格	867	97.97	98.13	3.85	0.82	1.23	1.21	3.65	3.62	3.64	76
短期 (1-3)	448	99.41	99.54	1.90	0.72	1.01	1.00	1.88	1.87	1.88	72
中期 (3-7)	325	98.14	98.35	4.57	0.90	1.30	1.29	4.46	4.43	4.46	76
長期 (7-)	94	90.44	90.68	10.73	1.06	2.11	2.00	9.84	9.73	9.82	92
長期 (7-11)	51	94.74	94.96	7.83	0.93	1.71	1.67	7.53	7.47	7.53	85
超長期 (11-)	43	85.30	85.57	14.19	1.21	2.63	2.44	12.89	12.74	12.85	102

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6月末、7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	73,045	95.83	96.00	7.41	0.74	1.15	1.11	6.34	6.29	6.31	40
短期 (1-3)	22,508	99.55	99.65	2.12	0.48	0.69	0.69	2.11	2.10	2.11	38
中期 (3-7)	26,654	98.70	98.86	4.76	0.69	0.96	0.95	4.67	4.65	4.67	41
長期 (7-)	23,882	89.11	89.35	15.35	1.04	1.87	1.75	12.86	12.74	12.77	42
長期 (7-11)	10,237	96.69	96.90	8.67	0.97	1.42	1.39	8.30	8.24	8.29	48
超長期 (11-)	13,645	83.42	83.69	20.36	1.08	2.26	2.06	16.83	16.65	16.66	38
AAA~A 格	72,008	95.79	95.96	7.45	0.74	1.15	1.11	6.37	6.33	6.35	40
短期 (1-3)	22,028	99.55	99.66	2.12	0.47	0.68	0.68	2.11	2.10	2.11	37
中期 (3-7)	26,224	98.71	98.87	4.76	0.69	0.95	0.94	4.67	4.65	4.67	40
長期 (7-)	23,756	89.09	89.33	15.37	1.03	1.87	1.75	12.87	12.75	12.78	42
長期 (7-11)	10,170	96.69	96.90	8.67	0.97	1.42	1.39	8.30	8.24	8.29	47
超長期 (11-)	13,586	83.39	83.67	20.38	1.08	2.26	2.06	16.84	16.66	16.67	37
AAA~AA 格	51,472	95.49	95.66	8.18	0.72	1.09	1.05	6.85	6.80	6.81	30
短期 (1-3)	15,126	99.65	99.74	2.10	0.42	0.59	0.59	2.09	2.08	2.09	28
中期 (3-7)	18,066	99.04	99.19	4.76	0.67	0.86	0.85	4.67	4.65	4.67	31
長期 (7-)	18,280	88.55	88.80	16.60	1.02	1.81	1.69	13.67	13.54	13.55	30
長期 (7-11)	7,015	97.45	97.64	8.65	0.92	1.26	1.24	8.30	8.25	8.30	33
超長期 (11-)	11,265	83.01	83.29	21.55	1.08	2.22	2.02	17.58	17.40	17.38	28
AAA 格	11,060	97.00	97.08	5.60	0.39	0.78	0.75	4.83	4.81	4.81	20
短期 (1-3)	4,350	99.33	99.36	2.02	0.16	0.49	0.49	2.02	2.01	2.02	19
中期 (3-7)	4,842	98.45	98.54	4.66	0.43	0.74	0.74	4.61	4.59	4.61	20
長期 (7-)	1,869	87.84	88.01	16.33	0.84	1.64	1.51	12.88	12.76	12.75	24
長期 (7-11)	1,067	96.65	96.76	8.50	0.71	1.15	1.13	8.24	8.19	8.24	24
超長期 (11-)	802	76.12	76.36	26.76	1.02	2.46	2.14	20.71	20.48	20.36	24
AA 格	40,411	95.08	95.27	8.89	0.81	1.17	1.13	7.41	7.35	7.36	32
短期 (1-3)	10,776	99.78	99.90	2.13	0.53	0.63	0.63	2.12	2.11	2.12	32
中期 (3-7)	13,225	99.26	99.43	4.80	0.76	0.90	0.89	4.70	4.68	4.70	35
長期 (7-)	16,411	88.63	88.89	16.63	1.04	1.83	1.71	13.76	13.63	13.64	31
長期 (7-11)	5,948	97.60	97.80	8.68	0.96	1.27	1.26	8.31	8.26	8.31	35
超長期 (11-)	10,463	83.54	83.82	21.15	1.08	2.20	2.01	17.36	17.18	17.18	28
A 格	20,536	96.54	96.71	5.61	0.78	1.29	1.25	5.20	5.16	5.20	64
短期 (1-3)	6,903	99.34	99.47	2.16	0.59	0.88	0.88	2.15	2.14	2.15	57
中期 (3-7)	8,157	97.97	98.14	4.75	0.73	1.16	1.15	4.65	4.63	4.65	61
長期 (7-)	5,476	90.87	91.10	11.25	1.09	2.05	1.94	10.30	10.20	10.28	81
長期 (7-11)	3,155	94.99	95.23	8.72	1.09	1.78	1.72	8.29	8.22	8.28	80
超長期 (11-)	2,322	85.27	85.49	14.70	1.10	2.46	2.27	13.34	13.19	13.30	82
BBB 格	1,037	98.28	98.42	4.44	0.93	1.28	1.27	4.17	4.14	4.16	76
短期 (1-3)	480	99.44	99.54	2.08	0.73	1.02	1.02	2.07	2.06	2.07	72
中期 (3-7)	431	98.48	98.65	4.85	0.99	1.32	1.31	4.72	4.69	4.72	76
長期 (7-)	126	93.17	93.39	12.03	1.47	2.19	2.11	10.70	10.58	10.65	92
長期 (7-11)	67	96.78	96.97	8.76	1.37	1.83	1.81	8.23	8.16	8.23	89
超長期 (11-)	59	89.05	89.30	15.76	1.58	2.63	2.50	13.74	13.57	13.65	97

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6月末、7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	50,117	95.39	95.56	8.31	0.72	1.09	1.05	6.95	6.89	6.91	29
短期(1-3)	14,443	99.65	99.74	2.10	0.41	0.57	0.57	2.09	2.08	2.09	27
中期(3-7)	17,465	99.03	99.19	4.78	0.66	0.85	0.84	4.69	4.67	4.69	30
長期(7-)	18,209	88.52	88.76	16.63	1.02	1.81	1.69	13.69	13.56	13.57	30
長期(7-11)	6,948	97.46	97.64	8.65	0.92	1.25	1.24	8.31	8.25	8.30	33
超長期(11-)	11,260	83.00	83.29	21.55	1.08	2.22	2.02	17.58	17.40	17.39	28
AAA~A格	68,929	95.65	95.82	7.62	0.72	1.14	1.10	6.50	6.45	6.47	38
短期(1-3)	20,424	99.54	99.64	2.11	0.44	0.65	0.65	2.10	2.09	2.10	34
中期(3-7)	25,026	98.71	98.87	4.78	0.67	0.93	0.93	4.70	4.67	4.70	38
長期(7-)	23,480	89.00	89.24	15.42	1.02	1.86	1.74	12.92	12.79	12.82	41
長期(7-11)	10,019	96.70	96.90	8.67	0.97	1.41	1.38	8.30	8.25	8.30	47
超長期(11-)	13,460	83.27	83.54	20.44	1.07	2.25	2.05	16.90	16.72	16.73	36
AAA~BBB格	69,496	95.67	95.83	7.58	0.72	1.14	1.10	6.48	6.43	6.45	38
短期(1-3)	20,725	99.54	99.63	2.11	0.44	0.66	0.65	2.10	2.09	2.10	35
中期(3-7)	25,246	98.70	98.86	4.78	0.67	0.94	0.93	4.69	4.67	4.69	38
長期(7-)	23,525	89.00	89.24	15.41	1.02	1.86	1.74	12.91	12.79	12.81	41
長期(7-11)	10,044	96.69	96.90	8.67	0.97	1.41	1.38	8.30	8.24	8.29	47
超長期(11-)	13,480	83.27	83.54	20.43	1.07	2.25	2.05	16.89	16.72	16.72	36
AAA~BB格	69,496	95.67	95.83	7.58	0.72	1.14	1.10	6.48	6.43	6.45	38
短期(1-3)	20,725	99.54	99.63	2.11	0.44	0.66	0.65	2.10	2.09	2.10	35
中期(3-7)	25,246	98.70	98.86	4.78	0.67	0.94	0.93	4.69	4.67	4.69	38
長期(7-)	23,525	89.00	89.24	15.41	1.02	1.86	1.74	12.91	12.79	12.81	41
長期(7-11)	10,044	96.69	96.90	8.67	0.97	1.41	1.38	8.30	8.24	8.29	47
超長期(11-)	13,480	83.27	83.54	20.43	1.07	2.25	2.05	16.89	16.72	16.72	36
AAA格	11,060	97.00	97.08	5.60	0.39	0.78	0.75	4.83	4.81	4.81	20
短期(1-3)	4,350	99.33	99.36	2.02	0.16	0.49	0.49	2.02	2.01	2.02	19
中期(3-7)	4,842	98.45	98.54	4.66	0.43	0.74	0.74	4.61	4.59	4.61	20
長期(7-)	1,869	87.84	88.01	16.33	0.84	1.64	1.51	12.88	12.76	12.75	24
長期(7-11)	1,067	96.65	96.76	8.50	0.71	1.15	1.13	8.24	8.19	8.24	24
超長期(11-)	802	76.12	76.36	26.76	1.02	2.46	2.14	20.71	20.48	20.36	24
AA格	39,056	94.93	95.13	9.08	0.81	1.18	1.13	7.56	7.50	7.51	32
短期(1-3)	10,093	99.78	99.90	2.13	0.51	0.61	0.61	2.12	2.11	2.12	30
中期(3-7)	12,623	99.26	99.43	4.82	0.75	0.89	0.88	4.73	4.71	4.73	33
長期(7-)	16,340	88.60	88.85	16.66	1.04	1.83	1.71	13.78	13.65	13.67	31
長期(7-11)	5,881	97.60	97.80	8.68	0.95	1.27	1.26	8.32	8.27	8.31	34
超長期(11-)	10,458	83.53	83.82	21.15	1.08	2.20	2.01	17.37	17.19	17.18	28
A格	18,813	96.34	96.51	5.76	0.74	1.27	1.23	5.34	5.30	5.33	61
短期(1-3)	5,981	99.30	99.41	2.14	0.51	0.83	0.83	2.12	2.12	2.12	52
中期(3-7)	7,561	97.96	98.13	4.79	0.71	1.13	1.12	4.70	4.67	4.70	57
長期(7-)	5,271	90.66	90.89	11.24	1.05	2.03	1.91	10.31	10.20	10.28	79
長期(7-11)	3,071	94.98	95.22	8.72	1.08	1.77	1.71	8.29	8.22	8.29	79
超長期(11-)	2,200	84.64	84.85	14.76	1.02	2.44	2.24	13.45	13.31	13.41	78
BBB格	566	97.73	97.88	3.66	0.69	1.20	1.18	3.49	3.46	3.49	75
短期(1-3)	302	99.22	99.32	1.96	0.62	1.02	1.02	1.95	1.94	1.95	73
中期(3-7)	220	97.50	97.70	4.52	0.75	1.30	1.28	4.43	4.40	4.42	76
長期(7-)	45	88.82	89.14	10.78	0.83	2.02	1.90	9.94	9.84	9.92	82
長期(7-11)	25	94.09	94.36	7.54	0.74	1.62	1.57	7.31	7.26	7.31	79
超長期(11-)	20	82.22	82.61	14.83	0.93	2.59	2.36	13.68	13.52	13.64	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6月末)

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
AAA～AA格	11,044	95.41	95.52	7.22	0.61	1.03	0.99	5.94	5.90	5.90	33
短期(1-3)	3,594	99.62	99.69	2.02	0.42	0.59	0.59	2.01	2.01	2.01	30
中期(3-7)	4,425	98.62	98.73	4.59	0.59	0.89	0.89	4.52	4.50	4.52	36
長期(7-)	3,025	85.70	85.88	17.22	0.89	1.86	1.71	13.74	13.60	13.60	34
長期(7-11)	1,270	96.52	96.66	8.67	0.83	1.29	1.27	8.35	8.30	8.35	36
超長期(11-)	1,755	77.88	78.08	23.41	0.93	2.37	2.10	18.56	18.36	18.30	32
AAA～A格	66,770	95.65	95.81	7.55	0.71	1.12	1.08	6.43	6.38	6.40	37
短期(1-3)	20,161	99.57	99.67	2.02	0.43	0.63	0.63	2.01	2.00	2.01	34
中期(3-7)	23,742	98.74	98.90	4.70	0.66	0.91	0.91	4.61	4.59	4.61	37
長期(7-)	22,868	88.97	89.22	15.37	1.01	1.85	1.73	12.86	12.74	12.77	41
長期(7-11)	9,737	96.66	96.86	8.56	0.94	1.39	1.36	8.21	8.15	8.20	46
超長期(11-)	13,131	83.27	83.55	20.42	1.06	2.25	2.05	16.86	16.69	16.69	36
AAA～BBB格	69,548	95.67	95.84	7.48	0.71	1.13	1.09	6.38	6.33	6.35	38
短期(1-3)	21,091	99.56	99.65	2.02	0.43	0.64	0.64	2.01	2.00	2.01	35
中期(3-7)	24,927	98.72	98.88	4.70	0.66	0.92	0.91	4.61	4.59	4.61	38
長期(7-)	23,530	88.96	89.20	15.32	1.01	1.85	1.73	12.84	12.72	12.74	41
長期(7-11)	10,058	96.62	96.82	8.56	0.93	1.39	1.36	8.21	8.15	8.20	46
超長期(11-)	13,472	83.24	83.52	20.37	1.06	2.25	2.05	16.85	16.67	16.67	36
AAA～BB格	69,788	95.69	95.86	7.47	0.71	1.13	1.09	6.38	6.33	6.35	38
短期(1-3)	21,091	99.56	99.65	2.02	0.43	0.64	0.64	2.01	2.00	2.01	35
中期(3-7)	25,142	98.75	98.91	4.70	0.67	0.93	0.92	4.61	4.59	4.61	38
長期(7-)	23,555	88.96	89.21	15.32	1.01	1.85	1.73	12.84	12.72	12.74	41
長期(7-11)	10,058	96.62	96.82	8.56	0.93	1.39	1.36	8.21	8.15	8.20	46
超長期(11-)	13,497	83.26	83.53	20.36	1.06	2.25	2.05	16.84	16.66	16.67	37
AAA格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA格	11,044	95.41	95.52	7.22	0.61	1.03	0.99	5.94	5.90	5.90	33
短期(1-3)	3,594	99.62	99.69	2.02	0.42	0.59	0.59	2.01	2.01	2.01	30
中期(3-7)	4,425	98.62	98.73	4.59	0.59	0.89	0.89	4.52	4.50	4.52	36
長期(7-)	3,025	85.70	85.88	17.22	0.89	1.86	1.71	13.74	13.60	13.60	34
長期(7-11)	1,270	96.52	96.66	8.67	0.83	1.29	1.27	8.35	8.30	8.35	36
超長期(11-)	1,755	77.88	78.08	23.41	0.93	2.37	2.10	18.56	18.36	18.30	32
A格	55,726	95.69	95.87	7.61	0.73	1.14	1.10	6.52	6.47	6.49	38
短期(1-3)	16,567	99.57	99.66	2.02	0.43	0.64	0.64	2.01	2.00	2.01	35
中期(3-7)	19,316	98.77	98.94	4.72	0.67	0.92	0.91	4.63	4.61	4.63	37
長期(7-)	19,843	89.47	89.72	15.09	1.03	1.85	1.73	12.74	12.62	12.65	42
長期(7-11)	8,466	96.68	96.89	8.55	0.95	1.40	1.37	8.19	8.13	8.18	48
超長期(11-)	11,377	84.10	84.39	19.96	1.08	2.23	2.04	16.62	16.45	16.46	37
BBB格	2,777	96.30	96.44	5.87	0.67	1.18	1.14	5.29	5.25	5.28	53
短期(1-3)	930	99.15	99.25	1.99	0.49	0.88	0.88	1.98	1.97	1.98	59
中期(3-7)	1,185	98.38	98.53	4.63	0.67	1.04	1.03	4.55	4.53	4.55	49
長期(7-)	663	88.56	88.75	13.55	0.91	1.91	1.78	11.97	11.85	11.92	52
長期(7-11)	322	95.37	95.55	8.45	0.86	1.50	1.46	8.14	8.08	8.14	57
超長期(11-)	341	82.13	82.35	18.36	0.95	2.35	2.14	16.15	15.98	16.05	47
BB格	240	100.46	100.91	5.92	2.26	2.01	2.01	5.34	5.28	5.33	138
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	215	101.46	101.93	4.75	2.25	1.90	1.91	4.51	4.47	4.51	137
長期(7-)	25	91.88	92.08	15.92	2.37	3.13	3.01	13.19	12.99	13.09	149
長期(7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期(11-)	25	91.88	92.08	15.92	2.37	3.13	3.01	13.19	12.99	13.09	149
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 Moody's 格付別・ポートフォリオ指標 (2024年6月末)

	額面 (10 億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
AAA~AA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AAA~A 格	22,665	95.80	96.01	8.73	0.77	1.08	1.04	7.30	7.24	7.26	25
短期 (1-3)	6,607	99.67	99.76	2.06	0.37	0.53	0.53	2.05	2.04	2.05	23
中期 (3-7)	7,131	99.42	99.61	4.62	0.67	0.77	0.76	4.54	4.52	4.54	23
長期 (7-)	8,928	90.06	90.35	16.95	1.13	1.80	1.70	14.03	13.90	13.91	27
長期 (7-11)	3,091	98.27	98.49	8.73	0.98	1.22	1.21	8.35	8.30	8.35	29
超長期 (11-)	5,837	85.71	86.05	21.30	1.21	2.16	2.00	17.46	17.28	17.28	26
AAA~BBB 格	24,713	95.83	96.03	8.60	0.77	1.09	1.05	7.22	7.16	7.18	27
短期 (1-3)	6,961	99.65	99.75	2.05	0.37	0.53	0.53	2.04	2.04	2.04	23
中期 (3-7)	8,207	99.39	99.59	4.64	0.71	0.81	0.81	4.55	4.53	4.55	28
長期 (7-)	9,545	89.97	90.26	16.77	1.12	1.81	1.70	13.92	13.79	13.81	29
長期 (7-11)	3,362	98.11	98.33	8.72	0.97	1.23	1.22	8.35	8.30	8.34	30
超長期 (11-)	6,183	85.55	85.88	21.14	1.21	2.17	2.01	17.39	17.21	17.21	28
AAA~BB 格	24,713	95.83	96.03	8.60	0.77	1.09	1.05	7.22	7.16	7.18	27
短期 (1-3)	6,961	99.65	99.75	2.05	0.37	0.53	0.53	2.04	2.04	2.04	23
中期 (3-7)	8,207	99.39	99.59	4.64	0.71	0.81	0.81	4.55	4.53	4.55	28
長期 (7-)	9,545	89.97	90.26	16.77	1.12	1.81	1.70	13.92	13.79	13.81	29
長期 (7-11)	3,362	98.11	98.33	8.72	0.97	1.23	1.22	8.35	8.30	8.34	30
超長期 (11-)	6,183	85.55	85.88	21.14	1.21	2.17	2.01	17.39	17.21	17.21	28
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	22,665	95.80	96.01	8.73	0.77	1.08	1.04	7.30	7.24	7.26	25
短期 (1-3)	6,607	99.67	99.76	2.06	0.37	0.53	0.53	2.05	2.04	2.05	23
中期 (3-7)	7,131	99.42	99.61	4.62	0.67	0.77	0.76	4.54	4.52	4.54	23
長期 (7-)	8,928	90.06	90.35	16.95	1.13	1.80	1.70	14.03	13.90	13.91	27
長期 (7-11)	3,091	98.27	98.49	8.73	0.98	1.22	1.21	8.35	8.30	8.35	29
超長期 (11-)	5,837	85.71	86.05	21.30	1.21	2.16	2.00	17.46	17.28	17.28	26
BBB 格	2,048	96.09	96.26	7.10	0.84	1.24	1.20	6.32	6.27	6.30	49
短期 (1-3)	355	99.35	99.42	2.00	0.29	0.59	0.59	1.99	1.99	1.99	30
中期 (3-7)	1,076	99.21	99.41	4.76	0.94	1.11	1.11	4.65	4.62	4.65	57
長期 (7-)	617	88.77	88.96	14.10	0.97	1.90	1.78	12.36	12.24	12.30	48
長期 (7-11)	271	96.36	96.53	8.63	0.87	1.36	1.33	8.30	8.24	8.30	42
超長期 (11-)	346	82.83	83.03	18.39	1.05	2.40	2.19	16.06	15.88	15.95	53
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	45,075	95.61	95.76	6.86	0.68	1.15	1.11	5.91	5.87	5.89	44
短期 (1-3)	14,129	99.51	99.60	2.00	0.46	0.70	0.70	1.99	1.98	1.99	41
中期 (3-7)	16,934	98.43	98.58	4.72	0.65	0.99	0.98	4.64	4.61	4.64	44
長期 (7-)	14,011	88.27	88.49	14.34	0.93	1.88	1.75	12.09	11.97	12.01	50
長期 (7-11)	6,696	95.87	96.06	8.48	0.92	1.48	1.44	8.13	8.08	8.13	55
超長期 (11-)	7,315	81.32	81.55	19.70	0.94	2.32	2.09	16.35	16.17	16.18	45

出所:NFRFC

- 格付は、Moody's の格付をもとに NFRFC で分類

## 事業債 Moody's 格付別・ポートフォリオ指標 (2024年6月末、7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											
短期 (1-3)	22,918	95.84	96.05	8.78	0.78	1.08	1.05	7.36	7.30	7.31	25
中期 (3-7)	6,666	99.69	99.79	2.11	0.39	0.54	0.54	2.10	2.10	2.10	23
長期 (7-)	7,278	99.32	99.50	4.72	0.66	0.77	0.77	4.63	4.62	4.63	23
長期 (7-11)	8,974	90.17	90.46	17.04	1.16	1.81	1.71	14.09	13.96	13.97	27
超長期 (11-)	3,073	98.45	98.68	8.85	1.03	1.23	1.23	8.45	8.40	8.44	29
	5,901	85.85	86.18	21.30	1.22	2.16	2.00	17.46	17.28	17.27	26
AAA ~ BBB 格											
短期 (1-3)	24,942	95.86	96.06	8.67	0.78	1.10	1.06	7.29	7.23	7.25	27
中期 (3-7)	6,996	99.67	99.77	2.12	0.39	0.54	0.54	2.11	2.10	2.11	23
長期 (7-)	8,334	99.30	99.49	4.73	0.70	0.82	0.81	4.64	4.62	4.64	27
長期 (7-11)	9,613	90.09	90.38	16.84	1.15	1.82	1.71	13.98	13.85	13.86	29
超長期 (11-)	3,370	98.28	98.49	8.85	1.02	1.25	1.24	8.45	8.39	8.44	31
	6,243	85.67	86.00	21.15	1.21	2.17	2.01	17.40	17.22	17.21	28
AAA ~ BB 格											
短期 (1-3)	24,942	95.86	96.06	8.67	0.78	1.10	1.06	7.29	7.23	7.25	27
中期 (3-7)	6,996	99.67	99.77	2.12	0.39	0.54	0.54	2.11	2.10	2.11	23
長期 (7-)	8,334	99.30	99.49	4.73	0.70	0.82	0.81	4.64	4.62	4.64	27
長期 (7-11)	9,613	90.09	90.38	16.84	1.15	1.82	1.71	13.98	13.85	13.86	29
超長期 (11-)	3,370	98.28	98.49	8.85	1.02	1.25	1.24	8.45	8.39	8.44	31
	6,243	85.67	86.00	21.15	1.21	2.17	2.01	17.40	17.22	17.21	28
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											
短期 (1-3)	22,918	95.84	96.05	8.78	0.78	1.08	1.05	7.36	7.30	7.31	25
中期 (3-7)	6,666	99.69	99.79	2.11	0.39	0.54	0.54	2.10	2.10	2.10	23
長期 (7-)	7,278	99.32	99.50	4.72	0.66	0.77	0.77	4.63	4.62	4.63	23
長期 (7-11)	8,974	90.17	90.46	17.04	1.16	1.81	1.71	14.09	13.96	13.97	27
超長期 (11-)	3,073	98.45	98.68	8.85	1.03	1.23	1.23	8.45	8.40	8.44	29
	5,901	85.85	86.18	21.30	1.22	2.16	2.00	17.46	17.28	17.27	26
BBB 格											
短期 (1-3)	2,024	96.02	96.19	7.32	0.86	1.26	1.23	6.52	6.47	6.50	50
中期 (3-7)	330	99.24	99.29	2.25	0.29	0.62	0.62	2.24	2.24	2.24	30
長期 (7-)	1,056	99.22	99.42	4.81	0.96	1.12	1.12	4.70	4.67	4.70	57
長期 (7-11)	638	89.06	89.25	14.08	0.99	1.90	1.78	12.33	12.21	12.27	48
超長期 (11-)	297	96.44	96.61	8.78	0.91	1.38	1.35	8.42	8.37	8.42	43
	341	82.65	82.85	18.69	1.07	2.43	2.22	16.29	16.11	16.18	53
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)	44,554	95.56	95.71	6.98	0.69	1.16	1.12	6.02	5.98	6.00	45
中期 (3-7)	13,730	99.47	99.57	2.10	0.47	0.71	0.71	2.09	2.08	2.09	41
長期 (7-)	16,912	98.40	98.55	4.81	0.66	0.99	0.99	4.72	4.69	4.72	44
長期 (7-11)	13,912	88.24	88.46	14.43	0.94	1.89	1.76	12.16	12.04	12.08	50
超長期 (11-)	6,674	95.89	96.09	8.58	0.94	1.49	1.45	8.22	8.16	8.22	55
	7,238	81.19	81.42	19.81	0.94	2.33	2.10	16.44	16.26	16.27	44

出所:NFRC

- 格付は、Moody's の格付をもとに NFRC で分類





## 事業債 S&amp;P 格付別・ポートフォリオ指標 (2024年6月末、7月ポートフォリオ)

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
AAA~AA 格	851	84.82	84.97	17.88	0.98	1.83	1.65	13.81	13.67	13.68	30
短期 (1-3)	40	103.08	103.14	2.49	1.75	0.58	0.59	2.45	2.44	2.45	25
中期 (3-7)	115	96.00	96.03	5.75	0.22	0.93	0.91	5.70	5.67	5.70	29
長期 (7-)	696	81.92	82.10	20.77	1.06	2.10	1.87	16.20	16.03	16.03	31
長期 (7-11)	212	100.10	100.28	8.96	1.25	1.24	1.24	8.48	8.43	8.47	30
超長期 (11-)	484	73.96	74.14	25.94	0.98	2.61	2.24	20.78	20.54	20.51	32
AAA~A 格	16,203	94.41	94.57	9.17	0.74	1.12	1.06	7.52	7.46	7.47	25
短期 (1-3)	3,995	99.84	99.92	2.10	0.43	0.53	0.53	2.09	2.09	2.09	23
中期 (3-7)	5,446	99.15	99.29	5.01	0.67	0.82	0.82	4.92	4.90	4.92	26
長期 (7-)	6,762	87.39	87.60	16.70	0.96	1.78	1.64	13.54	13.42	13.42	27
長期 (7-11)	2,738	98.61	98.81	8.68	1.02	1.19	1.18	8.30	8.25	8.29	27
超長期 (11-)	4,025	79.75	79.98	22.16	0.93	2.27	2.02	17.95	17.76	17.73	27
AAA~BBB 格	16,675	94.53	94.68	9.01	0.73	1.11	1.06	7.39	7.34	7.35	26
短期 (1-3)	4,251	99.80	99.88	2.10	0.44	0.55	0.55	2.09	2.08	2.09	25
中期 (3-7)	5,617	99.13	99.27	4.99	0.67	0.83	0.82	4.89	4.87	4.89	26
長期 (7-)	6,807	87.43	87.65	16.65	0.96	1.78	1.64	13.51	13.38	13.39	27
長期 (7-11)	2,772	98.59	98.78	8.67	1.02	1.19	1.19	8.29	8.24	8.29	27
超長期 (11-)	4,035	79.76	79.99	22.14	0.93	2.27	2.02	17.94	17.75	17.72	28
AAA~BB 格	16,915	94.61	94.77	8.97	0.75	1.13	1.07	7.36	7.31	7.32	28
短期 (1-3)	4,251	99.80	99.88	2.10	0.44	0.55	0.55	2.09	2.08	2.09	25
中期 (3-7)	5,832	99.22	99.37	4.98	0.73	0.87	0.86	4.88	4.86	4.88	30
長期 (7-)	6,832	87.45	87.66	16.65	0.97	1.78	1.64	13.51	13.38	13.39	28
長期 (7-11)	2,772	98.59	98.78	8.67	1.02	1.19	1.19	8.29	8.24	8.29	27
超長期 (11-)	4,060	79.84	80.07	22.10	0.94	2.28	2.03	17.90	17.71	17.69	28
AAA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA 格	851	84.82	84.97	17.88	0.98	1.83	1.65	13.81	13.67	13.68	30
短期 (1-3)	40	103.08	103.14	2.49	1.75	0.58	0.59	2.45	2.44	2.45	25
中期 (3-7)	115	96.00	96.03	5.75	0.22	0.93	0.91	5.70	5.67	5.70	29
長期 (7-)	696	81.92	82.10	20.77	1.06	2.10	1.87	16.20	16.03	16.03	31
長期 (7-11)	212	100.10	100.28	8.96	1.25	1.24	1.24	8.48	8.43	8.47	30
超長期 (11-)	484	73.96	74.14	25.94	0.98	2.61	2.24	20.78	20.54	20.51	32
A 格	15,352	94.94	95.10	8.69	0.72	1.08	1.03	7.21	7.15	7.16	25
短期 (1-3)	3,955	99.81	99.88	2.10	0.42	0.53	0.53	2.09	2.09	2.09	23
中期 (3-7)	5,331	99.22	99.36	5.00	0.68	0.82	0.82	4.90	4.88	4.90	26
長期 (7-)	6,066	88.01	88.23	16.23	0.95	1.74	1.61	13.26	13.14	13.14	27
長期 (7-11)	2,526	98.49	98.68	8.66	1.00	1.19	1.18	8.28	8.23	8.28	27
超長期 (11-)	3,541	80.54	80.78	21.64	0.92	2.23	2.00	17.60	17.41	17.39	27
BBB 格	473	98.51	98.64	3.44	0.58	0.95	0.95	3.33	3.31	3.33	52
短期 (1-3)	257	99.21	99.34	1.97	0.48	0.83	0.82	1.96	1.95	1.96	53
中期 (3-7)	172	98.57	98.68	4.06	0.63	0.98	0.98	4.00	3.98	4.00	49
長期 (7-)	45	94.23	94.45	9.51	0.97	1.60	1.55	8.92	8.85	8.91	57
長期 (7-11)	35	96.85	97.12	8.22	0.97	1.41	1.39	7.88	7.83	7.88	53
超長期 (11-)	10	85.19	85.23	13.96	0.95	2.36	2.19	13.01	12.87	12.98	77
BB 格	240	100.46	100.91	5.92	2.26	2.01	2.01	5.34	5.28	5.33	138
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	215	101.46	101.93	4.75	2.25	1.90	1.91	4.51	4.47	4.51	137
長期 (7-)	25	91.88	92.08	15.92	2.37	3.13	3.01	13.19	12.99	13.09	149
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	25	91.88	92.08	15.92	2.37	3.13	3.01	13.19	12.99	13.09	149
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	52,581	96.01	96.18	7.14	0.71	1.15	1.11	6.20	6.15	6.17	41
短期 (1-3)	16,474	99.47	99.57	2.11	0.44	0.68	0.68	2.10	2.09	2.10	38
中期 (3-7)	19,414	98.54	98.70	4.72	0.66	0.96	0.95	4.64	4.61	4.64	41
長期 (7-)	16,693	89.63	89.89	14.90	1.05	1.89	1.78	12.67	12.55	12.58	46
長期 (7-11)	7,272	95.97	96.17	8.67	0.95	1.49	1.45	8.30	8.24	8.30	54
超長期 (11-)	9,420	84.75	85.04	19.72	1.12	2.24	2.06	16.49	16.31	16.33	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6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	1,366	99.35	99.57	3.36	0.83	1.01	1.01	3.28	3.26	3.28	59
短期(1-3)	694	99.70	99.92	2.08	0.71	0.86	0.85	2.06	2.05	2.06	55
中期(3-7)	601	99.21	99.42	4.20	0.92	1.12	1.12	4.11	4.09	4.11	62
長期(7-)	71	97.10	97.40	8.85	1.21	1.61	1.59	8.33	8.26	8.32	67
長期(7-11)	67	97.25	97.55	8.51	1.16	1.56	1.54	8.09	8.03	8.09	65
超長期(11-)	4	94.59	95.17	14.26	1.99	2.51	2.44	12.20	12.05	12.13	104
AAA~A格	3,090	98.98	99.21	3.75	1.03	1.27	1.26	3.57	3.55	3.57	81
短期(1-3)	1,555	99.68	99.88	2.18	0.94	1.07	1.07	2.15	2.14	2.15	75
中期(3-7)	1,259	98.69	98.94	4.12	0.97	1.30	1.29	4.03	4.01	4.03	80
長期(7-)	276	96.36	96.73	10.91	1.86	2.32	2.27	9.66	9.55	9.63	117
長期(7-11)	150	96.13	96.51	8.55	1.34	1.89	1.85	8.05	7.97	8.04	96
超長期(11-)	126	96.65	97.00	13.74	2.49	2.83	2.77	11.58	11.42	11.52	142
AAA~BBB格	3,385	98.93	99.16	3.80	1.04	1.27	1.26	3.61	3.58	3.61	80
短期(1-3)	1,697	99.69	99.89	2.15	0.94	1.06	1.06	2.12	2.11	2.12	75
中期(3-7)	1,372	98.71	98.96	4.19	0.98	1.30	1.29	4.09	4.07	4.09	79
長期(7-)	315	95.78	96.12	11.00	1.81	2.32	2.26	9.76	9.65	9.73	115
長期(7-11)	166	96.19	96.54	8.57	1.35	1.89	1.85	8.07	7.99	8.06	96
超長期(11-)	149	95.33	95.65	13.72	2.34	2.81	2.73	11.67	11.52	11.61	138
AAA~BB格	3,385	98.93	99.16	3.80	1.04	1.27	1.26	3.61	3.58	3.61	80
短期(1-3)	1,697	99.69	99.89	2.15	0.94	1.06	1.06	2.12	2.11	2.12	75
中期(3-7)	1,372	98.71	98.96	4.19	0.98	1.30	1.29	4.09	4.07	4.09	79
長期(7-)	315	95.78	96.12	11.00	1.81	2.32	2.26	9.76	9.65	9.73	115
長期(7-11)	166	96.19	96.54	8.57	1.35	1.89	1.85	8.07	7.99	8.06	96
超長期(11-)	149	95.33	95.65	13.72	2.34	2.81	2.73	11.67	11.52	11.61	138
AAA格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA格	1,366	99.35	99.57	3.36	0.83	1.01	1.01	3.28	3.26	3.28	59
短期(1-3)	694	99.70	99.92	2.08	0.71	0.86	0.85	2.06	2.05	2.06	55
中期(3-7)	601	99.21	99.42	4.20	0.92	1.12	1.12	4.11	4.09	4.11	62
長期(7-)	71	97.10	97.40	8.85	1.21	1.61	1.59	8.33	8.26	8.32	67
長期(7-11)	67	97.25	97.55	8.51	1.16	1.56	1.54	8.09	8.03	8.09	65
超長期(11-)	4	94.59	95.17	14.26	1.99	2.51	2.44	12.20	12.05	12.13	104
A格	1,724	98.69	98.94	4.06	1.20	1.48	1.46	3.80	3.77	3.80	98
短期(1-3)	861	99.66	99.85	2.26	1.12	1.24	1.24	2.23	2.22	2.23	92
中期(3-7)	658	98.22	98.51	4.05	1.01	1.46	1.45	3.96	3.93	3.96	96
長期(7-)	205	96.11	96.50	11.63	2.09	2.56	2.51	10.13	10.00	10.09	134
長期(7-11)	84	95.23	95.68	8.58	1.47	2.15	2.11	8.01	7.93	8.00	121
超長期(11-)	122	96.72	97.06	13.72	2.51	2.84	2.78	11.56	11.40	11.50	143
BBB格	295	98.39	98.57	4.29	1.08	1.28	1.26	4.00	3.97	4.00	77
短期(1-3)	143	99.80	99.96	1.80	0.92	0.98	0.98	1.79	1.78	1.79	71
中期(3-7)	114	98.92	99.14	4.91	1.15	1.32	1.32	4.76	4.72	4.76	76
長期(7-)	39	91.64	91.78	11.62	1.46	2.33	2.23	10.50	10.38	10.47	105
長期(7-11)	16	96.77	96.89	8.80	1.47	1.89	1.86	8.25	8.18	8.25	94
超長期(11-)	23	88.02	88.17	13.62	1.45	2.67	2.51	12.24	12.09	12.20	114
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6月末、7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	1,355	99.35	99.56	3.38	0.83	1.01	1.01	3.30	3.28	3.30	58
短期 (1-3)	683	99.70	99.91	2.09	0.71	0.85	0.85	2.07	2.06	2.07	55
中期 (3-7)	601	99.21	99.42	4.20	0.92	1.12	1.12	4.11	4.09	4.11	62
長期 (7-)	71	97.10	97.40	8.85	1.21	1.61	1.59	8.33	8.26	8.32	67
長期 (7-11)	67	97.25	97.55	8.51	1.16	1.56	1.54	8.09	8.03	8.09	65
超長期 (11-)	4	94.59	95.17	14.26	1.99	2.51	2.44	12.20	12.05	12.13	104
AAA~A 格	3,078	98.98	99.21	3.76	1.04	1.27	1.26	3.58	3.56	3.58	81
短期 (1-3)	1,605	99.67	99.88	2.22	0.94	1.07	1.06	2.19	2.18	2.19	75
中期 (3-7)	1,197	98.65	98.89	4.18	0.98	1.31	1.30	4.09	4.06	4.09	80
長期 (7-)	276	96.36	96.73	10.91	1.86	2.32	2.27	9.66	9.55	9.63	117
長期 (7-11)	150	96.13	96.51	8.55	1.34	1.89	1.85	8.05	7.97	8.04	96
超長期 (11-)	126	96.65	97.00	13.74	2.49	2.83	2.77	11.58	11.42	11.52	142
AAA~BBB 格	3,549	98.97	99.19	3.98	1.06	1.28	1.27	3.77	3.74	3.76	80
短期 (1-3)	1,783	99.68	99.88	2.22	0.93	1.06	1.06	2.20	2.19	2.20	74
中期 (3-7)	1,408	98.78	99.00	4.33	1.02	1.31	1.31	4.23	4.20	4.23	80
長期 (7-)	357	96.19	96.51	11.33	1.85	2.31	2.26	9.98	9.87	9.95	112
長期 (7-11)	193	96.62	96.95	8.75	1.43	1.90	1.87	8.21	8.13	8.20	95
超長期 (11-)	165	95.68	96.00	14.33	2.36	2.79	2.72	12.08	11.92	12.01	132
AAA~BB 格	3,549	98.97	99.19	3.98	1.06	1.28	1.27	3.77	3.74	3.76	80
短期 (1-3)	1,783	99.68	99.88	2.22	0.93	1.06	1.06	2.20	2.19	2.20	74
中期 (3-7)	1,408	98.78	99.00	4.33	1.02	1.31	1.31	4.23	4.20	4.23	80
長期 (7-)	357	96.19	96.51	11.33	1.85	2.31	2.26	9.98	9.87	9.95	112
長期 (7-11)	193	96.62	96.95	8.75	1.43	1.90	1.87	8.21	8.13	8.20	95
超長期 (11-)	165	95.68	96.00	14.33	2.36	2.79	2.72	12.08	11.92	12.01	132
AAA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA 格	1,355	99.35	99.56	3.38	0.83	1.01	1.01	3.30	3.28	3.30	58
短期 (1-3)	683	99.70	99.91	2.09	0.71	0.85	0.85	2.07	2.06	2.07	55
中期 (3-7)	601	99.21	99.42	4.20	0.92	1.12	1.12	4.11	4.09	4.11	62
長期 (7-)	71	97.10	97.40	8.85	1.21	1.61	1.59	8.33	8.26	8.32	67
長期 (7-11)	67	97.25	97.55	8.51	1.16	1.56	1.54	8.09	8.03	8.09	65
超長期 (11-)	4	94.59	95.17	14.26	1.99	2.51	2.44	12.20	12.05	12.13	104
A 格	1,723	98.69	98.94	4.06	1.20	1.48	1.46	3.81	3.77	3.80	98
短期 (1-3)	922	99.65	99.85	2.31	1.10	1.22	1.22	2.28	2.27	2.28	90
中期 (3-7)	596	98.09	98.36	4.15	1.03	1.50	1.49	4.06	4.03	4.06	100
長期 (7-)	205	96.11	96.50	11.63	2.09	2.56	2.51	10.13	10.00	10.09	134
長期 (7-11)	84	95.23	95.68	8.58	1.47	2.15	2.11	8.01	7.93	8.00	121
超長期 (11-)	122	96.72	97.06	13.72	2.51	2.84	2.78	11.56	11.40	11.50	143
BBB 格	471	98.93	99.07	5.39	1.22	1.38	1.36	4.98	4.93	4.97	77
短期 (1-3)	178	99.80	99.91	2.29	0.91	1.03	1.03	2.27	2.25	2.27	70
中期 (3-7)	211	99.49	99.63	5.19	1.25	1.34	1.33	5.02	4.98	5.02	76
長期 (7-)	81	95.58	95.75	12.73	1.82	2.28	2.23	11.09	10.96	11.03	98
長期 (7-11)	42	98.38	98.52	9.49	1.74	1.95	1.94	8.76	8.67	8.75	94
超長期 (11-)	39	92.56	92.74	16.24	1.91	2.65	2.56	13.77	13.59	13.66	101
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6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	281	99.21	99.46	3.19	0.75	0.98	0.98	3.12	3.11	3.12	58
短期(1-3)	163	99.67	99.94	2.01	0.72	0.88	0.88	1.99	1.98	1.99	59
中期(3-7)	104	98.77	98.99	4.35	0.78	1.09	1.08	4.28	4.25	4.28	57
長期(7-)	14	97.03	97.33	8.38	0.94	1.38	1.36	8.05	8.00	8.05	47
長期(7-11)	14	97.03	97.33	8.38	0.94	1.38	1.36	8.05	8.00	8.05	47
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AAA~A格	2,041	99.57	99.76	3.58	0.96	1.09	1.09	3.45	3.42	3.44	65
短期(1-3)	1,077	99.81	99.98	2.15	0.87	0.96	0.95	2.13	2.12	2.13	65
中期(3-7)	812	99.21	99.43	4.11	0.94	1.13	1.13	4.03	4.01	4.03	64
長期(7-)	152	99.75	100.05	10.81	1.76	1.88	1.89	9.68	9.59	9.65	79
長期(7-11)	91	96.79	97.06	8.55	1.09	1.56	1.53	8.15	8.09	8.15	64
超長期(11-)	62	104.11	104.43	14.13	2.73	2.32	2.36	11.78	11.64	11.71	99
AAA~BBB格	3,385	98.93	99.16	3.80	1.04	1.27	1.26	3.61	3.58	3.61	80
短期(1-3)	1,697	99.69	99.89	2.15	0.94	1.06	1.06	2.12	2.11	2.12	75
中期(3-7)	1,372	98.71	98.96	4.19	0.98	1.30	1.29	4.09	4.07	4.09	79
長期(7-)	315	95.78	96.12	11.00	1.81	2.32	2.26	9.76	9.65	9.73	115
長期(7-11)	166	96.19	96.54	8.57	1.35	1.89	1.85	8.07	7.99	8.06	96
超長期(11-)	149	95.33	95.65	13.72	2.34	2.81	2.73	11.67	11.52	11.61	138
AAA~BB格	3,385	98.93	99.16	3.80	1.04	1.27	1.26	3.61	3.58	3.61	80
短期(1-3)	1,697	99.69	99.89	2.15	0.94	1.06	1.06	2.12	2.11	2.12	75
中期(3-7)	1,372	98.71	98.96	4.19	0.98	1.30	1.29	4.09	4.07	4.09	79
長期(7-)	315	95.78	96.12	11.00	1.81	2.32	2.26	9.76	9.65	9.73	115
長期(7-11)	166	96.19	96.54	8.57	1.35	1.89	1.85	8.07	7.99	8.06	96
超長期(11-)	149	95.33	95.65	13.72	2.34	2.81	2.73	11.67	11.52	11.61	138
AAA格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA格	281	99.21	99.46	3.19	0.75	0.98	0.98	3.12	3.11	3.12	58
短期(1-3)	163	99.67	99.94	2.01	0.72	0.88	0.88	1.99	1.98	1.99	59
中期(3-7)	104	98.77	98.99	4.35	0.78	1.09	1.08	4.28	4.25	4.28	57
長期(7-)	14	97.03	97.33	8.38	0.94	1.38	1.36	8.05	8.00	8.05	47
長期(7-11)	14	97.03	97.33	8.38	0.94	1.38	1.36	8.05	8.00	8.05	47
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
A格	1,760	99.63	99.81	3.64	1.00	1.11	1.11	3.50	3.48	3.49	66
短期(1-3)	914	99.84	99.98	2.17	0.89	0.97	0.97	2.15	2.14	2.15	66
中期(3-7)	708	99.28	99.49	4.07	0.96	1.14	1.13	3.99	3.97	3.99	64
長期(7-)	139	100.02	100.32	11.06	1.84	1.93	1.94	9.84	9.74	9.81	82
長期(7-11)	77	96.74	97.01	8.59	1.12	1.59	1.57	8.17	8.11	8.16	66
超長期(11-)	62	104.11	104.43	14.13	2.73	2.32	2.36	11.78	11.64	11.71	99
BBB格	1,344	97.95	98.24	4.13	1.15	1.54	1.52	3.86	3.83	3.86	104
短期(1-3)	621	99.47	99.73	2.14	1.06	1.24	1.24	2.12	2.10	2.12	93
中期(3-7)	560	97.98	98.27	4.29	1.05	1.55	1.53	4.19	4.16	4.19	102
長期(7-)	163	92.07	92.45	11.18	1.87	2.76	2.65	9.84	9.71	9.81	153
長期(7-11)	76	95.48	95.92	8.59	1.65	2.29	2.24	7.97	7.88	7.96	134
超長期(11-)	87	89.10	89.43	13.43	2.05	3.21	3.03	11.59	11.42	11.54	170
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6月末、7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	276	99.20	99.45	3.23	0.76	0.99	0.99	3.16	3.15	3.16	58
短期 (1-3)	158	99.67	99.94	2.04	0.73	0.89	0.89	2.02	2.01	2.02	59
中期 (3-7)	104	98.77	98.99	4.35	0.78	1.09	1.08	4.28	4.25	4.28	57
長期 (7-)	14	97.03	97.33	8.38	0.94	1.38	1.36	8.05	8.00	8.05	47
長期 (7-11)	14	97.03	97.33	8.38	0.94	1.38	1.36	8.05	8.00	8.05	47
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AAA~A 格	2,031	99.57	99.76	3.59	0.96	1.09	1.09	3.46	3.44	3.46	65
短期 (1-3)	1,128	99.80	99.97	2.21	0.87	0.96	0.96	2.18	2.17	2.18	64
中期 (3-7)	751	99.19	99.39	4.20	0.95	1.14	1.13	4.11	4.09	4.11	63
長期 (7-)	152	99.75	100.05	10.81	1.76	1.88	1.89	9.68	9.59	9.65	79
長期 (7-11)	91	96.79	97.06	8.55	1.09	1.56	1.53	8.15	8.09	8.15	64
超長期 (11-)	62	104.11	104.43	14.13	2.73	2.32	2.36	11.78	11.64	11.71	99
AAA~BBB 格	3,549	98.97	99.19	3.98	1.06	1.28	1.27	3.77	3.74	3.76	80
短期 (1-3)	1,783	99.68	99.88	2.22	0.93	1.06	1.06	2.20	2.19	2.20	74
中期 (3-7)	1,408	98.78	99.00	4.33	1.02	1.31	1.31	4.23	4.20	4.23	80
長期 (7-)	357	96.19	96.51	11.33	1.85	2.31	2.26	9.98	9.87	9.95	112
長期 (7-11)	193	96.62	96.95	8.75	1.43	1.90	1.87	8.21	8.13	8.20	95
超長期 (11-)	165	95.68	96.00	14.33	2.36	2.79	2.72	12.08	11.92	12.01	132
AAA~BB 格	3,549	98.97	99.19	3.98	1.06	1.28	1.27	3.77	3.74	3.76	80
短期 (1-3)	1,783	99.68	99.88	2.22	0.93	1.06	1.06	2.20	2.19	2.20	74
中期 (3-7)	1,408	98.78	99.00	4.33	1.02	1.31	1.31	4.23	4.20	4.23	80
長期 (7-)	357	96.19	96.51	11.33	1.85	2.31	2.26	9.98	9.87	9.95	112
長期 (7-11)	193	96.62	96.95	8.75	1.43	1.90	1.87	8.21	8.13	8.20	95
超長期 (11-)	165	95.68	96.00	14.33	2.36	2.79	2.72	12.08	11.92	12.01	132
AAA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA 格	276	99.20	99.45	3.23	0.76	0.99	0.99	3.16	3.15	3.16	58
短期 (1-3)	158	99.67	99.94	2.04	0.73	0.89	0.89	2.02	2.01	2.02	59
中期 (3-7)	104	98.77	98.99	4.35	0.78	1.09	1.08	4.28	4.25	4.28	57
長期 (7-)	14	97.03	97.33	8.38	0.94	1.38	1.36	8.05	8.00	8.05	47
長期 (7-11)	14	97.03	97.33	8.38	0.94	1.38	1.36	8.05	8.00	8.05	47
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
A 格	1,755	99.63	99.81	3.64	1.00	1.11	1.11	3.51	3.48	3.50	66
短期 (1-3)	970	99.82	99.98	2.23	0.89	0.97	0.97	2.21	2.20	2.21	65
中期 (3-7)	647	99.26	99.46	4.18	0.97	1.15	1.14	4.09	4.07	4.09	64
長期 (7-)	139	100.02	100.32	11.06	1.84	1.93	1.94	9.84	9.74	9.81	82
長期 (7-11)	77	96.74	97.01	8.59	1.12	1.59	1.57	8.17	8.11	8.16	66
超長期 (11-)	62	104.11	104.43	14.13	2.73	2.32	2.36	11.78	11.64	11.71	99
BBB 格	1,518	98.17	98.43	4.49	1.19	1.54	1.52	4.18	4.15	4.18	101
短期 (1-3)	655	99.49	99.72	2.26	1.05	1.24	1.24	2.23	2.22	2.23	92
中期 (3-7)	658	98.30	98.56	4.47	1.10	1.52	1.50	4.36	4.33	4.36	98
長期 (7-)	205	93.54	93.88	11.71	1.93	2.65	2.56	10.22	10.09	10.18	139
長期 (7-11)	102	96.47	96.85	8.93	1.72	2.21	2.17	8.25	8.17	8.25	124
超長期 (11-)	103	90.64	90.95	14.45	2.13	3.11	2.96	12.29	12.11	12.21	155
BB 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
B 格以下	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
格付なし	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
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&amp;I 格付別・ポートフォリオ指標 (2024年6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	100.35	100.99	2.02	1.37	1.20	1.21	1.98	1.97	1.98	91
短期 (1-3)	30	100.35	100.99	2.02	1.37	1.20	1.21	1.98	1.97	1.98	91
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AAA~A 格	754	98.96	99.18	3.31	0.98	1.25	1.25	3.23	3.21	3.23	83
短期 (1-3)	347	99.51	99.66	2.16	0.97	1.15	1.15	2.13	2.12	2.13	84
中期 (3-7)	378	98.77	99.06	3.97	1.00	1.32	1.31	3.89	3.86	3.89	83
長期 (7-)	29	94.86	95.16	8.35	0.96	1.68	1.64	8.01	7.94	8.00	76
長期 (7-11)	29	94.86	95.16	8.35	0.96	1.68	1.64	8.01	7.94	8.00	76
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AAA~BBB 格	766	98.77	99.00	3.44	0.99	1.27	1.26	3.34	3.31	3.34	84
短期 (1-3)	347	99.51	99.66	2.16	0.97	1.15	1.15	2.13	2.12	2.13	84
中期 (3-7)	378	98.77	99.06	3.97	1.00	1.32	1.31	3.89	3.86	3.89	83
長期 (7-)	41	92.51	92.74	9.51	1.06	1.97	1.89	8.90	8.82	8.89	91
長期 (7-11)	29	94.86	95.16	8.35	0.96	1.68	1.64	8.01	7.94	8.00	76
超長期 (11-)	11	86.51	86.58	12.45	1.32	2.78	2.59	11.42	11.28	11.40	131
AAA~BB 格	766	98.77	99.00	3.44	0.99	1.27	1.26	3.34	3.31	3.34	84
短期 (1-3)	347	99.51	99.66	2.16	0.97	1.15	1.15	2.13	2.12	2.13	84
中期 (3-7)	378	98.77	99.06	3.97	1.00	1.32	1.31	3.89	3.86	3.89	83
長期 (7-)	41	92.51	92.74	9.51	1.06	1.97	1.89	8.90	8.82	8.89	91
長期 (7-11)	29	94.86	95.16	8.35	0.96	1.68	1.64	8.01	7.94	8.00	76
超長期 (11-)	11	86.51	86.58	12.45	1.32	2.78	2.59	11.42	11.28	11.40	131
AAA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA 格	30	100.35	100.99	2.02	1.37	1.20	1.21	1.98	1.97	1.98	91
短期 (1-3)	30	100.35	100.99	2.02	1.37	1.20	1.21	1.98	1.97	1.98	91
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
A 格	724	98.90	99.11	3.36	0.97	1.25	1.25	3.28	3.26	3.28	83
短期 (1-3)	317	99.43	99.54	2.17	0.93	1.14	1.14	2.15	2.13	2.15	83
中期 (3-7)	378	98.77	99.06	3.97	1.00	1.32	1.31	3.89	3.86	3.89	83
長期 (7-)	29	94.86	95.16	8.35	0.96	1.68	1.64	8.01	7.94	8.00	76
長期 (7-11)	29	94.86	95.16	8.35	0.96	1.68	1.64	8.01	7.94	8.00	76
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
BBB 格	11	86.51	86.58	12.45	1.32	2.78	2.59	11.42	11.28	11.40	131
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	11	86.51	86.58	12.45	1.32	2.78	2.59	11.42	11.28	11.40	131
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	11	86.51	86.58	12.45	1.32	2.78	2.59	11.42	11.28	11.40	131
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	2,619	98.97	99.21	3.90	1.05	1.27	1.26	3.69	3.66	3.68	79
短期 (1-3)	1,351	99.74	99.94	2.14	0.93	1.04	1.04	2.12	2.11	2.12	73
中期 (3-7)	994	98.69	98.92	4.27	0.98	1.29	1.28	4.17	4.14	4.17	78
長期 (7-)	275	96.27	96.62	11.22	1.93	2.37	2.32	9.88	9.77	9.85	119
長期 (7-11)	137	96.47	96.84	8.62	1.43	1.93	1.90	8.08	8.00	8.07	100
超長期 (11-)	137	96.06	96.41	13.83	2.42	2.81	2.74	11.69	11.54	11.63	138

出所:NFRC

- 格付は、R&Iの格付をもとにNFRCで分類

## 円建外債 R&amp;I 格付別・ポートフォリオ指標 (2024年6月末、7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	100.35	100.99	2.02	1.37	1.20	1.21	1.98	1.97	1.98	91
短期 (1-3)	30	100.35	100.99	2.02	1.37	1.20	1.21	1.98	1.97	1.98	91
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AAA~A 格	754	98.96	99.18	3.31	0.98	1.25	1.25	3.23	3.21	3.23	83
短期 (1-3)	408	99.50	99.69	2.29	0.95	1.13	1.13	2.26	2.25	2.26	81
中期 (3-7)	317	98.63	98.89	4.16	1.02	1.37	1.36	4.07	4.04	4.07	86
長期 (7-)	29	94.86	95.16	8.35	0.96	1.68	1.64	8.01	7.94	8.00	76
長期 (7-11)	29	94.86	95.16	8.35	0.96	1.68	1.64	8.01	7.94	8.00	76
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AAA~BBB 格	766	98.77	99.00	3.44	0.99	1.27	1.26	3.34	3.31	3.34	84
短期 (1-3)	408	99.50	99.69	2.29	0.95	1.13	1.13	2.26	2.25	2.26	81
中期 (3-7)	317	98.63	98.89	4.16	1.02	1.37	1.36	4.07	4.04	4.07	86
長期 (7-)	41	92.51	92.74	9.51	1.06	1.97	1.89	8.90	8.82	8.89	91
長期 (7-11)	29	94.86	95.16	8.35	0.96	1.68	1.64	8.01	7.94	8.00	76
超長期 (11-)	11	86.51	86.58	12.45	1.32	2.78	2.59	11.42	11.28	11.40	131
AAA~BB 格	766	98.77	99.00	3.44	0.99	1.27	1.26	3.34	3.31	3.34	84
短期 (1-3)	408	99.50	99.69	2.29	0.95	1.13	1.13	2.26	2.25	2.26	81
中期 (3-7)	317	98.63	98.89	4.16	1.02	1.37	1.36	4.07	4.04	4.07	86
長期 (7-)	41	92.51	92.74	9.51	1.06	1.97	1.89	8.90	8.82	8.89	91
長期 (7-11)	29	94.86	95.16	8.35	0.96	1.68	1.64	8.01	7.94	8.00	76
超長期 (11-)	11	86.51	86.58	12.45	1.32	2.78	2.59	11.42	11.28	11.40	131
AAA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA 格	30	100.35	100.99	2.02	1.37	1.20	1.21	1.98	1.97	1.98	91
短期 (1-3)	30	100.35	100.99	2.02	1.37	1.20	1.21	1.98	1.97	1.98	91
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
A 格	724	98.90	99.11	3.36	0.97	1.25	1.25	3.28	3.26	3.28	83
短期 (1-3)	378	99.44	99.59	2.31	0.92	1.13	1.12	2.28	2.27	2.28	80
中期 (3-7)	317	98.63	98.89	4.16	1.02	1.37	1.36	4.07	4.04	4.07	86
長期 (7-)	29	94.86	95.16	8.35	0.96	1.68	1.64	8.01	7.94	8.00	76
長期 (7-11)	29	94.86	95.16	8.35	0.96	1.68	1.64	8.01	7.94	8.00	76
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
BBB 格	11	86.51	86.58	12.45	1.32	2.78	2.59	11.42	11.28	11.40	131
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	11	86.51	86.58	12.45	1.32	2.78	2.59	11.42	11.28	11.40	131
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	11	86.51	86.58	12.45	1.32	2.78	2.59	11.42	11.28	11.40	131
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	2,783	99.03	99.25	4.12	1.08	1.29	1.28	3.88	3.85	3.88	79
短期 (1-3)	1,375	99.74	99.94	2.21	0.93	1.04	1.04	2.18	2.17	2.18	73
中期 (3-7)	1,092	98.82	99.04	4.38	1.01	1.30	1.29	4.27	4.25	4.27	78
長期 (7-)	317	96.66	96.99	11.56	1.96	2.35	2.30	10.12	10.00	10.07	115
長期 (7-11)	163	96.93	97.27	8.82	1.51	1.94	1.91	8.24	8.16	8.23	99
超長期 (11-)	154	96.36	96.70	14.47	2.43	2.79	2.73	12.12	11.96	12.05	132

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6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	99.22	99.54	3.44	1.03	1.21	1.20	3.31	3.29	3.31	78
短期 (1-3)	165	99.82	100.19	2.31	0.94	1.05	1.04	2.28	2.27	2.28	72
中期 (3-7)	73	98.99	99.17	4.26	1.12	1.37	1.36	4.16	4.13	4.16	86
長期 (7-)	22	95.57	95.95	9.14	1.36	1.95	1.91	8.42	8.34	8.41	98
長期 (7-11)	18	95.80	96.13	7.94	1.21	1.82	1.79	7.55	7.49	7.55	96
超長期 (11-)	4	94.59	95.17	14.26	1.99	2.51	2.44	12.20	12.05	12.13	104
AAA~A 格	1,000	98.55	98.85	4.60	1.32	1.60	1.58	4.21	4.17	4.20	106
短期 (1-3)	527	99.85	100.13	2.26	1.16	1.24	1.23	2.23	2.22	2.23	92
中期 (3-7)	288	97.84	98.13	4.18	1.10	1.63	1.61	4.08	4.05	4.08	112
長期 (7-)	186	95.95	96.33	11.87	2.14	2.63	2.56	10.28	10.15	10.24	138
長期 (7-11)	73	95.52	96.00	8.51	1.62	2.26	2.21	7.90	7.81	7.89	133
超長期 (11-)	113	96.23	96.55	14.03	2.48	2.86	2.79	11.80	11.64	11.73	141
AAA~BBB 格	1,001	98.55	98.84	4.60	1.32	1.60	1.58	4.21	4.17	4.21	106
短期 (1-3)	527	99.85	100.13	2.26	1.16	1.24	1.23	2.23	2.22	2.23	92
中期 (3-7)	289	97.83	98.11	4.19	1.10	1.63	1.62	4.08	4.05	4.08	112
長期 (7-)	186	95.95	96.33	11.87	2.14	2.63	2.56	10.28	10.15	10.24	138
長期 (7-11)	73	95.52	96.00	8.51	1.62	2.26	2.21	7.90	7.81	7.89	133
超長期 (11-)	113	96.23	96.55	14.03	2.48	2.86	2.79	11.80	11.64	11.73	141
AAA~BB 格	1,001	98.55	98.84	4.60	1.32	1.60	1.58	4.21	4.17	4.21	106
短期 (1-3)	527	99.85	100.13	2.26	1.16	1.24	1.23	2.23	2.22	2.23	92
中期 (3-7)	289	97.83	98.11	4.19	1.10	1.63	1.62	4.08	4.05	4.08	112
長期 (7-)	186	95.95	96.33	11.87	2.14	2.63	2.56	10.28	10.15	10.24	138
長期 (7-11)	73	95.52	96.00	8.51	1.62	2.26	2.21	7.90	7.81	7.89	133
超長期 (11-)	113	96.23	96.55	14.03	2.48	2.86	2.79	11.80	11.64	11.73	141
AAA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA 格	260	99.22	99.54	3.44	1.03	1.21	1.20	3.31	3.29	3.31	78
短期 (1-3)	165	99.82	100.19	2.31	0.94	1.05	1.04	2.28	2.27	2.28	72
中期 (3-7)	73	98.99	99.17	4.26	1.12	1.37	1.36	4.16	4.13	4.16	86
長期 (7-)	22	95.57	95.95	9.14	1.36	1.95	1.91	8.42	8.34	8.41	98
長期 (7-11)	18	95.80	96.13	7.94	1.21	1.82	1.79	7.55	7.49	7.55	96
超長期 (11-)	4	94.59	95.17	14.26	1.99	2.51	2.44	12.20	12.05	12.13	104
A 格	740	98.32	98.61	5.00	1.43	1.74	1.72	4.53	4.49	4.52	115
短期 (1-3)	362	99.87	100.10	2.24	1.26	1.32	1.32	2.21	2.19	2.21	100
中期 (3-7)	215	97.45	97.77	4.16	1.10	1.72	1.70	4.05	4.02	4.05	121
長期 (7-)	163	96.01	96.39	12.24	2.25	2.72	2.65	10.53	10.39	10.48	144
長期 (7-11)	55	95.42	95.95	8.70	1.75	2.41	2.35	8.01	7.92	8.00	145
超長期 (11-)	109	96.30	96.60	14.02	2.50	2.87	2.80	11.79	11.62	11.72	143
BBB 格	1	92.97	93.26	5.23	1.05	2.57	2.49	5.08	5.02	5.08	191
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	1	92.97	93.26	5.23	1.05	2.57	2.49	5.08	5.02	5.08	191
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	2,384	99.09	99.29	3.46	0.92	1.13	1.13	3.36	3.34	3.36	70
短期 (1-3)	1,170	99.61	99.78	2.09	0.84	0.98	0.98	2.07	2.06	2.07	68
中期 (3-7)	1,084	98.94	99.18	4.19	0.95	1.21	1.20	4.10	4.07	4.10	71
長期 (7-)	130	95.54	95.82	9.76	1.34	1.88	1.83	9.01	8.93	9.00	83
長期 (7-11)	94	96.71	96.96	8.62	1.14	1.60	1.58	8.20	8.13	8.19	67
超長期 (11-)	36	92.47	92.81	12.75	1.87	2.63	2.54	11.26	11.12	11.22	125

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6月末、7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)
<hr/>											
AAA~AA格	255	99.21	99.54	3.48	1.04	1.22	1.22	3.35	3.33	3.35	79
短期(1-3)	160	99.82	100.20	2.35	0.96	1.06	1.06	2.32	2.30	2.32	73
中期(3-7)	73	98.99	99.17	4.26	1.12	1.37	1.36	4.16	4.13	4.16	86
長期(7-)	22	95.57	95.95	9.14	1.36	1.95	1.91	8.42	8.34	8.41	98
長期(7-11)	18	95.80	96.13	7.94	1.21	1.82	1.79	7.55	7.49	7.55	96
超長期(11-)	4	94.59	95.17	14.26	1.99	2.51	2.44	12.20	12.05	12.13	104
<hr/>											
AAA~A格	994	98.54	98.84	4.62	1.33	1.60	1.59	4.23	4.19	4.22	106
短期(1-3)	521	99.85	100.13	2.27	1.16	1.24	1.24	2.24	2.23	2.24	92
中期(3-7)	288	97.84	98.13	4.18	1.10	1.63	1.61	4.08	4.05	4.08	112
長期(7-)	186	95.95	96.33	11.87	2.14	2.63	2.56	10.28	10.15	10.24	138
長期(7-11)	73	95.52	96.00	8.51	1.62	2.26	2.21	7.90	7.81	7.89	133
超長期(11-)	113	96.23	96.55	14.03	2.48	2.86	2.79	11.80	11.64	11.73	141
<hr/>											
AAA~BBB格	995	98.54	98.84	4.62	1.33	1.60	1.59	4.23	4.19	4.22	106
短期(1-3)	521	99.85	100.13	2.27	1.16	1.24	1.24	2.24	2.23	2.24	92
中期(3-7)	289	97.83	98.11	4.19	1.10	1.63	1.62	4.08	4.05	4.08	112
長期(7-)	186	95.95	96.33	11.87	2.14	2.63	2.56	10.28	10.15	10.24	138
長期(7-11)	73	95.52	96.00	8.51	1.62	2.26	2.21	7.90	7.81	7.89	133
超長期(11-)	113	96.23	96.55	14.03	2.48	2.86	2.79	11.80	11.64	11.73	141
<hr/>											
AAA~BB格	995	98.54	98.84	4.62	1.33	1.60	1.59	4.23	4.19	4.22	106
短期(1-3)	521	99.85	100.13	2.27	1.16	1.24	1.24	2.24	2.23	2.24	92
中期(3-7)	289	97.83	98.11	4.19	1.10	1.63	1.62	4.08	4.05	4.08	112
長期(7-)	186	95.95	96.33	11.87	2.14	2.63	2.56	10.28	10.15	10.24	138
長期(7-11)	73	95.52	96.00	8.51	1.62	2.26	2.21	7.90	7.81	7.89	133
超長期(11-)	113	96.23	96.55	14.03	2.48	2.86	2.79	11.80	11.64	11.73	141
<hr/>											
AAA格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
<hr/>											
AA格	255	99.21	99.54	3.48	1.04	1.22	1.22	3.35	3.33	3.35	79
短期(1-3)	160	99.82	100.20	2.35	0.96	1.06	1.06	2.32	2.30	2.32	73
中期(3-7)	73	98.99	99.17	4.26	1.12	1.37	1.36	4.16	4.13	4.16	86
長期(7-)	22	95.57	95.95	9.14	1.36	1.95	1.91	8.42	8.34	8.41	98
長期(7-11)	18	95.80	96.13	7.94	1.21	1.82	1.79	7.55	7.49	7.55	96
超長期(11-)	4	94.59	95.17	14.26	1.99	2.51	2.44	12.20	12.05	12.13	104
<hr/>											
A格	739	98.31	98.60	5.01	1.43	1.74	1.72	4.54	4.49	4.53	115
短期(1-3)	361	99.87	100.10	2.24	1.25	1.32	1.32	2.21	2.20	2.21	100
中期(3-7)	215	97.45	97.77	4.16	1.10	1.72	1.70	4.05	4.02	4.05	121
長期(7-)	163	96.01	96.39	12.24	2.25	2.72	2.65	10.53	10.39	10.48	144
長期(7-11)	55	95.42	95.95	8.70	1.75	2.41	2.35	8.01	7.92	8.00	145
超長期(11-)	109	96.30	96.60	14.02	2.50	2.87	2.80	11.79	11.62	11.72	143
<hr/>											
BBB格	1	92.97	93.26	5.23	1.05	2.57	2.49	5.08	5.02	5.08	191
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	1	92.97	93.26	5.23	1.05	2.57	2.49	5.08	5.02	5.08	191
長期(7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
<hr/>											
BB格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
<hr/>											
B格以下	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
<hr/>											
格付なし	2,554	99.14	99.33	3.73	0.95	1.16	1.15	3.59	3.56	3.58	70
短期(1-3)	1,262	99.61	99.78	2.20	0.84	0.99	0.99	2.18	2.17	2.18	67
中期(3-7)	1,120	99.02	99.23	4.36	0.99	1.23	1.23	4.26	4.24	4.26	71
長期(7-)	172	96.44	96.70	10.74	1.54	1.97	1.93	9.66	9.57	9.63	85
長期(7-11)	120	97.29	97.52	8.90	1.31	1.69	1.67	8.39	8.32	8.38	73
超長期(11-)	52	94.48	94.79	14.99	2.08	2.63	2.56	12.70	12.54	12.61	112

出所:NFC

- 格付は、JCRの格付をもとにNFCで分類

## 円建外債 Moody's 格付別・ポートフォリオ指標 (2024年6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	1,191	99.34	99.53	3.32	0.78	0.97	0.97	3.25	3.23	3.25	55
短期 (1-3)	581	99.65	99.82	1.99	0.64	0.81	0.81	1.98	1.97	1.98	52
中期 (3-7)	554	99.23	99.44	4.19	0.90	1.09	1.09	4.10	4.08	4.10	59
長期 (7-)	56	97.23	97.50	8.58	1.07	1.48	1.46	8.18	8.12	8.18	55
長期 (7-11)	56	97.23	97.50	8.58	1.07	1.48	1.46	8.18	8.12	8.18	55
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AAA~A 格	2,112	99.55	99.75	3.62	0.97	1.10	1.09	3.48	3.46	3.48	65
短期 (1-3)	1,092	99.85	100.02	2.14	0.87	0.93	0.93	2.12	2.11	2.12	62
中期 (3-7)	851	99.15	99.36	4.10	0.94	1.15	1.14	4.02	3.99	4.02	65
長期 (7-)	168	99.63	99.94	10.77	1.79	1.92	1.92	9.65	9.55	9.61	83
長期 (7-11)	96	96.72	96.99	8.58	1.10	1.57	1.55	8.17	8.11	8.16	64
超長期 (11-)	72	103.54	103.92	13.73	2.72	2.37	2.40	11.50	11.36	11.43	106
AAA~BBB 格	3,120	98.97	99.21	3.89	1.02	1.23	1.22	3.69	3.66	3.69	76
短期 (1-3)	1,495	99.77	99.98	2.15	0.89	0.98	0.98	2.13	2.12	2.13	67
中期 (3-7)	1,318	98.79	99.04	4.19	0.98	1.27	1.27	4.09	4.07	4.09	77
長期 (7-)	307	95.87	96.20	11.09	1.83	2.32	2.27	9.82	9.71	9.79	115
長期 (7-11)	159	96.37	96.72	8.62	1.36	1.87	1.84	8.10	8.03	8.10	93
超長期 (11-)	149	95.33	95.65	13.72	2.34	2.81	2.73	11.67	11.52	11.61	138
AAA~BB 格	3,120	98.97	99.21	3.89	1.02	1.23	1.22	3.69	3.66	3.69	76
短期 (1-3)	1,495	99.77	99.98	2.15	0.89	0.98	0.98	2.13	2.12	2.13	67
中期 (3-7)	1,318	98.79	99.04	4.19	0.98	1.27	1.27	4.09	4.07	4.09	77
長期 (7-)	307	95.87	96.20	11.09	1.83	2.32	2.27	9.82	9.71	9.79	115
長期 (7-11)	159	96.37	96.72	8.62	1.36	1.87	1.84	8.10	8.03	8.10	93
超長期 (11-)	149	95.33	95.65	13.72	2.34	2.81	2.73	11.67	11.52	11.61	138
AAA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA 格	1,191	99.34	99.53	3.32	0.78	0.97	0.97	3.25	3.23	3.25	55
短期 (1-3)	581	99.65	99.82	1.99	0.64	0.81	0.81	1.98	1.97	1.98	52
中期 (3-7)	554	99.23	99.44	4.19	0.90	1.09	1.09	4.10	4.08	4.10	59
長期 (7-)	56	97.23	97.50	8.58	1.07	1.48	1.46	8.18	8.12	8.18	55
長期 (7-11)	56	97.23	97.50	8.58	1.07	1.48	1.46	8.18	8.12	8.18	55
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
A 格	921	99.82	100.03	4.00	1.21	1.25	1.25	3.78	3.75	3.77	77
短期 (1-3)	512	100.09	100.26	2.31	1.13	1.06	1.06	2.29	2.27	2.29	73
中期 (3-7)	297	99.00	99.22	3.93	1.00	1.25	1.24	3.85	3.83	3.85	77
長期 (7-)	112	100.83	101.16	11.87	2.15	2.14	2.15	10.35	10.24	10.30	96
長期 (7-11)	40	96.01	96.27	8.57	1.13	1.70	1.67	8.15	8.08	8.15	77
超長期 (11-)	72	103.54	103.92	13.73	2.72	2.37	2.40	11.50	11.36	11.43	106
BBB 格	1,008	97.76	98.07	4.46	1.12	1.52	1.50	4.13	4.10	4.13	99
短期 (1-3)	403	99.56	99.85	2.17	0.94	1.13	1.13	2.14	2.13	2.14	82
中期 (3-7)	466	98.13	98.45	4.35	1.06	1.51	1.49	4.24	4.20	4.24	98
長期 (7-)	139	91.32	91.68	11.47	1.88	2.84	2.72	10.05	9.92	10.02	157
長期 (7-11)	62	95.82	96.30	8.68	1.76	2.34	2.29	8.00	7.91	7.99	139
超長期 (11-)	77	87.68	87.95	13.72	1.97	3.29	3.09	11.87	11.69	11.82	173
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	265	98.40	98.58	2.71	1.24	1.71	1.70	2.64	2.62	2.64	135
短期 (1-3)	202	99.06	99.21	2.12	1.29	1.64	1.63	2.09	2.08	2.09	133
中期 (3-7)	55	96.78	97.04	4.18	1.09	1.91	1.88	4.07	4.03	4.07	139
長期 (7-)	8	92.58	92.97	7.66	1.15	2.29	2.21	7.31	7.23	7.31	141
長期 (7-11)	8	92.58	92.97	7.66	1.15	2.29	2.21	7.31	7.23	7.31	141
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&amp;P 格付別・ポートフォリオ指標 (2024年6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	233	99.14	99.39	3.46	0.73	0.95	0.95	3.39	3.37	3.39	52
短期(1-3)	122	99.69	99.96	2.14	0.69	0.83	0.83	2.12	2.11	2.12	52
中期(3-7)	98	98.75	98.97	4.42	0.74	1.05	1.05	4.35	4.32	4.35	53
長期(7-)	14	97.03	97.33	8.38	0.94	1.38	1.36	8.05	8.00	8.05	47
長期(7-11)	14	97.03	97.33	8.38	0.94	1.38	1.36	8.05	8.00	8.05	47
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AAA～A格	2,021	99.55	99.74	3.61	0.95	1.09	1.08	3.48	3.46	3.48	64
短期(1-3)	1,034	99.82	99.98	2.18	0.84	0.92	0.92	2.16	2.15	2.16	61
中期(3-7)	837	99.16	99.38	4.09	0.93	1.14	1.14	4.01	3.98	4.01	65
長期(7-)	150	99.86	100.16	10.86	1.78	1.88	1.89	9.71	9.62	9.68	79
長期(7-11)	88	96.89	97.17	8.58	1.11	1.56	1.53	8.17	8.11	8.16	63
超長期(11-)	62	104.11	104.43	14.13	2.73	2.32	2.36	11.78	11.64	11.71	99
AAA～BBB格	3,304	98.92	99.15	3.83	1.03	1.26	1.25	3.64	3.62	3.64	79
短期(1-3)	1,631	99.69	99.88	2.16	0.92	1.04	1.03	2.14	2.13	2.14	73
中期(3-7)	1,360	98.72	98.97	4.19	0.99	1.30	1.29	4.09	4.07	4.09	79
長期(7-)	313	95.81	96.15	11.03	1.82	2.32	2.27	9.78	9.66	9.75	116
長期(7-11)	164	96.24	96.59	8.58	1.36	1.89	1.86	8.08	8.00	8.07	96
超長期(11-)	149	95.33	95.65	13.72	2.34	2.81	2.73	11.67	11.52	11.61	138
AAA～BB格	3,304	98.92	99.15	3.83	1.03	1.26	1.25	3.64	3.62	3.64	79
短期(1-3)	1,631	99.69	99.88	2.16	0.92	1.04	1.03	2.14	2.13	2.14	73
中期(3-7)	1,360	98.72	98.97	4.19	0.99	1.30	1.29	4.09	4.07	4.09	79
長期(7-)	313	95.81	96.15	11.03	1.82	2.32	2.27	9.78	9.66	9.75	116
長期(7-11)	164	96.24	96.59	8.58	1.36	1.89	1.86	8.08	8.00	8.07	96
超長期(11-)	149	95.33	95.65	13.72	2.34	2.81	2.73	11.67	11.52	11.61	138
AAA格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA格	233	99.14	99.39	3.46	0.73	0.95	0.95	3.39	3.37	3.39	52
短期(1-3)	122	99.69	99.96	2.14	0.69	0.83	0.83	2.12	2.11	2.12	52
中期(3-7)	98	98.75	98.97	4.42	0.74	1.05	1.05	4.35	4.32	4.35	53
長期(7-)	14	97.03	97.33	8.38	0.94	1.38	1.36	8.05	8.00	8.05	47
長期(7-11)	14	97.03	97.33	8.38	0.94	1.38	1.36	8.05	8.00	8.05	47
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
A格	1,788	99.60	99.79	3.63	0.98	1.10	1.10	3.50	3.47	3.49	66
短期(1-3)	912	99.84	99.98	2.18	0.86	0.94	0.94	2.16	2.15	2.16	63
中期(3-7)	739	99.21	99.43	4.04	0.96	1.15	1.15	3.96	3.94	3.96	66
長期(7-)	136	100.14	100.44	11.11	1.86	1.93	1.94	9.88	9.78	9.84	82
長期(7-11)	75	96.87	97.14	8.61	1.14	1.59	1.57	8.19	8.13	8.18	66
超長期(11-)	62	104.11	104.43	14.13	2.73	2.32	2.36	11.78	11.64	11.71	99
BBB格	1,283	97.94	98.22	4.18	1.16	1.54	1.52	3.90	3.86	3.89	103
短期(1-3)	597	99.47	99.71	2.13	1.04	1.23	1.23	2.10	2.09	2.10	92
中期(3-7)	523	98.01	98.31	4.34	1.07	1.55	1.53	4.23	4.20	4.23	102
長期(7-)	163	92.07	92.45	11.18	1.87	2.76	2.65	9.84	9.71	9.81	153
長期(7-11)	76	95.48	95.92	8.59	1.65	2.29	2.24	7.97	7.88	7.96	134
超長期(11-)	87	89.10	89.43	13.43	2.05	3.21	3.03	11.59	11.42	11.54	170
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	81	99.16	99.43	2.29	1.35	1.63	1.63	2.24	2.22	2.24	131
短期(1-3)	67	99.65	99.94	1.79	1.45	1.66	1.65	1.76	1.74	1.76	138
中期(3-7)	13	97.75	97.91	4.07	0.97	1.52	1.50	3.99	3.96	3.99	101
長期(7-)	2	92.43	92.64	7.61	0.51	1.63	1.57	7.45	7.39	7.44	78
長期(7-11)	2	92.43	92.64	7.61	0.51	1.63	1.57	7.45	7.39	7.44	78
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&amp;P 格付別・ポートフォリオ指標 (2024年6月末、7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)
<hr/>											
AAA~AA 格	233	99.14	99.39	3.46	0.73	0.95	0.95	3.39	3.37	3.39	52
短期 (1-3)	122	99.69	99.96	2.14	0.69	0.83	0.83	2.12	2.11	2.12	52
中期 (3-7)	98	98.75	98.97	4.42	0.74	1.05	1.05	4.35	4.32	4.35	53
長期 (7-)	14	97.03	97.33	8.38	0.94	1.38	1.36	8.05	8.00	8.05	47
長期 (7-11)	14	97.03	97.33	8.38	0.94	1.38	1.36	8.05	8.00	8.05	47
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
<hr/>											
AAA~A 格	2,015	99.55	99.74	3.62	0.95	1.08	1.08	3.49	3.47	3.49	64
短期 (1-3)	1,090	99.80	99.98	2.23	0.84	0.93	0.93	2.21	2.20	2.21	61
中期 (3-7)	775	99.13	99.34	4.17	0.94	1.15	1.15	4.09	4.07	4.09	65
長期 (7-)	150	99.86	100.16	10.86	1.78	1.88	1.89	9.71	9.62	9.68	79
長期 (7-11)	88	96.89	97.17	8.58	1.11	1.56	1.53	8.17	8.11	8.16	63
超長期 (11-)	62	104.11	104.43	14.13	2.73	2.32	2.36	11.78	11.64	11.71	99
<hr/>											
AAA~BBB 格	3,474	98.97	99.19	4.01	1.05	1.27	1.27	3.80	3.77	3.79	79
短期 (1-3)	1,723	99.69	99.88	2.24	0.91	1.04	1.04	2.21	2.20	2.21	72
中期 (3-7)	1,396	98.78	99.01	4.33	1.02	1.31	1.30	4.23	4.20	4.23	79
長期 (7-)	355	96.21	96.53	11.35	1.86	2.31	2.26	10.00	9.88	9.96	113
長期 (7-11)	190	96.67	97.00	8.77	1.44	1.90	1.87	8.21	8.14	8.21	96
超長期 (11-)	165	95.68	96.00	14.33	2.36	2.79	2.72	12.08	11.92	12.01	132
<hr/>											
AAA~BB 格	3,474	98.97	99.19	4.01	1.05	1.27	1.27	3.80	3.77	3.79	79
短期 (1-3)	1,723	99.69	99.88	2.24	0.91	1.04	1.04	2.21	2.20	2.21	72
中期 (3-7)	1,396	98.78	99.01	4.33	1.02	1.31	1.30	4.23	4.20	4.23	79
長期 (7-)	355	96.21	96.53	11.35	1.86	2.31	2.26	10.00	9.88	9.96	113
長期 (7-11)	190	96.67	97.00	8.77	1.44	1.90	1.87	8.21	8.14	8.21	96
超長期 (11-)	165	95.68	96.00	14.33	2.36	2.79	2.72	12.08	11.92	12.01	132
<hr/>											
AAA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
<hr/>											
AA 格	233	99.14	99.39	3.46	0.73	0.95	0.95	3.39	3.37	3.39	52
短期 (1-3)	122	99.69	99.96	2.14	0.69	0.83	0.83	2.12	2.11	2.12	52
中期 (3-7)	98	98.75	98.97	4.42	0.74	1.05	1.05	4.35	4.32	4.35	53
長期 (7-)	14	97.03	97.33	8.38	0.94	1.38	1.36	8.05	8.00	8.05	47
長期 (7-11)	14	97.03	97.33	8.38	0.94	1.38	1.36	8.05	8.00	8.05	47
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
<hr/>											
A 格	1,782	99.60	99.79	3.64	0.98	1.10	1.10	3.50	3.48	3.50	65
短期 (1-3)	968	99.81	99.98	2.24	0.86	0.94	0.94	2.22	2.21	2.22	62
中期 (3-7)	678	99.19	99.39	4.14	0.97	1.16	1.16	4.05	4.03	4.05	67
長期 (7-)	136	100.14	100.44	11.11	1.86	1.93	1.94	9.88	9.78	9.84	82
長期 (7-11)	75	96.87	97.14	8.61	1.14	1.59	1.57	8.19	8.13	8.18	66
超長期 (11-)	62	104.11	104.43	14.13	2.73	2.32	2.36	11.78	11.64	11.71	99
<hr/>											
BBB 格	1,458	98.17	98.42	4.55	1.19	1.54	1.52	4.23	4.19	4.22	100
短期 (1-3)	632	99.49	99.71	2.25	1.03	1.23	1.23	2.22	2.21	2.22	91
中期 (3-7)	621	98.35	98.61	4.53	1.12	1.52	1.50	4.41	4.37	4.41	98
長期 (7-)	205	93.54	93.88	11.71	1.93	2.65	2.56	10.22	10.09	10.18	139
長期 (7-11)	102	96.47	96.85	8.93	1.72	2.21	2.17	8.25	8.17	8.25	124
超長期 (11-)	103	90.64	90.95	14.45	2.13	3.11	2.96	12.29	12.11	12.21	155
<hr/>											
BB 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
<hr/>											
B 格以下	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
<hr/>											
格付なし	75	99.11	99.37	2.39	1.41	1.70	1.69	2.34	2.32	2.34	136
短期 (1-3)	61	99.63	99.92	1.86	1.53	1.73	1.73	1.83	1.81	1.83	145
中期 (3-7)	13	97.75	97.91	4.07	0.97	1.52	1.50	3.99	3.96	3.99	101
長期 (7-)	2	92.43	92.64	7.61	0.51	1.63	1.57	7.45	7.39	7.44	78
長期 (7-11)	2	92.43	92.64	7.61	0.51	1.63	1.57	7.45	7.39	7.44	78
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

出所:NFC

- 格付は、S&P の格付をもとに NFC で分類

## NOMURA-BPI/Extended 総合・ポートフォリオ指標の推移

	2020年3月末	2021年3月末	2022年3月末	2023年3月末	2024年3月末	2024年6月末
銘柄数	14,003	14,825	15,436	15,639	16,113	16,158
額面(10億円)	972,326	1,018,210	1,056,757	1,085,263	1,124,834	1,131,025
時価単価(円)	108.39	106.48	104.19	101.51	98.40	95.70
利含単価(円)	108.52	106.59	104.30	101.61	98.50	95.85
残存年数(年)	9.84	9.89	10.01	10.16	10.21	10.24
利率(%)	0.89	0.83	0.79	0.77	0.78	0.79
単利(%)	0.08	0.14	0.27	0.43	0.73	1.00
複利(%)	0.08	0.14	0.27	0.43	0.72	0.97
Dur(年)	9.47	9.36	9.31	9.18	8.93	8.72
M-Dur	9.46	9.34	9.29	9.15	8.88	8.66
E-Dur	9.45	9.33	9.29	9.15	8.89	8.68
Tspd(bp)	5	4	3	6	4	4

出所:NFRC

## NOMURA-BPI/Extended の定義

## NOMURA-BPI/Extended の銘柄組入基準

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

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

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

## 累積投資収益指数の計算方法

ある時点における投資収益指数は以下の計算式から算出される。

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

$BPIE_{today}$  : 当日累積投資収益指数

$BPIE_{e.l.m.}$  : 前月末累積投資収益指数

$MVLt_{today}$  : 当日経過利子込み時価総額

$MVLt_{e.l.m.}$  : 前月末経過利子込み時価総額

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

各ポートフォリオの累積投資収益指数は以下の基準日を 100 としている。

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

ただし、

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

## 投資収益率の計算方法

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

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

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

## レポートの表記等について

### 投資収益率 投資収益指数

- 「前月末からの投資収益率」は、「2024 年 5 月の月末営業日から 2024 年 6 月の月末営業日までの投資収益率(年率換算,%)」を指す。
- 「前年度末からの投資収益率」は、「2024 年 3 月の月末営業日から 2024 年 6 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 6 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 5 月の月末営業日から 2024 年 6 月の月末営業日までの投資収益率(年率換算,%)
- 2024 年 5 月の月末営業日において、6 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 6 月ポートフォリオの、右ページには 7 月ポートフォリオの、2024 年 6 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 6 月末(暦上)における残存年数(至最終償還日)で区分。ただし 7 月ポートフォリオでは、2024 年 7 月末(暦上)における残存年数(至最終償還日)で区分。
- NOMURA-BPI は、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社の商標または登録商標です。



## NOMURA-BPI/Extended のデータ提供について

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

## Quick-IS

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

## REUTERS

NMSBPI メニュー

## Bloomberg

NBPI(GO) メニュー

## 時事通信社

BPIXG/12400

## NFRC Web ページ

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

## ディスクレイマー

NOMURA-BPI/Extended の知的財産権およびその他一切の権利は野村フィデューシャリー・リサーチ & コンサルティング株式会社（以下、NFRC）に帰属します。

なお、NFRC は、当インデックスの正確性、完全性、信頼性、有用性、市場性、商品性および適合性を保証するものではなく、インデックスの利用者およびその関連会社が当インデックスを用いて行う事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。

インデックスの算出において、電子計算機の障害もしくは天災地変その他やむを得ない事由が発生した場合は、インデックスの公表を延期または中止することがあります。

インデックス・データを取得した経路（当社ウェブサイト、情報ベンダー各社のサービスを通じた取得、等）に関わらず、これらのインデックスをご利用の際は、「インデックス・ライセンスについて」をご確認ください。

「インデックス・ライセンスについて」

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

本資料は、お客様への情報提供を目的として、NFRC が作成したものです。

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

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

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

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

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

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

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