



月間投資収益率 (2024年7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 357.399	-1.10	-1.93	0.83	-7.50	-5.17

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(%)

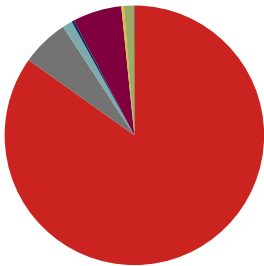
ポートフォリオ指標 (2024年7月末)

	翌月ポート (2024年8月)	当月ポート (2024年7月)	差
額面[兆円]	1149.56	1138.13	11.43
デュレーション[年]	8.70	8.66	0.04
修正デュレーション	8.64	8.60	0.04
時価単価[円]	95.57	95.54	0.04
利含単価[円]	95.78	95.74	0.04
残存年数[年]	10.22	10.18	0.04
利率[%]	0.80	0.79	0.01
単利[%]	1.05	1.05	0.00
複利[%]	1.02	1.02	0.00
Tスプレッド[bp]	4	4	0

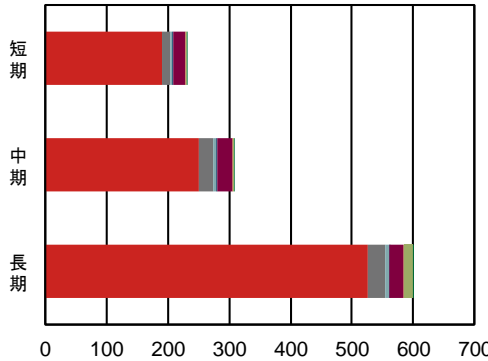
出所: NFRC

(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7月末)



残存別額面構成 (2024年7月末)



出所: NFRC

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	84.8%	5.9%	1.2%	0.3%	6.1%	0.3%	1.2%	0.1%
全体	965.64	67.04	14.16	3.44	69.50	3.55	14.10	0.70
短期	190.46	12.82	3.32	2.03	20.73	1.78	-	0.23
中期	249.99	24.53	4.35	1.24	25.25	1.41	-	0.29
長期	525.19	29.69	6.50	0.18	23.52	0.36	14.10	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7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	357.399	-1.10	-1.93	0.83	-7.50	-5.17
国債	367.297	-1.08	-1.94	0.85	-7.96	-5.54
地方債	385.149	-0.85	-1.47	0.62	-4.85	-3.26
政保債	359.607	-0.82	-1.57	0.75	-6.54	-4.23
金融債	271.899	-1.78	-2.04	0.26	-1.64	-1.36
事業債	380.900	-1.70	-2.45	0.76	-4.77	-2.83
円建外債	391.643	-0.17	-1.24	1.07	0.05	0.59
MBS	122.774	-0.83	-1.50	0.67	-6.02	-4.15
ABS	112.589	-1.07	-1.81	0.74	-3.32	-2.36

出所:NFRC

投資収益率は年率換算(%)

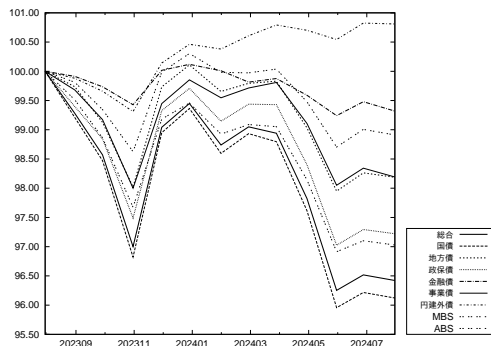
銘柄別・累積投資収益指数の推移

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
2023/07/31	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
2024/06/28	357.755	367.658	385.446	359.874	272.337	381.486	391.703	122.865	112.698
2024/07/01	357.257	367.119	385.028	359.423	272.322	381.160	391.420	122.720	112.619
2024/07/02	356.657	366.480	384.478	358.858	272.207	380.712	391.289	122.488	112.510
2024/07/03	356.576	366.377	384.575	358.791	272.317	380.682	391.443	122.504	112.549
2024/07/04	356.827	366.630	384.913	359.025	272.427	380.929	391.666	122.616	112.634
2024/07/05	356.912	366.710	385.119	359.131	272.441	381.022	391.927	122.641	112.680
2024/07/08	356.621	366.405	384.792	358.861	272.332	380.769	391.721	122.573	112.611
2024/07/09	356.776	366.559	385.046	359.004	272.445	380.927	391.818	122.641	112.674
2024/07/10	356.451	366.195	384.924	358.717	272.468	380.722	391.896	122.558	112.640
2024/07/11	356.554	366.311	384.958	358.893	272.449	380.751	391.917	122.579	112.640
2024/07/12	357.666	367.509	385.877	359.922	272.637	381.568	392.318	122.902	112.828
2024/07/16	358.198	368.075	386.368	360.413	272.764	381.995	392.704	123.054	112.942
2024/07/17	358.056	367.936	386.147	360.262	272.684	381.828	392.520	122.995	112.887
2024/07/18	358.064	367.963	386.009	360.256	272.573	381.732	392.495	122.967	112.841
2024/07/19	358.146	368.062	385.980	360.339	272.536	381.756	392.477	122.970	112.826
2024/07/22	357.763	367.633	385.791	360.005	272.564	381.551	392.502	122.884	112.805
2024/07/23	357.536	367.393	385.563	359.793	272.480	381.362	392.447	122.816	112.754
2024/07/24	357.194	367.027	385.289	359.487	272.369	381.055	392.353	122.738	112.691
2024/07/25	357.422	367.303	385.259	359.659	272.213	381.083	392.273	122.729	112.655
2024/07/26	357.801	367.717	385.526	360.010	272.209	381.323	392.276	122.844	112.698
2024/07/29	358.572	368.541	386.205	360.713	272.390	381.932	392.624	123.078	112.849
2024/07/30	359.082	369.076	386.750	361.208	272.532	382.356	392.898	123.271	112.971
2024/07/31	357.399	367.297	385.149	359.607	271.899	380.900	391.643	122.774	112.589

出所:NFRC

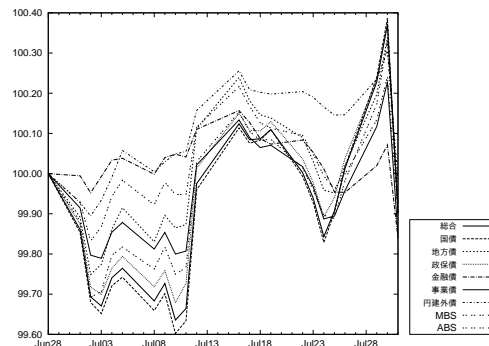
1983年12月末=100。MBSセクターは2003年3月末=100。ABSセクターは2008年3月末=100

指数の推移(月次) 2023年7月末=100に補正。



出所:NFRC

指数の推移(日次) 2024年6月末=100に補正。



出所:NFRC

総合 残存別・投資収益率(2024年7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	357.399	-1.10	-1.93	0.83	-7.50	-5.17
短期 (1-3)	233.895	-1.69	-2.08	0.39	-0.94	-0.86
中期 (3-7)	334.143	-2.74	-3.38	0.64	-3.16	-2.54
長期 (7-)	520.662	0.06	-1.06	1.12	-12.49	-8.32
長期 (7-11)	190.664	-0.26	-1.24	0.97	-6.08	-4.10
超長期 (11-)	229.206	0.26	-0.95	1.21	-16.26	-10.79
(11-15)	220.056	1.89	0.85	1.04	-10.37	-6.48
(15-)	234.377	-0.32	-1.59	1.27	-18.37	-12.32

出所:NFRC

投資収益率は年率換算(%)

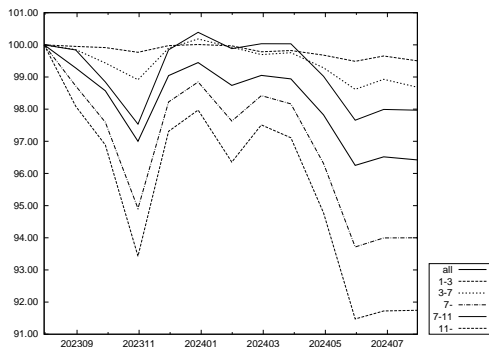
総合 残存別・投資収益指数の推移

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-)*
2023/07/31	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
2024/06/28	357.755	234.252	334.973	520.633	190.709	229.152	219.682	234.445
2024/07/01	357.257	234.261	334.764	519.372	190.432	228.461	219.181	233.676
2024/07/02	356.657	234.217	334.501	517.915	190.029	227.724	218.533	232.900
2024/07/03	356.576	234.288	334.720	517.425	190.110	227.318	218.427	232.376
2024/07/04	356.827	234.334	334.971	517.885	190.402	227.429	218.704	232.425
2024/07/05	356.912	234.317	335.049	518.079	190.616	227.410	218.946	232.307
2024/07/08	356.621	234.264	334.825	517.485	190.354	227.181	218.619	232.113
2024/07/09	356.776	234.310	335.040	517.702	190.588	227.163	218.747	232.039
2024/07/10	356.451	234.347	335.035	516.736	190.432	226.593	218.414	231.375
2024/07/11	356.554	234.345	334.959	517.099	190.449	226.838	218.526	231.673
2024/07/12	357.666	234.417	335.379	519.871	191.041	228.368	219.692	233.353
2024/07/16	358.198	234.469	335.659	521.110	191.382	228.997	220.234	234.019
2024/07/17	358.056	234.434	335.482	520.889	191.210	228.965	220.017	234.058
2024/07/18	358.064	234.369	335.258	521.167	191.109	229.237	220.022	234.434
2024/07/19	358.146	234.347	335.170	521.500	191.034	229.528	220.104	234.807
2024/07/22	357.763	234.374	335.167	520.374	190.929	228.807	219.778	233.929
2024/07/23	357.536	234.319	335.039	519.883	190.778	228.570	219.501	233.705
2024/07/24	357.194	234.255	334.831	519.139	190.617	228.160	219.323	233.205
2024/07/25	357.422	234.141	334.589	520.111	190.580	228.876	219.620	234.086
2024/07/26	357.801	234.125	334.616	521.196	190.745	229.524	220.056	234.819
2024/07/29	358.572	234.203	335.009	523.002	191.207	230.465	220.792	235.846
2024/07/30	359.082	234.257	335.332	524.141	191.603	230.983	221.396	236.334
2024/07/31	357.399	233.895	334.143	520.662	190.664	229.206	220.056	234.377

出所:NFRC

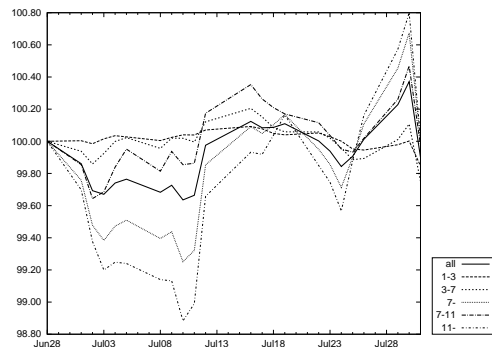
*は1995年12月末=100。それ以外は、1983年12月末=100。

指数の推移(月次) 2023年7月末=100に補正。



出所:NFRC

指数の推移(日次) 2024年6月末=100に補正。



出所:NFRC

国債 残存別・投資収益率 (2024年7月末)

国債	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	367.297	-1.08	-1.94	0.85	-7.96	-5.54
短期 (1-3)	220.511	-1.72	-2.10	0.38	-1.00	-0.92
中期 (3-7)	332.596	-2.82	-3.48	0.65	-3.27	-2.67
長期 (7-)	529.860	0.07	-1.07	1.14	-12.97	-8.72
長期 (7-11)	188.969	-0.31	-1.30	0.98	-6.19	-4.25
超長期 (11-)	227.590	0.31	-0.93	1.24	-16.94	-11.32
(11-15)	217.871	1.95	0.89	1.06	-10.50	-6.65
(15-)	233.119	-0.28	-1.58	1.31	-19.24	-12.98

出所:NFRC

投資収益率は年率換算 (%)

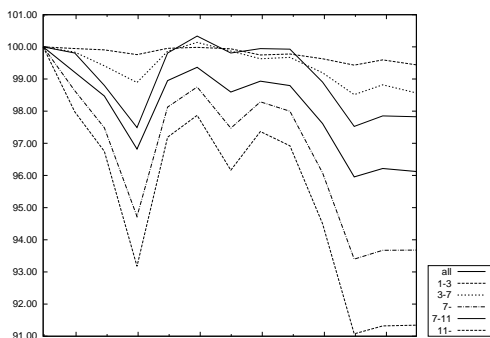
国債 残存別・投資収益指数の推移

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-)*
2023/07/31	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
2024/06/28	367.658	220.855	333.447	529.824	189.023	227.526	217.488	233.177
2024/07/01	367.119	220.862	333.236	528.504	188.747	226.817	216.990	232.381
2024/07/02	366.480	220.821	332.969	526.998	188.346	226.071	216.345	231.591
2024/07/03	366.377	220.888	333.187	526.468	188.428	225.644	216.248	231.035
2024/07/04	366.630	220.931	333.438	526.922	188.719	225.745	216.521	231.070
2024/07/05	366.710	220.913	333.514	527.095	188.930	225.711	216.759	230.931
2024/07/08	366.405	220.863	333.290	526.486	188.669	225.481	216.433	230.737
2024/07/09	366.559	220.906	333.503	526.692	188.901	225.455	216.559	230.651
2024/07/10	366.195	220.939	333.490	525.667	188.739	224.865	216.229	229.958
2024/07/11	366.311	220.937	333.413	526.054	188.755	225.121	216.340	230.271
2024/07/12	367.509	221.004	333.831	528.954	189.343	226.692	217.498	232.013
2024/07/16	368.075	221.051	334.108	530.242	189.680	227.334	218.037	232.700
2024/07/17	367.936	221.019	333.931	530.035	189.511	227.314	217.825	232.753
2024/07/18	367.963	220.957	333.707	530.356	189.411	227.609	217.833	233.160
2024/07/19	368.062	220.936	333.618	530.722	189.336	227.916	217.915	233.557
2024/07/22	367.633	220.961	333.613	529.517	189.231	227.162	217.588	232.632
2024/07/23	367.393	220.909	333.486	529.010	189.081	226.922	217.312	232.404
2024/07/24	367.027	220.850	333.279	528.227	188.923	226.496	217.135	231.880
2024/07/25	367.303	220.743	333.039	529.288	188.887	227.255	217.435	232.820
2024/07/26	367.717	220.727	333.063	530.428	189.049	227.923	217.869	233.584
2024/07/29	368.541	220.799	333.457	532.309	189.509	228.885	218.599	234.642
2024/07/30	369.076	220.849	333.779	533.473	189.900	229.402	219.200	235.131
2024/07/31	367.297	220.511	332.596	529.860	188.969	227.590	217.871	233.119

出所:NFRC

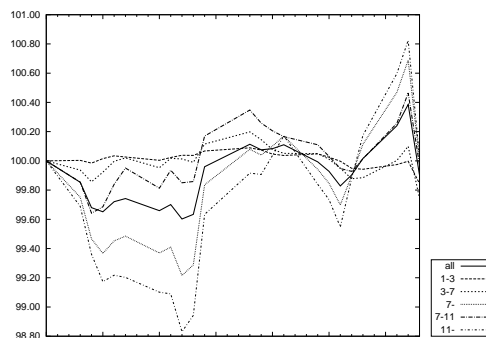
* は 1995年12月末=100。それ以外は、1983年12月末=100。

指数の推移 (月次) 2023年7月末=100に補正。



出所:NFRC

指数の推移 (日次) 2024年6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7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	357.277	-1.10	-1.93	0.83	-7.52	-5.18
短期 (1-3)	233.895	-1.69	-2.08	0.39	-0.94	-0.86
中期 (3-7)	334.143	-2.74	-3.38	0.64	-3.16	-2.54
長期 (7-)	522.402	0.08	-1.04	1.13	-12.65	-8.42
長期 (7-11)	190.657	-0.26	-1.24	0.98	-6.08	-4.10
超長期 (11-)	230.804	0.30	-0.92	1.23	-16.66	-11.05
(11-15)	220.046	1.89	0.85	1.04	-10.37	-6.48
(15-)	236.185	-0.29	-1.59	1.30	-19.02	-12.76

出所:NFRC

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

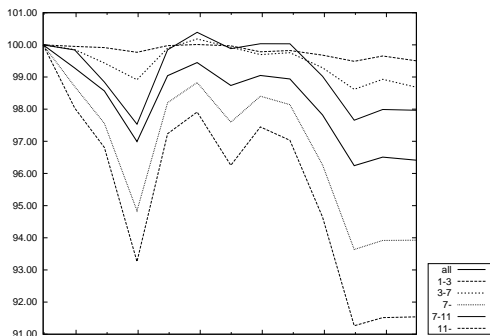
「除く MBS」残存別・投資収益指数の推移

除く MBS 年/月/日	全体	短期 (1-3)	中期 (3-7)	長期 (7-)	長期*			
					長期* (7-11)	超長期* (11-)	(11-15)*	(15-)*
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
2024/06/28	357.634	234.252	334.973	522.362	190.702	230.741	219.671	236.248
2024/07/01	357.135	234.261	334.764	521.081	190.425	230.028	219.170	235.446
2024/07/02	356.537	234.217	334.501	519.608	190.022	229.274	218.522	234.646
2024/07/03	356.454	234.288	334.720	519.102	190.102	228.847	218.416	234.087
2024/07/04	356.704	234.334	334.971	519.563	190.395	228.955	218.693	234.127
2024/07/05	356.789	234.317	335.049	519.760	190.609	228.934	218.936	233.999
2024/07/08	356.497	234.264	334.825	519.157	190.347	228.698	218.608	233.800
2024/07/09	356.651	234.310	335.040	519.373	190.581	228.675	218.737	233.714
2024/07/10	356.326	234.347	335.035	518.387	190.424	228.084	218.403	233.016
2024/07/11	356.429	234.345	334.959	518.759	190.442	228.339	218.515	233.331
2024/07/12	357.543	234.417	335.379	521.575	191.034	229.917	219.681	235.083
2024/07/16	358.075	234.469	335.659	522.833	191.375	230.564	220.223	235.775
2024/07/17	357.934	234.434	335.482	522.612	191.204	230.536	220.007	235.823
2024/07/18	357.943	234.369	335.258	522.901	191.102	230.823	220.011	236.226
2024/07/19	358.026	234.347	335.170	523.243	191.027	231.127	220.093	236.621
2024/07/22	357.641	234.374	335.167	522.094	190.922	230.378	219.767	235.698
2024/07/23	357.414	234.319	335.039	521.596	190.771	230.135	219.490	235.467
2024/07/24	357.071	234.255	334.831	520.839	190.610	229.711	219.312	234.943
2024/07/25	357.302	234.141	334.589	521.840	190.573	230.462	219.610	235.881
2024/07/26	357.681	234.125	334.616	522.944	190.738	231.132	220.046	236.648
2024/07/29	358.453	234.203	335.009	524.776	191.201	232.100	220.781	237.714
2024/07/30	358.963	234.257	335.332	525.927	191.596	232.627	221.385	238.213
2024/07/31	357.277	233.895	334.143	522.402	190.657	230.804	220.046	236.185

出所:NFRC

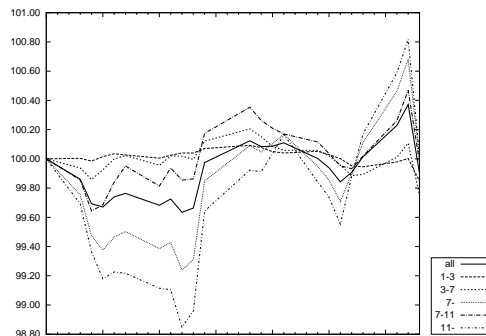
* は 1995 年 12 月末=100。それ以外は、1983 年 12 月末=100。

指数の推移(月次) 2023年7月末=100に補正。



出所:NFRC

指数の推移(日次) 2024年6月末=100に補正。



出所:NFRC

「除く ABS」残存別・投資収益率(2024年7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	357.423	-1.10	-1.93	0.83	-7.50	-5.17
短期 (1-3)	233.855	-1.69	-2.08	0.39	-0.94	-0.86
中期 (3-7)	334.140	-2.74	-3.38	0.64	-3.16	-2.54
長期 (7-)	520.660	0.06	-1.06	1.12	-12.49	-8.32
長期 (7-11)	190.657	-0.26	-1.24	0.97	-6.08	-4.10
超長期 (11-)	229.203	0.26	-0.95	1.21	-16.26	-10.79
(11-15)	220.048	1.89	0.85	1.04	-10.37	-6.48
(15-)	234.379	-0.32	-1.59	1.27	-18.37	-12.32

出所:NFRC

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

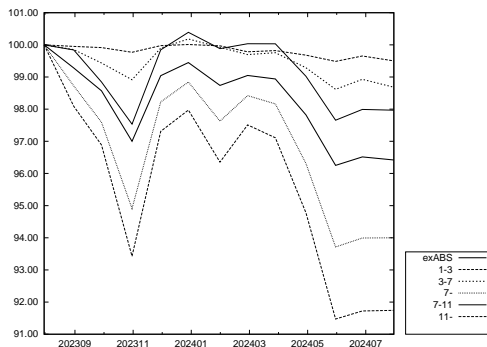
「除く ABS」残存別 投資収益指数の推移

除く ABS 年/月/日	全体	短期 (1-3)	中期 (3-7)	長期 (7-)	長期*			
					(7-11)	超長期* (11-)	(11-15)*	(15-)*
2023/07/31	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
2024/06/28	357.778	234.212	334.969	520.631	190.702	229.150	219.674	234.447
2024/07/01	357.280	234.221	334.761	519.370	190.426	228.458	219.173	233.678
2024/07/02	356.681	234.176	334.497	517.913	190.023	227.722	218.525	232.902
2024/07/03	356.600	234.248	334.716	517.422	190.103	227.315	218.419	232.378
2024/07/04	356.850	234.294	334.967	517.883	190.396	227.427	218.696	232.427
2024/07/05	356.935	234.276	335.046	518.077	190.609	227.408	218.938	232.309
2024/07/08	356.644	234.223	334.822	517.483	190.348	227.178	218.611	232.115
2024/07/09	356.799	234.270	335.036	517.700	190.582	227.160	218.739	232.041
2024/07/10	356.474	234.306	335.032	516.733	190.425	226.590	218.406	231.377
2024/07/11	356.577	234.305	334.955	517.097	190.442	226.835	218.517	231.674
2024/07/12	357.690	234.377	335.375	519.868	191.035	228.365	219.683	233.354
2024/07/16	358.221	234.429	335.655	521.108	191.376	228.994	220.226	234.020
2024/07/17	358.080	234.394	335.478	520.886	191.204	228.963	220.009	234.060
2024/07/18	358.088	234.328	335.254	521.165	191.102	229.235	220.014	234.436
2024/07/19	358.170	234.306	335.166	521.498	191.028	229.526	220.095	234.808
2024/07/22	357.786	234.334	335.163	520.372	190.922	228.805	219.770	233.931
2024/07/23	357.560	234.279	335.036	519.881	190.772	228.567	219.493	233.707
2024/07/24	357.218	234.215	334.828	519.136	190.611	228.158	219.314	233.206
2024/07/25	357.446	234.101	334.586	520.109	190.574	228.874	219.612	234.087
2024/07/26	357.825	234.085	334.612	521.194	190.739	229.522	220.048	234.821
2024/07/29	358.596	234.162	335.005	523.000	191.201	230.463	220.783	235.847
2024/07/30	359.107	234.217	335.328	524.139	191.596	230.981	221.388	236.336
2024/07/31	357.423	233.855	334.140	520.660	190.657	229.203	220.048	234.379

出所:NFRC

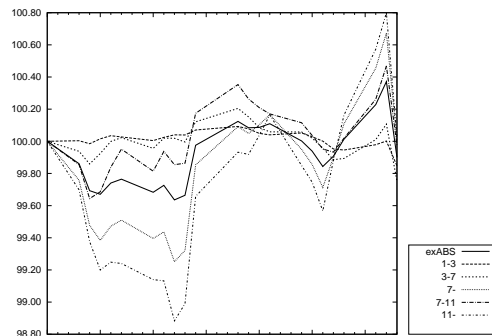
* は 1995年12月末=100。それ以外は、1983年12月末=100。

指数の推移(月次) 2023年7月末=100に補正。



出所:NFRC

指数の推移(日次) 2024年6月末=100に補正。



出所:NFRC

「除く国債」残存別・投資収益率(2024年7月末)

	累積投資 収益指数	前月末からの投資収益率			過去からの投資収益率	
		トータル	キャピタル	インカム	前年度末	前年末
除く国債	168.841	-1.19	-1.88	0.69	-4.88	-3.12
短期(1-3)	133.972	-1.54	-1.95	0.41	-0.69	-0.58
中期(3-7)	165.837	-2.36	-2.97	0.60	-2.71	-1.99
長期(7-)	228.926	-0.03	-0.96	0.93	-9.04	-5.49
長期(7-11)	196.902	0.09	-0.81	0.90	-5.29	-3.07
超長期(11-)	232.375	-0.10	-1.05	0.95	-11.37	-6.99

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(%)

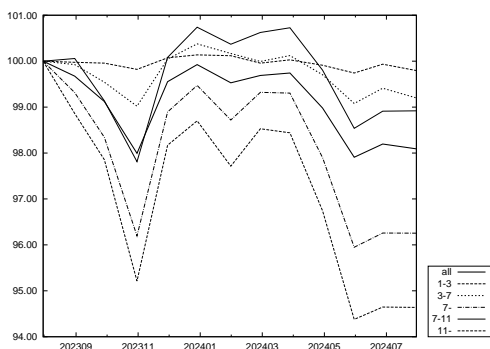
「除く国債」残存別・投資収益指数の推移

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-)
2023/07/31	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
2024/06/28	169.024	134.158	166.193	228.931	196.886	232.396
2024/07/01	168.857	134.165	166.097	228.489	196.616	231.863
2024/07/02	168.633	134.139	165.976	227.918	196.210	231.220
2024/07/03	168.646	134.180	166.085	227.797	196.271	230.972
2024/07/04	168.773	134.209	166.209	228.044	196.570	231.157
2024/07/05	168.835	134.202	166.251	228.205	196.796	231.254
2024/07/08	168.712	134.172	166.143	227.956	196.539	231.034
2024/07/09	168.800	134.201	166.248	228.095	196.780	231.082
2024/07/10	168.723	134.225	166.267	227.797	196.666	230.673
2024/07/11	168.743	134.225	166.231	227.903	196.687	230.834
2024/07/12	169.128	134.270	166.440	228.881	197.296	232.001
2024/07/16	169.330	134.305	166.581	229.345	197.649	232.508
2024/07/17	169.247	134.282	166.494	229.195	197.464	232.398
2024/07/18	169.201	134.245	166.387	229.204	197.354	232.496
2024/07/19	169.203	134.234	166.347	229.267	197.285	232.653
2024/07/22	169.112	134.252	166.349	228.950	197.183	232.202
2024/07/23	169.022	134.221	166.287	228.757	197.033	231.993
2024/07/24	168.897	134.182	166.182	228.507	196.852	231.715
2024/07/25	168.900	134.116	166.061	228.719	196.812	232.097
2024/07/26	169.015	134.107	166.078	229.085	196.993	232.572
2024/07/29	169.299	134.155	166.269	229.748	197.459	233.322
2024/07/30	169.513	134.190	166.427	230.235	197.867	233.826
2024/07/31	168.841	133.972	165.837	228.926	196.902	232.375

出所:NFRC

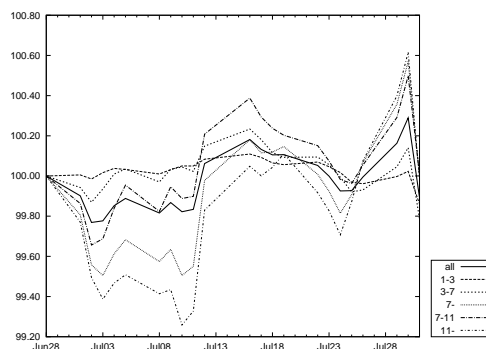
*は1995年12月末=100。それ以外は、1993年12月末=100。

指数の推移(月次) 2023年7月末=100に補正。



出所:NFRC

指数の推移(日次) 2024年6月末=100に補正。



出所:NFRC

銘柄 残存別・月間投資収益率(2024年7月末)

	全体	短期 (1-3)	中期 (3-7)	長期 (7-)		
					(7-11)	(11-)
総合	-1.10	-1.69	-2.74	0.06	-0.26	0.26
国債	-1.08	-1.72	-2.82	0.07	-0.31	0.31
30年国債	0.57	-	-2.71	0.63	0.32	0.66
20年国債	-0.12	-1.88	-2.76	1.07	0.00	1.76
10年国債	-1.90	-1.85	-2.83	-0.67	-0.67	-
5年国債	-2.34	-1.84	-2.90	-	-	-
中期国債	-1.07	-1.07	-	-	-	-
地方債	-0.85	-1.59	-2.27	0.72	0.39	1.09
東京都債	-0.86	-1.43	-2.06	0.89	0.55	1.43
五大都市債	-0.60	-1.50	-2.08	0.95	0.53	1.19
その他地方債	-0.88	-1.59	-2.24	0.64	0.33	1.00
政保債	-0.82	-1.73	-2.66	1.05	0.98	1.08
公営企業債券	-2.28	-1.70	-2.94	-	-	-
その他政保債	-0.63	-1.74	-2.60	1.05	0.98	1.08
金融債	-1.78	-1.39	-2.60	-0.50	-0.50	-
特定金融債	-	-	-	-	-	-
事業債	-1.70	-1.54	-2.46	-0.95	-0.56	-1.28
円建外債	-0.17	-0.96	-1.21	8.15	4.32	12.67
MBS	-0.83	-	-	-0.83	-1.66	-0.81
ABS	-1.07	-1.15	-2.16	0.87	-0.34	2.52

出所:NFRFC

「除く(銘柄)」残存別・月間投資収益率(2024年7月末)

	全体	短期 (1-3)	中期 (3-7)	長期 (7-)		
					(7-11)	(11-)
除く国債	-1.19	-1.54	-2.36	-0.03	0.09	-0.10
除く30年国債	-1.40	-1.69	-2.74	-0.17	-0.31	-0.04
除く20年国債	-1.45	-1.66	-2.73	-0.48	-0.41	-0.52
除く10年国債	-0.82	-1.62	-2.68	0.21	0.06	0.26
除く5年国債	-0.95	-1.63	-2.70	0.06	-0.26	0.26
除く中期国債	-1.10	-1.79	-2.74	0.06	-0.26	0.26
除く地方債	-1.12	-1.69	-2.78	0.03	-0.31	0.23
除く東京都債	-1.10	-1.69	-2.74	0.06	-0.27	0.26
除く五大都市債	-1.10	-1.69	-2.74	0.06	-0.26	0.25
除くその他地方債	-1.11	-1.69	-2.77	0.04	-0.29	0.24
除く政保債	-1.10	-1.69	-2.74	0.05	-0.27	0.25
除く公営企業債券	-1.10	-1.69	-2.74	0.06	-0.26	0.26
除くその他政保債	-1.11	-1.69	-2.74	0.05	-0.27	0.25
除く金融債	-1.10	-1.69	-2.74	0.06	-0.26	0.26
除く特定金融債	-1.10	-1.69	-2.74	0.06	-0.26	0.26
除く事業債	-1.06	-1.70	-2.76	0.10	-0.25	0.31
除く円建外債	-1.10	-1.69	-2.75	0.06	-0.27	0.25
除くMBS	-1.10	-1.69	-2.74	0.08	-0.26	0.30
除くABS	-1.10	-1.69	-2.74	0.06	-0.26	0.26
除くMBS・ABS	-1.10	-1.69	-2.74	0.08	-0.26	0.30

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7月末)

	全体	短期 (1-3)	中期 (3-7)	長期 (7-)	月間投資収益率	
					(7-11)	(11-)
事業債 全体	-1.70	-1.54	-2.46	-0.95	-0.56	-1.28
水産・農林業	-2.34	-	-2.34	-	-	-
鉱業	-1.49	-0.96	-2.04	-1.48	-1.48	-
建設業	-1.85	-1.72	-2.52	0.73	-0.34	2.25
食料品	-1.48	-1.63	-2.57	0.74	-0.06	2.13
繊維製品	-1.70	-2.14	-2.40	1.76	1.01	2.45
パルプ・紙	-1.33	-1.45	-2.39	1.11	-0.19	2.52
化学	-1.38	-1.65	-2.49	0.87	-0.47	2.65
医薬品	-1.24	-1.61	-2.50	-0.39	-1.26	2.06
石油・石炭製品	-1.16	-1.31	-2.23	-0.11	-0.58	1.88
ゴム製品	-1.96	-1.75	-2.38	-0.70	-0.70	-
ガラス・土石製品	-1.26	-1.48	-2.38	0.64	-0.09	2.46
鉄鋼	-1.84	-1.69	-2.55	0.43	0.06	2.64
非鉄金属	-1.95	-1.86	-2.54	-0.25	-0.25	-
金属製品	-2.18	-1.50	-2.53	-0.65	-0.65	-
機械	-1.81	-1.54	-2.55	-0.63	-0.63	-
電気機器	-1.84	-1.62	-2.53	0.26	0.26	-
輸送用機器	-1.45	-1.54	-2.43	0.83	-0.27	2.38
精密機器	-1.86	-1.88	-2.35	-0.04	-0.04	-
その他製品	-1.45	-1.52	-2.90	1.29	-1.47	2.34
電気・ガス業	-2.42	-1.53	-2.43	-2.90	-1.67	-4.23
陸運業	-2.53	-1.35	-2.35	-2.94	-0.58	-4.14
海運業	-1.58	-1.49	-2.42	0.54	0.54	-
空運業	0.67	-1.38	-2.57	2.51	1.77	3.25
倉庫・運輸関連業	-1.23	-0.50	-2.29	1.65	1.12	2.15
情報・通信業	-1.02	-1.11	-1.75	1.71	0.77	3.74
卸売業	-2.26	-1.66	-2.83	-1.77	-1.84	-1.62
小売業	-1.49	-1.19	-2.42	0.61	0.15	2.39
銀行業	-1.70	-1.18	-2.29	-0.37	-0.37	-
証券・商品先物取引業	-1.31	-1.04	-2.13	-0.58	-0.58	-
保険業	-1.97	-1.92	-2.58	-0.63	-0.63	-
その他金融業	-1.98	-1.38	-2.31	-3.32	-4.02	2.66
不動産業	-1.18	-1.73	-2.41	0.45	-0.06	1.20
サービス業	2.95	-3.58	-2.22	24.13	26.31	15.80
財投機関債	-1.34	-1.66	-2.67	0.00	-0.24	0.10

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7月末)

	全体	短期 (1-3)	中期 (3-7)	長期 (7-)	月間投資収益率	
					(7-11)	(11-)
事業債・円建外債 全体	-1.62	-1.49	-2.40	-0.80	-0.47	-1.08
AAA～A 格	-1.65	-1.52	-2.42	-0.84	-0.50	-1.13
AAA～AA 格	-1.80	-1.56	-2.54	-1.21	-0.83	-1.48
AAA 格	-2.30	-1.58	-2.64	-3.16	-2.50	-4.28
AA 格	-1.67	-1.56	-2.51	-0.98	-0.53	-1.28
A 格	-1.26	-1.41	-2.14	0.37	0.26	0.54
BBB 格	0.04	-0.44	-1.00	5.76	3.75	8.26
事業債 全体	-1.70	-1.54	-2.46	-0.95	-0.56	-1.28
AAA～A 格	-1.71	-1.55	-2.47	-0.95	-0.57	-1.28
AAA～AA 格	-1.82	-1.58	-2.58	-1.23	-0.87	-1.49
AAA 格	-2.30	-1.58	-2.64	-3.16	-2.50	-4.28
AA 格	-1.69	-1.57	-2.56	-1.01	-0.58	-1.29
A 格	-1.39	-1.48	-2.21	-0.02	0.14	-0.26
BBB 格	-0.84	-0.89	-1.38	2.41	2.14	2.79
円建外債 全体	-0.17	-0.96	-1.21	8.15	4.32	12.67
AAA～A 格	-0.36	-1.10	-1.32	8.34	4.22	13.23
AAA～AA 格	-1.06	-1.29	-1.45	4.54	3.79	16.74
AAA 格	-	-	-	-	-	-
AA 格	-1.06	-1.29	-1.45	4.54	3.79	16.74
A 格	0.20	-0.96	-1.19	9.67	4.57	13.12
BBB 格	1.09	0.32	-0.62	7.50	4.66	10.76

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7月末)

	全体	短期 (1-3)	中期 (3-7)	長期 (7-)	月間投資収益率	
					(7-11)	(11-)
事業債						
AAA~AA格	-1.82	-1.58	-2.58	-1.23	-0.87	-1.49
AAA~A格	-1.71	-1.55	-2.47	-0.95	-0.57	-1.28
AAA~BBB格	-1.70	-1.54	-2.46	-0.95	-0.56	-1.28
AAA~BB格	-1.70	-1.54	-2.46	-0.95	-0.56	-1.28
AAA格	-2.30	-1.58	-2.64	-3.16	-2.50	-4.28
AA格	-1.69	-1.57	-2.56	-1.01	-0.58	-1.29
A格	-1.39	-1.48	-2.21	-0.02	0.14	-0.26
BBB格	-0.84	-0.89	-1.38	2.41	2.14	2.79
BB格	-	-	-	-	-	-
B格以下	-	-	-	-	-	-
格付なし	-	-	-	-	-	-
円建外債						
AAA~AA格	-1.06	-1.29	-1.45	4.54	3.79	16.74
AAA~A格	-0.36	-1.10	-1.32	8.34	4.22	13.23
AAA~BBB格	-0.17	-0.96	-1.21	8.15	4.32	12.67
AAA~BB格	-0.17	-0.96	-1.21	8.15	4.32	12.67
AAA格	-	-	-	-	-	-
AA格	-1.06	-1.29	-1.45	4.54	3.79	16.74
A格	0.20	-0.96	-1.19	9.67	4.57	13.12
BBB格	1.09	0.32	-0.62	7.50	4.66	10.76
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7月末)

	全体	短期 (1-3)	中期 (3-7)	長期 (7-)	月間投資収益率	
					(7-11)	(11-)
事業債						
AAA~AA格	-1.96	-1.52	-2.54	-1.58	-0.10	-2.89
AAA~A格	-1.68	-1.55	-2.50	-0.87	-0.56	-1.14
AAA~BBB格	-1.71	-1.54	-2.49	-0.95	-0.56	-1.29
AAA~BB格	-1.70	-1.54	-2.46	-0.95	-0.56	-1.28
AAA格	-	-	-	-	-	-
AA格	-1.96	-1.52	-2.54	-1.58	-0.10	-2.89
A格	-1.63	-1.56	-2.49	-0.76	-0.62	-0.88
BBB格	-2.31	-1.27	-2.30	-3.86	-0.73	-7.53
BB格	0.80	-	0.27	5.87	-	5.87
B格以下	-	-	-	-	-	-
格付なし	-	-	-	-	-	-
円建外債						
AAA~AA格	-1.18	-1.21	-1.63	2.71	2.71	-
AAA~A格	-0.85	-1.18	-1.62	5.35	3.14	8.37
AAA~BBB格	-0.17	-0.96	-1.21	8.15	4.32	12.67
AAA~BB格	-0.17	-0.96	-1.21	8.15	4.32	12.67
AAA格	-	-	-	-	-	-
AA格	-1.18	-1.21	-1.63	2.71	2.71	-
A格	-0.80	-1.18	-1.62	5.61	3.22	8.37
BBB格	0.76	-0.57	-0.75	10.37	5.37	15.62
BB格	-	-	-	-	-	-
B格以下	-	-	-	-	-	-
格付なし	-	-	-	-	-	-

出所:NFRFC

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

事業債 円建外債 R&I 格付別・月間投資収益率(2024年7月末)

	全体	短期 (1-3)	中期 (3-7)	長期 (7-)	月間投資収益率	
					(7-11)	(11-)
事業債						
AAA~AA 格	-1.69	-1.62	-2.60	-0.86	-0.68	-0.97
AAA~A 格	-1.77	-1.55	-2.50	-1.17	-0.94	-1.36
AAA~BBB 格	-1.77	-1.54	-2.49	-1.16	-0.92	-1.36
AAA~BB 格	-1.77	-1.54	-2.49	-1.16	-0.92	-1.36
AAA 格	-1.78	-1.70	-2.48	0.34	-0.34	2.08
AA 格	-1.69	-1.62	-2.61	-0.86	-0.68	-0.98
A 格	-1.90	-1.45	-2.36	-1.77	-1.26	-2.47
BBB 格	-0.77	-0.73	-1.42	2.38	2.17	2.79
BB 格	-	-	-	-	-	-
B 格以下	-	-	-	-	-	-
格付なし	-1.00	-1.53	-2.24	2.49	3.40	0.73
円建外債						
AAA~AA 格	-0.93	-0.93	-	-	-	-
AAA~A 格	-1.17	-1.24	-1.44	3.02	3.02	-
AAA~BBB 格	-1.04	-1.24	-1.44	4.49	3.02	8.63
AAA~BB 格	-1.04	-1.24	-1.44	4.49	3.02	8.63
AAA 格	-	-	-	-	-	-
AA 格	-0.93	-0.93	-	-	-	-
A 格	-1.18	-1.27	-1.44	3.02	3.02	-
BBB 格	8.63	-	-	8.63	-	8.63
BB 格	-	-	-	-	-	-
B 格以下	-	-	-	-	-	-
格付なし	0.07	-0.87	-1.15	8.60	4.55	12.94

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7月末)

	全体	短期 (1-3)	中期 (3-7)	長期 (7-)	月間投資収益率	
					(7-11)	(11-)
事業債						
AAA~AA 格	-2.07	-1.52	-2.58	-1.98	-1.41	-2.77
AAA~A 格	-1.79	-1.51	-2.44	-1.12	-0.77	-1.63
AAA~BBB 格	-1.78	-1.50	-2.43	-1.11	-0.76	-1.61
AAA~BB 格	-1.78	-1.50	-2.43	-1.11	-0.76	-1.61
AAA 格	-2.31	-1.57	-2.65	-3.16	-2.50	-4.28
AA 格	-1.93	-1.48	-2.54	-1.60	-1.03	-2.35
A 格	-1.12	-1.50	-2.08	0.61	0.47	0.82
BBB 格	-0.32	-0.75	-0.59	2.85	2.91	2.79
BB 格	-	-	-	-	-	-
B 格以下	-	-	-	-	-	-
格付なし	-1.58	-1.61	-2.53	-0.80	-0.24	-1.08
円建外債						
AAA~AA 格	-0.16	-1.31	0.13	7.44	5.29	16.74
AAA~A 格	1.17	-1.05	-0.71	10.64	5.36	14.00
AAA~BBB 格	1.17	-1.05	-0.71	10.64	5.36	14.00
AAA~BB 格	1.17	-1.05	-0.71	10.64	5.36	14.00
AAA 格	-	-	-	-	-	-
AA 格	-0.16	-1.31	0.13	7.44	5.29	16.74
A 格	1.64	-0.94	-1.00	11.07	5.39	13.90
BBB 格	0.22	-	0.22	-	-	-
BB 格	-	-	-	-	-	-
B 格以下	-	-	-	-	-	-
格付なし	-0.69	-0.92	-1.34	5.48	3.70	9.72

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7月末)

	全体	短期 (1-3)	中期 (3-7)	長期 (7-)	月間投資収益率(%)	
					(7-11)	(11-)
事業債						
AAA~AA 格	-	-	-	-	-	-
AAA~A 格	-1.59	-1.64	-2.66	-0.60	-0.52	-0.64
AAA~BBB 格	-1.67	-1.65	-2.58	-0.82	-0.57	-0.98
AAA~BB 格	-1.67	-1.65	-2.58	-0.82	-0.57	-0.98
AAA 格	-	-	-	-	-	-
AA 格	-	-	-	-	-	-
A 格	-1.59	-1.64	-2.66	-0.60	-0.52	-0.64
BBB 格	-2.55	-1.74	-2.00	-4.03	-1.05	-7.04
BB 格	-	-	-	-	-	-
B 格以下	-	-	-	-	-	-
格付なし	-1.71	-1.48	-2.41	-1.03	-0.56	-1.55
円建外債						
AAA~AA 格	-1.24	-1.25	-1.66	3.09	3.09	-
AAA~A 格	-0.82	-1.20	-1.61	5.40	3.18	8.18
AAA~BBB 格	-0.14	-1.01	-1.23	8.27	4.38	12.67
AAA~BB 格	-0.14	-1.01	-1.23	8.27	4.38	12.67
AAA 格	-	-	-	-	-	-
AA 格	-1.24	-1.25	-1.66	3.09	3.09	-
A 格	-0.29	-1.15	-1.47	6.51	3.32	8.18
BBB 格	1.09	-0.52	-0.70	11.11	5.69	16.66
BB 格	-	-	-	-	-	-
B 格以下	-	-	-	-	-	-
格付なし	-0.48	-0.51	-0.80	2.71	2.71	-

出所:NFRFC

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

事業債 円建外債 S&P 格付別・月間投資収益率(2024年7月末)

	全体	短期 (1-3)	中期 (3-7)	長期 (7-)	月間投資収益率(%)	
					(7-11)	(11-)
事業債						
AAA~AA 格	-3.15	-2.09	-2.35	-3.38	-0.66	-5.00
AAA~A 格	-1.96	-1.62	-2.58	-1.62	-1.36	-1.83
AAA~BBB 格	-1.95	-1.60	-2.58	-1.60	-1.35	-1.82
AAA~BB 格	-1.91	-1.60	-2.47	-1.58	-1.35	-1.76
AAA 格	-	-	-	-	-	-
AA 格	-3.15	-2.09	-2.35	-3.38	-0.66	-5.00
A 格	-1.90	-1.61	-2.59	-1.43	-1.42	-1.43
BBB 格	-1.61	-1.33	-2.49	0.21	-0.40	2.64
BB 格	0.80	-	0.27	5.87	-	5.87
B 格以下	-	-	-	-	-	-
格付なし	-1.63	-1.52	-2.46	-0.70	-0.25	-1.08
円建外債						
AAA~AA 格	-1.25	-1.36	-1.66	2.71	2.71	-
AAA~A 格	-0.83	-1.19	-1.55	5.40	3.17	8.37
AAA~BBB 格	-0.16	-0.98	-1.21	8.19	4.35	12.67
AAA~BB 格	-0.16	-0.98	-1.21	8.19	4.35	12.67
AAA 格	-	-	-	-	-	-
AA 格	-1.25	-1.36	-1.66	2.71	2.71	-
A 格	-0.78	-1.16	-1.53	5.66	3.25	8.37
BBB 格	0.77	-0.64	-0.79	10.37	5.37	15.62
BB 格	-	-	-	-	-	-
B 格以下	-	-	-	-	-	-
格付なし	-0.31	-0.21	-1.20	1.99	1.99	-

出所:NFRFC

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

このページは空白です。

銘柄残存別・ポートフォリオ指標(2024年7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	1,138,128	95.54	95.74	10.18	0.79	1.05	1.02	8.66	8.60	8.62	4
短期(1-3)	231,360	99.87	99.97	1.94	0.39	0.44	0.44	1.93	1.92	1.93	6
中期(3-7)	307,045	99.93	100.08	4.79	0.65	0.67	0.67	4.71	4.69	4.71	4
長期(7-)	599,723	91.62	91.89	16.12	1.03	1.52	1.46	13.69	13.58	13.61	4
長期(7-11)	207,971	100.20	100.43	8.70	0.98	0.97	0.97	8.33	8.29	8.33	3
超長期(11-)	391,753	87.06	87.36	20.06	1.05	1.85	1.75	16.97	16.81	16.84	4
(11-15)	94,377	95.31	95.59	12.90	0.99	1.40	1.37	12.05	11.97	12.03	4
(15-)	297,376	84.45	84.74	22.34	1.07	2.02	1.88	18.73	18.54	18.56	4
国債	965,641	95.46	95.67	10.68	0.82	1.05	1.01	9.04	8.97	8.99	1
短期(1-3)	190,464	99.96	100.05	1.92	0.38	0.40	0.40	1.91	1.91	1.91	1
中期(3-7)	249,992	100.21	100.37	4.79	0.66	0.62	0.63	4.71	4.70	4.71	0
長期(7-)	525,186	91.56	91.85	16.65	1.05	1.53	1.45	14.10	13.99	14.01	1
長期(7-11)	180,561	100.55	100.79	8.72	0.99	0.94	0.94	8.35	8.31	8.34	0
超長期(11-)	344,625	86.85	87.17	20.81	1.08	1.89	1.76	17.59	17.43	17.44	1
(11-15)	82,480	95.83	96.12	12.96	1.01	1.38	1.35	12.10	12.02	12.08	1
(15-)	262,145	84.03	84.35	23.27	1.10	2.08	1.91	19.55	19.36	19.36	1
地方債	67,041	96.70	96.87	7.35	0.60	0.91	0.92	6.76	6.72	6.74	9
短期(1-3)	12,816	99.73	99.83	1.99	0.37	0.49	0.49	1.99	1.98	1.99	10
中期(3-7)	24,532	98.83	98.96	4.93	0.50	0.72	0.72	4.86	4.84	4.86	8
長期(7-)	29,693	93.64	93.87	11.66	0.78	1.27	1.30	10.62	10.54	10.57	10
政保債	14,162	95.56	95.66	9.27	0.71	1.02	0.98	7.95	7.90	7.92	6
短期(1-3)	3,316	99.47	99.52	1.95	0.20	0.45	0.45	1.94	1.94	1.94	7
中期(3-7)	4,347	99.84	99.92	4.47	0.58	0.66	0.66	4.41	4.40	4.41	5
長期(7-)	6,499	90.70	90.85	16.21	1.07	1.60	1.51	13.92	13.80	13.85	7
金融債	3,443	98.43	98.50	3.09	0.26	0.75	0.75	3.04	3.03	3.04	26
短期(1-3)	2,030	99.02	99.06	1.99	0.16	0.64	0.63	1.99	1.98	1.99	24
中期(3-7)	1,235	98.00	98.10	4.16	0.38	0.87	0.86	4.12	4.10	4.12	27
長期(7-)	178	94.74	94.88	8.13	0.59	1.33	1.29	7.92	7.87	7.92	40
事業債	69,496	95.45	95.62	7.49	0.72	1.20	1.16	6.39	6.34	6.36	39
短期(1-3)	20,725	99.36	99.46	2.02	0.44	0.75	0.75	2.01	2.00	2.01	36
中期(3-7)	25,246	98.42	98.58	4.69	0.67	1.01	1.00	4.61	4.58	4.61	38
長期(7-)	23,525	88.83	89.05	15.32	1.02	1.88	1.76	12.82	12.70	12.72	42
長期(7-11)	10,044	96.55	96.77	8.58	0.97	1.43	1.40	8.22	8.16	8.21	47
超長期(11-)	13,480	83.08	83.30	20.34	1.07	2.27	2.07	16.80	16.63	16.63	37
円建外債	3,549	98.86	99.07	3.89	1.06	1.35	1.34	3.69	3.66	3.68	79
短期(1-3)	1,783	99.51	99.69	2.13	0.93	1.15	1.15	2.11	2.10	2.11	74
中期(3-7)	1,408	98.57	98.78	4.24	1.02	1.37	1.36	4.14	4.11	4.14	78
長期(7-)	357	96.73	97.11	11.24	1.85	2.25	2.21	9.92	9.81	9.88	107
長期(7-11)	193	96.87	97.14	8.66	1.43	1.87	1.84	8.13	8.06	8.13	91
超長期(11-)	165	96.57	97.07	14.24	2.36	2.70	2.64	12.01	11.85	11.94	125
MBS	14,099	94.36	94.39	7.35	0.63	0.86	1.36	6.83	6.78	7.08	22
ABS	697	95.46	95.63	5.59	0.71	1.37	1.33	5.16	5.12	5.15	67
短期(1-3)	227	99.36	99.52	1.89	0.69	0.99	0.98	1.88	1.87	1.88	61
中期(3-7)	285	96.67	96.84	5.06	0.66	1.32	1.30	4.95	4.92	4.95	66
長期(7-)	185	88.81	88.99	10.92	0.81	1.98	1.86	9.99	9.90	9.98	76

出所:NFRC

「除く」銘柄 残存別・ポートフォリオ指標 (2024年7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	1,124,029	95.55	95.76	10.22	0.80	1.05	1.01	8.68	8.62	8.64	4
短期 (1-3)	231,360	99.87	99.97	1.94	0.39	0.44	0.44	1.93	1.92	1.93	6
中期 (3-7)	307,045	99.93	100.08	4.79	0.65	0.67	0.67	4.71	4.69	4.71	4
長期 (7-)	585,624	91.55	91.83	16.33	1.04	1.54	1.46	13.86	13.75	13.77	3
長期 (7-11)	207,781	100.20	100.43	8.71	0.98	0.97	0.97	8.34	8.29	8.33	3
超長期 (11-)	377,843	86.80	87.10	20.53	1.07	1.89	1.77	17.37	17.21	17.22	3
(11-15)	94,377	95.31	95.59	12.90	0.99	1.40	1.37	12.05	11.97	12.03	4
(15-)	283,466	83.96	84.27	23.07	1.09	2.08	1.91	19.38	19.19	19.18	3
除く ABS	1,137,431	95.54	95.74	10.18	0.79	1.05	1.02	8.66	8.60	8.62	4
短期 (1-3)	231,133	99.87	99.97	1.94	0.39	0.44	0.44	1.93	1.92	1.93	6
中期 (3-7)	306,760	99.93	100.08	4.79	0.65	0.67	0.67	4.71	4.69	4.71	4
長期 (7-)	599,538	91.62	91.89	16.12	1.03	1.52	1.46	13.69	13.58	13.61	3
長期 (7-11)	207,869	100.20	100.44	8.70	0.98	0.97	0.97	8.33	8.29	8.33	3
超長期 (11-)	391,669	87.06	87.36	20.06	1.05	1.85	1.75	16.97	16.81	16.84	4
(11-15)	94,321	95.32	95.60	12.90	0.99	1.40	1.37	12.05	11.97	12.03	4
(15-)	297,348	84.45	84.74	22.34	1.07	2.02	1.88	18.73	18.54	18.56	4
除く MBS・ABS	1,123,332	95.55	95.76	10.22	0.80	1.05	1.01	8.69	8.62	8.64	4
短期 (1-3)	231,133	99.87	99.97	1.94	0.39	0.44	0.44	1.93	1.92	1.93	6
中期 (3-7)	306,760	99.93	100.08	4.79	0.65	0.67	0.67	4.71	4.69	4.71	4
長期 (7-)	585,439	91.55	91.83	16.33	1.04	1.54	1.46	13.86	13.75	13.77	3
長期 (7-11)	207,680	100.20	100.44	8.71	0.98	0.97	0.97	8.34	8.30	8.33	3
超長期 (11-)	377,759	86.80	87.10	20.53	1.07	1.89	1.77	17.37	17.21	17.22	3
(11-15)	94,321	95.32	95.60	12.90	0.99	1.40	1.37	12.05	11.97	12.03	4
(15-)	283,438	83.96	84.27	23.07	1.09	2.08	1.91	19.38	19.19	19.18	3
除く 国債	172,487	95.99	96.14	7.40	0.66	1.04	1.06	6.57	6.52	6.57	24
短期 (1-3)	40,896	99.47	99.57	2.01	0.41	0.66	0.66	2.00	1.99	2.00	26
中期 (3-7)	57,054	98.69	98.83	4.76	0.59	0.87	0.86	4.68	4.66	4.68	24
長期 (7-)	74,537	92.01	92.19	12.39	0.86	1.41	1.47	10.83	10.74	10.82	23
長期 (7-11)	27,410	97.86	98.08	8.55	0.89	1.18	1.17	8.21	8.17	8.21	24
超長期 (11-)	47,127	88.60	88.76	14.62	0.84	1.57	1.67	12.51	12.39	12.50	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7月末、8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	1,149,557	95.57	95.78	10.22	0.80	1.05	1.02	8.70	8.64	8.66	4
短期(1-3)	231,485	99.87	99.97	1.96	0.39	0.45	0.45	1.95	1.94	1.95	6
中期(3-7)	311,080	99.92	100.07	4.80	0.65	0.67	0.67	4.72	4.70	4.72	4
長期(7-)	606,992	91.71	91.98	16.16	1.03	1.52	1.46	13.72	13.60	13.63	3
長期(7-11)	210,951	100.20	100.43	8.72	0.98	0.97	0.98	8.35	8.31	8.35	3
超長期(11-)	396,042	87.18	87.48	20.12	1.06	1.86	1.75	17.00	16.84	16.86	4
(11-15)	94,587	95.29	95.57	12.90	0.99	1.40	1.38	12.05	11.97	12.03	4
(15-)	301,455	84.64	84.94	22.39	1.08	2.02	1.89	18.74	18.56	18.57	4
国債	976,182	95.50	95.71	10.72	0.82	1.06	1.01	9.07	9.01	9.02	1
短期(1-3)	190,460	99.96	100.06	1.93	0.39	0.40	0.40	1.93	1.92	1.93	2
中期(3-7)	253,555	100.20	100.36	4.80	0.66	0.63	0.63	4.71	4.70	4.71	0
長期(7-)	532,167	91.66	91.95	16.68	1.06	1.54	1.45	14.12	14.00	14.02	1
長期(7-11)	183,341	100.55	100.79	8.74	0.99	0.94	0.95	8.36	8.32	8.36	0
超長期(11-)	348,826	86.99	87.30	20.86	1.09	1.90	1.76	17.61	17.45	17.46	1
(11-15)	82,622	95.82	96.11	12.96	1.01	1.38	1.35	12.10	12.02	12.08	1
(15-)	266,204	84.25	84.57	23.31	1.12	2.08	1.91	19.55	19.37	19.36	1
地方債	67,253	96.70	96.88	7.41	0.61	0.92	0.93	6.82	6.78	6.80	9
短期(1-3)	12,756	99.71	99.81	2.05	0.37	0.50	0.49	2.04	2.04	2.04	10
中期(3-7)	24,707	98.82	98.95	4.98	0.50	0.73	0.72	4.91	4.89	4.91	9
長期(7-)	29,790	93.67	93.90	11.72	0.79	1.28	1.30	10.67	10.59	10.61	10
政保債	14,169	95.55	95.65	9.37	0.72	1.03	0.99	8.06	8.00	8.03	6
短期(1-3)	3,258	99.41	99.46	2.07	0.20	0.47	0.47	2.07	2.06	2.07	6
中期(3-7)	4,390	99.95	100.03	4.57	0.61	0.67	0.66	4.50	4.49	4.50	5
長期(7-)	6,521	90.66	90.81	16.25	1.06	1.61	1.52	13.97	13.85	13.90	7
金融債	3,447	98.43	98.49	3.17	0.28	0.76	0.76	3.12	3.11	3.12	26
短期(1-3)	2,022	98.98	99.02	2.07	0.16	0.65	0.65	2.06	2.05	2.06	24
中期(3-7)	1,246	98.06	98.15	4.24	0.41	0.87	0.86	4.20	4.18	4.20	27
長期(7-)	178	94.74	94.88	8.13	0.59	1.33	1.29	7.92	7.87	7.92	40
事業債	70,039	95.49	95.65	7.51	0.73	1.21	1.16	6.41	6.36	6.38	39
短期(1-3)	20,916	99.35	99.45	2.05	0.44	0.76	0.76	2.04	2.03	2.04	36
中期(3-7)	25,473	98.41	98.57	4.73	0.68	1.01	1.00	4.64	4.62	4.64	38
長期(7-)	23,650	88.91	89.14	15.33	1.03	1.88	1.76	12.83	12.71	12.73	42
長期(7-11)	10,146	96.64	96.86	8.63	0.98	1.43	1.40	8.26	8.20	8.25	47
超長期(11-)	13,504	83.11	83.34	20.36	1.07	2.27	2.07	16.82	16.64	16.65	37
円建外債	3,650	98.88	99.09	3.86	1.05	1.34	1.33	3.67	3.64	3.67	78
短期(1-3)	1,873	99.52	99.69	2.17	0.93	1.14	1.14	2.15	2.14	2.15	73
中期(3-7)	1,420	98.58	98.79	4.24	1.02	1.37	1.36	4.15	4.12	4.15	77
長期(7-)	357	96.73	97.11	11.24	1.85	2.25	2.21	9.92	9.81	9.88	107
長期(7-11)	193	96.87	97.14	8.66	1.43	1.87	1.84	8.13	8.06	8.13	91
超長期(11-)	165	96.57	97.07	14.24	2.36	2.70	2.64	12.01	11.85	11.94	125
MBS	14,147	94.37	94.41	7.41	0.63	0.87	1.35	6.89	6.84	7.14	21
ABS	671	95.30	95.47	5.77	0.72	1.40	1.36	5.33	5.28	5.32	68
短期(1-3)	200	99.34	99.50	2.00	0.74	1.02	1.02	1.99	1.98	1.99	63
中期(3-7)	289	96.64	96.81	5.08	0.66	1.33	1.31	4.98	4.94	4.97	66
長期(7-)	182	88.73	88.90	10.99	0.81	1.99	1.86	10.05	9.96	10.04	75

出所:NFRIC

「除く」銘柄 残存別・ポートフォリオ指標 (2024年7月末、8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	1,135,410	95.59	95.80	10.26	0.80	1.06	1.02	8.72	8.66	8.67	4
短期 (1-3)	231,485	99.87	99.97	1.96	0.39	0.45	0.45	1.95	1.94	1.95	6
中期 (3-7)	311,080	99.92	100.07	4.80	0.65	0.67	0.67	4.72	4.70	4.72	4
長期 (7-)	592,846	91.64	91.92	16.37	1.04	1.54	1.46	13.88	13.77	13.79	3
長期 (7-11)	210,761	100.20	100.44	8.73	0.98	0.97	0.98	8.36	8.32	8.35	3
超長期 (11-)	382,085	86.92	87.23	20.58	1.08	1.90	1.77	17.39	17.23	17.25	3
(11-15)	94,587	95.29	95.57	12.90	0.99	1.40	1.38	12.05	11.97	12.03	4
(15-)	287,497	84.17	84.48	23.11	1.11	2.08	1.91	19.38	19.19	19.19	3
除く ABS	1,148,886	95.57	95.78	10.23	0.80	1.05	1.02	8.70	8.64	8.66	4
短期 (1-3)	231,284	99.87	99.97	1.96	0.39	0.45	0.44	1.95	1.94	1.95	6
中期 (3-7)	310,791	99.92	100.08	4.80	0.65	0.67	0.67	4.72	4.70	4.72	4
長期 (7-)	606,811	91.71	91.98	16.16	1.03	1.52	1.46	13.72	13.61	13.63	3
長期 (7-11)	210,853	100.20	100.44	8.72	0.98	0.97	0.97	8.35	8.31	8.35	3
超長期 (11-)	395,958	87.18	87.48	20.12	1.06	1.86	1.75	17.00	16.84	16.87	4
(11-15)	94,531	95.30	95.58	12.90	0.99	1.40	1.38	12.05	11.97	12.03	4
(15-)	301,427	84.64	84.94	22.39	1.08	2.02	1.89	18.74	18.56	18.57	4
除く MBS・ABS	1,134,739	95.59	95.80	10.26	0.80	1.06	1.02	8.72	8.66	8.68	4
短期 (1-3)	231,284	99.87	99.97	1.96	0.39	0.45	0.44	1.95	1.94	1.95	6
中期 (3-7)	310,791	99.92	100.08	4.80	0.65	0.67	0.67	4.72	4.70	4.72	4
長期 (7-)	592,664	91.64	91.92	16.37	1.04	1.54	1.46	13.89	13.77	13.79	3
長期 (7-11)	210,663	100.21	100.44	8.73	0.98	0.97	0.97	8.36	8.32	8.35	3
超長期 (11-)	382,001	86.92	87.23	20.58	1.08	1.90	1.77	17.40	17.24	17.25	3
(11-15)	94,531	95.30	95.58	12.90	0.99	1.40	1.38	12.05	11.97	12.03	4
(15-)	287,469	84.17	84.48	23.11	1.11	2.08	1.91	19.38	19.19	19.19	3
除く 国債	173,374	96.00	96.15	7.44	0.67	1.05	1.07	6.61	6.57	6.61	24
短期 (1-3)	41,025	99.46	99.55	2.06	0.41	0.67	0.66	2.05	2.04	2.05	26
中期 (3-7)	57,524	98.69	98.83	4.80	0.60	0.87	0.86	4.72	4.70	4.72	24
長期 (7-)	74,825	92.04	92.23	12.43	0.86	1.42	1.48	10.87	10.78	10.86	22
長期 (7-11)	27,610	97.88	98.10	8.62	0.89	1.18	1.17	8.27	8.22	8.27	23
超長期 (11-)	47,215	88.63	88.79	14.66	0.85	1.57	1.67	12.54	12.43	12.53	21

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7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	69,496	95.45	95.62	7.49	0.72	1.20	1.16	6.39	6.34	6.36	39
短期 (1-3)	20,725	99.36	99.46	2.02	0.44	0.75	0.75	2.01	2.00	2.01	36
中期 (3-7)	25,246	98.42	98.58	4.69	0.67	1.01	1.00	4.61	4.58	4.61	38
長期 (7-)	23,525	88.83	89.05	15.32	1.02	1.88	1.76	12.82	12.70	12.72	42
長期 (7-11)	10,044	96.55	96.77	8.58	0.97	1.43	1.40	8.22	8.16	8.21	47
超長期 (11-)	13,480	83.08	83.30	20.34	1.07	2.27	2.07	16.80	16.63	16.63	37
水産・農林業	33	99.07	99.35	4.25	0.86	1.09	1.09	4.17	4.15	4.17	50
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	33	99.07	99.35	4.25	0.86	1.09	1.09	4.17	4.15	4.17	50
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
鉱業	30	95.93	96.00	5.15	0.21	0.98	0.96	5.05	5.02	5.05	33
短期 (1-3)	10	99.09	99.12	1.62	0.08	0.65	0.64	1.62	1.62	1.62	29
中期 (3-7)	10	94.95	95.06	6.62	0.30	1.12	1.09	6.55	6.51	6.55	35
長期 (7-)	10	93.76	93.83	7.21	0.25	1.19	1.16	7.14	7.10	7.14	36
長期 (7-11)	10	93.76	93.83	7.21	0.25	1.19	1.16	7.14	7.10	7.14	36
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
建設業	1,186	97.38	97.46	4.43	0.44	0.97	0.95	4.25	4.23	4.25	36
短期 (1-3)	418	98.99	99.04	2.11	0.26	0.73	0.73	2.10	2.09	2.10	33
中期 (3-7)	618	97.77	97.87	4.42	0.49	0.98	0.97	4.36	4.34	4.36	37
長期 (7-)	150	91.26	91.36	10.91	0.75	1.63	1.55	10.27	10.19	10.26	42
長期 (7-11)	84	95.51	95.63	8.45	0.78	1.38	1.35	8.17	8.12	8.17	44
超長期 (11-)	66	85.85	85.94	14.05	0.71	1.98	1.84	13.24	13.12	13.22	41
食料品	1,449	97.35	97.49	4.85	0.47	0.98	0.97	4.60	4.57	4.60	34
短期 (1-3)	627	99.08	99.15	2.09	0.28	0.72	0.71	2.08	2.07	2.08	31
中期 (3-7)	512	97.66	97.79	4.59	0.45	0.98	0.97	4.53	4.51	4.53	35
長期 (7-)	310	93.36	93.62	10.85	0.89	1.57	1.51	10.12	10.04	10.11	39
長期 (7-11)	190	96.57	96.79	8.71	0.88	1.33	1.30	8.38	8.32	8.37	36
超長期 (11-)	120	88.27	88.59	14.25	0.92	1.98	1.87	13.15	13.02	13.11	43
繊維製品	235	97.41	97.48	4.85	0.52	1.02	1.00	4.62	4.60	4.62	37
短期 (1-3)	90	98.91	98.94	2.57	0.32	0.76	0.75	2.56	2.55	2.56	30
中期 (3-7)	109	98.05	98.14	4.41	0.52	0.99	0.98	4.35	4.33	4.35	38
長期 (7-)	36	91.71	91.83	11.90	1.03	1.80	1.72	11.06	10.96	11.04	50
長期 (7-11)	16	98.37	98.61	9.32	1.29	1.49	1.48	8.78	8.72	8.78	48
超長期 (11-)	20	86.38	86.41	13.96	0.83	2.09	1.95	13.13	13.00	13.11	52
パルプ・紙	344	96.17	96.25	5.03	0.45	1.14	1.12	4.72	4.69	4.72	48
短期 (1-3)	144	98.82	98.89	2.05	0.32	0.89	0.88	2.04	2.03	2.04	48
中期 (3-7)	130	97.04	97.11	4.86	0.44	1.05	1.03	4.79	4.77	4.79	40
長期 (7-)	70	89.14	89.23	11.45	0.75	1.93	1.82	10.70	10.60	10.68	65
長期 (7-11)	35	92.84	92.96	7.83	0.62	1.72	1.66	7.63	7.57	7.63	80
超長期 (11-)	35	85.43	85.50	15.07	0.88	2.16	2.00	14.03	13.89	13.99	48
化学	2,148	95.28	95.39	5.70	0.48	1.18	1.14	5.27	5.23	5.26	46
短期 (1-3)	657	98.98	99.04	2.09	0.28	0.76	0.76	2.09	2.08	2.09	35
中期 (3-7)	908	97.22	97.33	4.63	0.44	1.05	1.03	4.57	4.55	4.57	42
長期 (7-)	583	88.08	88.25	11.43	0.75	1.95	1.82	10.49	10.39	10.47	67
長期 (7-11)	310	94.33	94.48	8.01	0.68	1.50	1.46	7.78	7.73	7.78	58
超長期 (11-)	273	80.99	81.19	15.31	0.83	2.55	2.30	14.07	13.91	14.03	78
医薬品	718	95.39	95.51	6.20	0.49	1.16	1.12	5.80	5.76	5.80	40
短期 (1-3)	178	99.27	99.38	1.94	0.30	0.68	0.67	1.94	1.93	1.94	28
中期 (3-7)	175	98.43	98.64	4.21	0.53	0.91	0.91	4.15	4.13	4.15	32
長期 (7-)	365	92.03	92.13	9.24	0.56	1.54	1.47	8.68	8.62	8.67	51
長期 (7-11)	265	93.85	93.98	7.26	0.43	1.36	1.32	7.14	7.09	7.14	52
超長期 (11-)	100	87.22	87.24	14.48	0.91	2.03	1.89	13.10	12.97	13.05	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7月末、8月ポートフォリオ)

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
事業債 全体	70,039	95.49	95.65	7.51	0.73	1.21	1.16	6.41	6.36	6.38	39
短期 (1-3)	20,916	99.35	99.45	2.05	0.44	0.76	0.76	2.04	2.03	2.04	36
中期 (3-7)	25,473	98.41	98.57	4.73	0.68	1.01	1.00	4.64	4.62	4.64	38
長期 (7-)	23,650	88.91	89.14	15.33	1.03	1.88	1.76	12.83	12.71	12.73	42
長期 (7-11)	10,146	96.64	96.86	8.63	0.98	1.43	1.40	8.26	8.20	8.25	47
超長期 (11-)	13,504	83.11	83.34	20.36	1.07	2.27	2.07	16.82	16.64	16.65	37
水産・農林業	33	99.07	99.35	4.25	0.86	1.09	1.09	4.17	4.15	4.17	50
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	33	99.07	99.35	4.25	0.86	1.09	1.09	4.17	4.15	4.17	50
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
鉱業	30	95.93	96.00	5.15	0.21	0.98	0.96	5.05	5.02	5.05	33
短期 (1-3)	10	99.09	99.12	1.62	0.08	0.65	0.64	1.62	1.62	1.62	29
中期 (3-7)	10	94.95	95.06	6.62	0.30	1.12	1.09	6.55	6.51	6.55	35
長期 (7-)	10	93.76	93.83	7.21	0.25	1.19	1.16	7.14	7.10	7.14	36
長期 (7-11)	10	93.76	93.83	7.21	0.25	1.19	1.16	7.14	7.10	7.14	36
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
建設業	1,206	97.41	97.50	4.44	0.45	0.97	0.95	4.26	4.24	4.26	36
短期 (1-3)	418	98.99	99.04	2.11	0.26	0.73	0.73	2.10	2.09	2.10	33
中期 (3-7)	638	97.82	97.93	4.44	0.50	0.98	0.97	4.38	4.35	4.38	37
長期 (7-)	150	91.26	91.36	10.91	0.75	1.63	1.55	10.27	10.19	10.26	42
長期 (7-11)	84	95.51	95.63	8.45	0.78	1.38	1.35	8.17	8.12	8.17	44
超長期 (11-)	66	85.85	85.94	14.05	0.71	1.98	1.84	13.24	13.12	13.22	41
食料品	1,459	97.37	97.51	4.92	0.48	0.99	0.97	4.67	4.64	4.67	34
短期 (1-3)	617	99.07	99.14	2.10	0.28	0.72	0.72	2.10	2.09	2.10	31
中期 (3-7)	522	97.71	97.84	4.63	0.46	0.98	0.97	4.57	4.55	4.57	35
長期 (7-)	320	93.57	93.83	10.82	0.91	1.56	1.51	10.09	10.01	10.08	39
長期 (7-11)	200	96.76	96.98	8.77	0.90	1.33	1.31	8.42	8.37	8.42	36
超長期 (11-)	120	88.27	88.59	14.25	0.92	1.98	1.87	13.15	13.02	13.11	43
繊維製品	225	97.31	97.38	5.02	0.53	1.03	1.02	4.78	4.76	4.78	36
短期 (1-3)	80	98.82	98.84	2.76	0.33	0.77	0.77	2.75	2.74	2.75	29
中期 (3-7)	109	98.05	98.14	4.41	0.52	0.99	0.98	4.35	4.33	4.35	38
長期 (7-)	36	91.71	91.83	11.90	1.03	1.80	1.72	11.06	10.96	11.04	50
長期 (7-11)	16	98.37	98.61	9.32	1.29	1.49	1.48	8.78	8.72	8.78	48
超長期 (11-)	20	86.38	86.41	13.96	0.83	2.09	1.95	13.13	13.00	13.11	52
パルプ・紙	344	96.17	96.25	5.03	0.45	1.14	1.12	4.72	4.69	4.72	48
短期 (1-3)	144	98.82	98.89	2.05	0.32	0.89	0.88	2.04	2.03	2.04	48
中期 (3-7)	130	97.04	97.11	4.86	0.44	1.05	1.03	4.79	4.77	4.79	40
長期 (7-)	70	89.14	89.23	11.45	0.75	1.93	1.82	10.70	10.60	10.68	65
長期 (7-11)	35	92.84	92.96	7.83	0.62	1.72	1.66	7.63	7.57	7.63	80
超長期 (11-)	35	85.43	85.50	15.07	0.88	2.16	2.00	14.03	13.89	13.99	48
化学	2,178	95.33	95.45	5.69	0.48	1.18	1.14	5.26	5.22	5.26	46
短期 (1-3)	657	98.98	99.04	2.09	0.28	0.76	0.76	2.09	2.08	2.09	35
中期 (3-7)	938	97.29	97.40	4.64	0.45	1.05	1.03	4.58	4.55	4.58	42
長期 (7-)	583	88.08	88.25	11.43	0.75	1.95	1.82	10.49	10.39	10.47	67
長期 (7-11)	310	94.33	94.48	8.01	0.68	1.50	1.46	7.78	7.73	7.78	58
超長期 (11-)	273	80.99	81.19	15.31	0.83	2.55	2.30	14.07	13.91	14.03	78
医薬品	728	95.45	95.58	6.18	0.50	1.16	1.12	5.79	5.75	5.78	41
短期 (1-3)	178	99.27	99.38	1.94	0.30	0.68	0.67	1.94	1.93	1.94	28
中期 (3-7)	185	98.51	98.71	4.24	0.56	0.93	0.92	4.18	4.16	4.18	33
長期 (7-)	365	92.03	92.13	9.24	0.56	1.54	1.47	8.68	8.62	8.67	51
長期 (7-11)	265	93.85	93.98	7.26	0.43	1.36	1.32	7.14	7.09	7.14	52
超長期 (11-)	100	87.22	87.24	14.48	0.91	2.03	1.89	13.10	12.97	13.05	48

出所:NFRG

- 東証 33 業種分類を参考に NFRG で分類

事業債 業種別・ポートフォリオ指標 (2/4) (2024年7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	295	95.86	95.95	6.21	0.56	1.22	1.19	5.86	5.82	5.86	47
短期 (1-3)	70	99.16	99.21	1.78	0.24	0.71	0.71	1.77	1.76	1.77	35
中期 (3-7)	105	96.07	96.16	5.43	0.39	1.12	1.10	5.35	5.32	5.35	43
長期 (7-)	120	93.76	93.86	9.47	0.90	1.62	1.57	8.85	8.77	8.83	58
長期 (7-11)	95	95.65	95.74	7.88	0.84	1.45	1.42	7.63	7.58	7.63	56
超長期 (11-)	25	86.61	86.71	15.52	1.13	2.32	2.16	13.95	13.80	13.89	64
ゴム製品	330	97.81	97.92	3.94	0.39	0.93	0.92	3.87	3.85	3.87	36
短期 (1-3)	140	98.95	99.03	2.27	0.28	0.75	0.75	2.26	2.25	2.26	32
中期 (3-7)	160	97.31	97.42	4.65	0.41	1.01	0.99	4.60	4.58	4.60	38
長期 (7-)	30	95.17	95.41	7.99	0.74	1.42	1.39	7.74	7.68	7.73	52
長期 (7-11)	30	95.17	95.41	7.99	0.74	1.42	1.39	7.74	7.68	7.73	52
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
ガラス・土石製品	277	96.07	96.16	5.35	0.48	1.11	1.08	5.00	4.97	5.00	42
短期 (1-3)	98	99.15	99.20	1.93	0.26	0.70	0.70	1.92	1.91	1.92	32
中期 (3-7)	102	97.17	97.27	4.53	0.43	1.07	1.05	4.47	4.45	4.47	44
長期 (7-)	77	90.72	90.85	10.77	0.81	1.73	1.64	10.01	9.92	10.00	53
長期 (7-11)	52	95.43	95.57	8.63	0.82	1.42	1.39	8.33	8.27	8.33	45
超長期 (11-)	25	80.87	80.98	15.26	0.80	2.51	2.26	14.16	14.00	14.13	73
鉄鋼	453	97.85	97.97	4.26	0.53	1.02	1.01	4.12	4.10	4.12	43
短期 (1-3)	160	99.00	99.07	2.11	0.30	0.77	0.77	2.10	2.09	2.10	36
中期 (3-7)	230	97.81	97.93	4.35	0.55	1.05	1.04	4.30	4.27	4.30	45
長期 (7-)	63	95.08	95.36	9.37	1.02	1.58	1.53	8.81	8.74	8.81	54
長期 (7-11)	53	96.93	97.23	8.52	1.03	1.45	1.43	8.13	8.08	8.13	50
超長期 (11-)	10	85.31	85.43	13.87	0.95	2.36	2.18	12.92	12.78	12.89	77
非鉄金属	380	97.70	97.78	4.44	0.47	1.02	1.01	4.34	4.32	4.34	41
短期 (1-3)	130	98.76	98.82	2.27	0.27	0.83	0.83	2.26	2.25	2.26	39
中期 (3-7)	190	97.71	97.80	4.59	0.54	1.05	1.04	4.53	4.50	4.53	42
長期 (7-)	60	95.40	95.45	8.65	0.72	1.33	1.30	8.38	8.33	8.38	36
長期 (7-11)	60	95.40	95.45	8.65	0.72	1.33	1.30	8.38	8.33	8.38	36
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
金属製品	150	97.90	98.02	3.81	0.42	0.97	0.96	3.75	3.73	3.75	41
短期 (1-3)	35	98.94	98.99	1.97	0.23	0.77	0.77	1.97	1.96	1.97	37
中期 (3-7)	106	97.83	97.95	4.06	0.46	0.99	0.98	4.01	3.99	4.01	41
長期 (7-)	9	94.68	94.97	8.07	0.70	1.44	1.40	7.83	7.78	7.83	52
長期 (7-11)	9	94.68	94.97	8.07	0.70	1.44	1.40	7.83	7.78	7.83	52
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
機械	1,308	97.59	97.70	4.17	0.41	0.97	0.96	4.08	4.05	4.08	39
短期 (1-3)	516	99.00	99.08	2.01	0.27	0.76	0.75	2.00	2.00	2.00	36
中期 (3-7)	559	97.31	97.42	4.54	0.44	1.03	1.01	4.48	4.45	4.48	41
長期 (7-)	233	95.14	95.33	8.09	0.65	1.33	1.30	7.86	7.81	7.86	42
長期 (7-11)	233	95.14	95.33	8.09	0.65	1.33	1.30	7.86	7.81	7.86	42
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
電気機器	2,085	98.10	98.23	4.22	0.51	0.97	0.96	4.12	4.10	4.12	38
短期 (1-3)	780	99.17	99.25	2.08	0.33	0.74	0.73	2.07	2.06	2.07	33
中期 (3-7)	1,040	97.65	97.79	4.67	0.51	1.02	1.01	4.60	4.58	4.60	39
長期 (7-)	265	96.69	96.95	8.79	1.00	1.44	1.42	8.40	8.34	8.39	47
長期 (7-11)	265	96.69	96.95	8.79	1.00	1.44	1.42	8.40	8.34	8.39	47
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
輸送用機器	1,130	96.97	97.05	4.51	0.40	1.01	0.99	4.31	4.28	4.31	39
短期 (1-3)	534	98.88	98.92	2.09	0.26	0.80	0.80	2.08	2.07	2.08	39
中期 (3-7)	392	97.27	97.38	4.70	0.43	1.01	1.00	4.63	4.61	4.63	38
長期 (7-)	204	91.42	91.53	10.47	0.70	1.61	1.53	9.93	9.85	9.92	43
長期 (7-11)	114	95.53	95.66	8.46	0.72	1.33	1.30	8.20	8.15	8.20	38
超長期 (11-)	90	86.20	86.30	13.01	0.67	2.00	1.86	12.36	12.25	12.35	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7月末、8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	95.86	95.95	6.21	0.56	1.22	1.19	5.86	5.82	5.86	47
短期 (1-3)	80	99.11	99.17	1.93	0.26	0.73	0.73	1.92	1.91	1.92	35
中期 (3-7)	95	95.79	95.87	5.69	0.39	1.15	1.13	5.60	5.57	5.60	44
長期 (7-)	120	93.76	93.86	9.47	0.90	1.62	1.57	8.85	8.77	8.83	58
長期 (7-11)	95	95.65	95.74	7.88	0.84	1.45	1.42	7.63	7.58	7.63	56
超長期 (11-)	25	86.61	86.71	15.52	1.13	2.32	2.16	13.95	13.80	13.89	64
ゴム製品	330	97.81	97.92	3.94	0.39	0.93	0.92	3.87	3.85	3.87	36
短期 (1-3)	140	98.95	99.03	2.27	0.28	0.75	0.75	2.26	2.25	2.26	32
中期 (3-7)	160	97.31	97.42	4.65	0.41	1.01	0.99	4.60	4.58	4.60	38
長期 (7-)	30	95.17	95.41	7.99	0.74	1.42	1.39	7.74	7.68	7.73	52
長期 (7-11)	30	95.17	95.41	7.99	0.74	1.42	1.39	7.74	7.68	7.73	52
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
ガラス・土石製品	277	96.07	96.16	5.35	0.48	1.11	1.08	5.00	4.97	5.00	42
短期 (1-3)	98	99.15	99.20	1.93	0.26	0.70	0.70	1.92	1.91	1.92	32
中期 (3-7)	102	97.17	97.27	4.53	0.43	1.07	1.05	4.47	4.45	4.47	44
長期 (7-)	77	90.72	90.85	10.77	0.81	1.73	1.64	10.01	9.92	10.00	53
長期 (7-11)	52	95.43	95.57	8.63	0.82	1.42	1.39	8.33	8.27	8.33	45
超長期 (11-)	25	80.87	80.98	15.26	0.80	2.51	2.26	14.16	14.00	14.13	73
鉄鋼	443	97.80	97.92	4.33	0.52	1.03	1.02	4.19	4.17	4.19	43
短期 (1-3)	150	98.92	98.97	2.17	0.27	0.78	0.77	2.17	2.16	2.17	35
中期 (3-7)	230	97.81	97.93	4.35	0.55	1.05	1.04	4.30	4.27	4.30	45
長期 (7-)	63	95.08	95.36	9.37	1.02	1.58	1.53	8.81	8.74	8.81	54
長期 (7-11)	53	96.93	97.23	8.52	1.03	1.45	1.43	8.13	8.08	8.13	50
超長期 (11-)	10	85.31	85.43	13.87	0.95	2.36	2.18	12.92	12.78	12.89	77
非鉄金属	380	97.70	97.78	4.44	0.47	1.02	1.01	4.34	4.32	4.34	41
短期 (1-3)	140	98.74	98.81	2.33	0.27	0.83	0.83	2.32	2.31	2.32	39
中期 (3-7)	180	97.67	97.75	4.68	0.55	1.06	1.04	4.61	4.59	4.61	43
長期 (7-)	60	95.40	95.45	8.65	0.72	1.33	1.30	8.38	8.33	8.38	36
長期 (7-11)	60	95.40	95.45	8.65	0.72	1.33	1.30	8.38	8.33	8.38	36
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
金属製品	150	97.90	98.02	3.81	0.42	0.97	0.96	3.75	3.73	3.75	41
短期 (1-3)	75	98.77	98.90	2.56	0.36	0.86	0.86	2.54	2.53	2.54	40
中期 (3-7)	66	97.35	97.43	4.65	0.45	1.02	1.01	4.60	4.57	4.60	40
長期 (7-)	9	94.68	94.97	8.07	0.70	1.44	1.40	7.83	7.78	7.83	52
長期 (7-11)	9	94.68	94.97	8.07	0.70	1.44	1.40	7.83	7.78	7.83	52
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
機械	1,322	97.61	97.72	4.20	0.42	0.97	0.96	4.10	4.08	4.10	39
短期 (1-3)	526	98.99	99.07	2.03	0.27	0.76	0.75	2.02	2.02	2.02	36
中期 (3-7)	559	97.32	97.44	4.57	0.44	1.03	1.02	4.51	4.48	4.51	41
長期 (7-)	237	95.21	95.40	8.12	0.66	1.33	1.30	7.89	7.84	7.89	42
長期 (7-11)	237	95.21	95.40	8.12	0.66	1.33	1.30	7.89	7.84	7.89	42
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
電気機器	2,095	98.10	98.23	4.23	0.51	0.97	0.96	4.12	4.10	4.12	38
短期 (1-3)	780	99.17	99.25	2.08	0.33	0.74	0.73	2.07	2.06	2.07	33
中期 (3-7)	1,050	97.67	97.80	4.67	0.51	1.02	1.01	4.60	4.58	4.60	39
長期 (7-)	265	96.69	96.95	8.79	1.00	1.44	1.42	8.40	8.34	8.39	47
長期 (7-11)	265	96.69	96.95	8.79	1.00	1.44	1.42	8.40	8.34	8.39	47
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
輸送用機器	1,130	96.97	97.05	4.51	0.40	1.01	0.99	4.31	4.28	4.31	39
短期 (1-3)	534	98.88	98.92	2.09	0.26	0.80	0.80	2.08	2.07	2.08	39
中期 (3-7)	392	97.27	97.38	4.70	0.43	1.01	1.00	4.63	4.61	4.63	38
長期 (7-)	204	91.42	91.53	10.47	0.70	1.61	1.53	9.93	9.85	9.92	43
長期 (7-11)	114	95.53	95.66	8.46	0.72	1.33	1.30	8.20	8.15	8.20	38
超長期 (11-)	90	86.20	86.30	13.01	0.67	2.00	1.86	12.36	12.25	12.35	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7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	240	97.73	97.86	4.61	0.58	1.06	1.05	4.49	4.46	4.49	44
短期 (1-3)	80	99.30	99.40	2.32	0.39	0.72	0.72	2.31	2.30	2.31	29
中期 (3-7)	125	97.30	97.43	5.04	0.60	1.14	1.13	4.96	4.93	4.96	49
長期 (7-)	35	95.63	95.90	8.29	0.97	1.58	1.55	7.95	7.89	7.95	65
長期 (7-11)	35	95.63	95.90	8.29	0.97	1.58	1.55	7.95	7.89	7.95	65
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
その他製品	190	94.49	94.62	7.02	0.52	1.22	1.18	6.55	6.50	6.54	39
短期 (1-3)	30	98.75	98.87	2.18	0.41	0.99	0.98	2.17	2.16	2.17	56
中期 (3-7)	100	97.52	97.58	5.11	0.49	1.00	0.99	5.05	5.03	5.05	35
長期 (7-)	60	87.30	87.55	12.60	0.61	1.77	1.65	11.80	11.70	11.79	37
長期 (7-11)	15	96.09	96.32	7.10	0.55	1.15	1.12	6.95	6.91	6.95	34
超長期 (11-)	45	84.37	84.62	14.44	0.63	2.01	1.85	13.64	13.52	13.62	38
電気・ガス業	12,232	94.32	94.49	8.13	0.79	1.38	1.33	7.11	7.06	7.09	49
短期 (1-3)	2,672	99.35	99.45	2.13	0.47	0.76	0.76	2.12	2.11	2.12	35
中期 (3-7)	4,107	97.96	98.12	4.91	0.73	1.14	1.13	4.80	4.78	4.80	50
長期 (7-)	5,453	89.10	89.32	13.50	0.99	1.92	1.81	11.75	11.64	11.70	55
長期 (7-11)	2,640	95.70	95.92	8.69	0.97	1.54	1.51	8.31	8.25	8.30	57
超長期 (11-)	2,813	82.91	83.13	18.00	1.00	2.34	2.13	15.48	15.31	15.38	52
陸運業	6,085	90.05	90.40	13.27	1.00	1.55	1.43	10.08	9.99	9.97	35
短期 (1-3)	787	100.19	100.44	1.93	0.76	0.69	0.69	1.92	1.91	1.92	31
中期 (3-7)	1,690	100.35	100.70	5.06	1.09	0.96	0.96	4.91	4.89	4.91	32
長期 (7-)	3,608	83.02	83.38	19.60	1.02	2.11	1.90	15.15	14.99	14.95	38
長期 (7-11)	1,025	98.46	98.83	8.82	1.12	1.32	1.31	8.38	8.32	8.37	36
超長期 (11-)	2,583	76.90	77.25	23.87	0.98	2.51	2.20	18.59	18.38	18.29	39
海運業	163	98.61	98.79	5.25	0.92	1.15	1.14	5.07	5.04	5.07	48
短期 (1-3)	20	101.15	101.29	1.94	1.46	0.82	0.83	1.92	1.91	1.92	43
中期 (3-7)	103	98.14	98.26	4.48	0.63	1.07	1.06	4.41	4.39	4.41	46
長期 (7-)	40	98.54	98.91	8.90	1.38	1.53	1.51	8.36	8.30	8.36	56
長期 (7-11)	40	98.54	98.91	8.90	1.38	1.53	1.51	8.36	8.30	8.36	56
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
空運業	315	93.49	93.68	8.22	0.98	1.76	1.68	7.40	7.32	7.39	79
短期 (1-3)	90	99.19	99.34	2.04	0.65	1.06	1.06	2.03	2.02	2.03	65
中期 (3-7)	40	95.51	95.60	4.77	0.36	1.34	1.32	4.72	4.69	4.72	69
長期 (7-)	185	90.27	90.52	11.97	1.28	2.22	2.10	10.88	10.76	10.86	88
長期 (7-11)	85	98.36	98.63	9.59	1.53	1.74	1.72	8.92	8.85	8.92	70
超長期 (11-)	100	83.40	83.62	13.99	1.07	2.70	2.48	12.83	12.68	12.80	106
倉庫・運輸関連業	159	94.89	95.06	6.50	0.56	1.34	1.30	6.15	6.11	6.15	55
短期 (1-3)	17	99.71	99.79	1.25	0.40	0.66	0.65	1.25	1.24	1.25	37
中期 (3-7)	105	95.79	95.92	5.37	0.46	1.29	1.26	5.28	5.25	5.28	60
長期 (7-)	37	90.07	90.37	12.21	0.93	1.84	1.74	11.33	11.23	11.32	49
長期 (7-11)	17	97.28	97.73	9.42	1.18	1.51	1.49	8.90	8.84	8.90	48
超長期 (11-)	20	84.11	84.30	14.50	0.72	2.15	1.98	13.66	13.53	13.64	51
情報・通信業	2,199	96.57	96.79	4.59	0.89	1.54	1.51	4.26	4.22	4.25	91
短期 (1-3)	810	99.06	99.22	1.97	0.66	1.14	1.13	1.95	1.94	1.95	74
中期 (3-7)	1,052	97.19	97.40	4.67	0.91	1.52	1.49	4.55	4.51	4.55	88
長期 (7-)	338	88.67	89.08	10.67	1.40	2.73	2.56	9.44	9.32	9.41	148
長期 (7-11)	220	92.73	93.10	8.58	1.23	2.25	2.17	8.09	8.01	8.09	124
超長期 (11-)	118	81.06	81.55	14.57	1.73	3.75	3.40	12.32	12.11	12.25	198
卸売業	1,279	97.48	97.68	6.42	0.89	1.17	1.15	6.04	6.00	6.04	40
短期 (1-3)	220	100.22	100.42	2.06	0.92	0.80	0.80	2.04	2.03	2.04	40
中期 (3-7)	605	99.16	99.33	4.92	0.84	1.03	1.03	4.81	4.79	4.81	39
長期 (7-)	454	93.92	94.15	10.54	0.95	1.55	1.49	9.83	9.76	9.82	40
長期 (7-11)	309	97.62	97.88	8.80	1.02	1.32	1.31	8.41	8.36	8.41	35
超長期 (11-)	145	86.06	86.22	14.23	0.82	2.09	1.94	13.28	13.15	13.25	50

出所:NFRC

- 東証 33 業種分類を参考に NFRC で分類

事業債 業種別・ポートフォリオ指標 (3/4) (2024年7月末、8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	97.73	97.86	4.61	0.58	1.06	1.05	4.49	4.46	4.49	44
短期 (1-3)	80	99.30	99.40	2.32	0.39	0.72	0.72	2.31	2.30	2.31	29
中期 (3-7)	125	97.30	97.43	5.04	0.60	1.14	1.13	4.96	4.93	4.96	49
長期 (7-)	35	95.63	95.90	8.29	0.97	1.58	1.55	7.95	7.89	7.95	65
長期 (7-11)	35	95.63	95.90	8.29	0.97	1.58	1.55	7.95	7.89	7.95	65
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
その他製品	195	94.62	94.75	6.96	0.53	1.22	1.18	6.50	6.46	6.50	39
短期 (1-3)	30	98.75	98.87	2.18	0.41	0.99	0.98	2.17	2.16	2.17	56
中期 (3-7)	105	97.63	97.70	5.10	0.51	1.00	0.99	5.04	5.01	5.04	35
長期 (7-)	60	87.30	87.55	12.60	0.61	1.77	1.65	11.80	11.70	11.79	37
長期 (7-11)	15	96.09	96.32	7.10	0.55	1.15	1.12	6.95	6.91	6.95	34
超長期 (11-)	45	84.37	84.62	14.44	0.63	2.01	1.85	13.64	13.52	13.62	38
電気・ガス業	12,248	94.32	94.49	8.16	0.79	1.39	1.33	7.14	7.08	7.12	49
短期 (1-3)	2,642	99.34	99.43	2.16	0.47	0.77	0.76	2.14	2.14	2.14	35
中期 (3-7)	4,237	97.87	98.02	4.98	0.73	1.15	1.14	4.87	4.84	4.87	51
長期 (7-)	5,369	89.05	89.27	13.62	1.00	1.93	1.81	11.85	11.73	11.79	54
長期 (7-11)	2,566	95.78	95.99	8.80	0.98	1.54	1.51	8.40	8.33	8.39	56
超長期 (11-)	2,803	82.90	83.11	18.03	1.01	2.34	2.13	15.50	15.33	15.39	52
陸運業	6,095	90.07	90.41	13.27	1.00	1.55	1.43	10.08	9.98	9.97	35
短期 (1-3)	787	100.19	100.44	1.93	0.76	0.69	0.69	1.92	1.91	1.92	31
中期 (3-7)	1,690	100.35	100.70	5.06	1.09	0.96	0.96	4.91	4.89	4.91	32
長期 (7-)	3,618	83.07	83.42	19.57	1.02	2.11	1.90	15.13	14.97	14.93	38
長期 (7-11)	1,035	98.46	98.83	8.83	1.12	1.32	1.31	8.39	8.33	8.38	36
超長期 (11-)	2,583	76.90	77.25	23.87	0.98	2.51	2.20	18.59	18.38	18.29	39
海運業	163	98.61	98.79	5.25	0.92	1.15	1.14	5.07	5.04	5.07	48
短期 (1-3)	20	101.15	101.29	1.94	1.46	0.82	0.83	1.92	1.91	1.92	43
中期 (3-7)	103	98.14	98.26	4.48	0.63	1.07	1.06	4.41	4.39	4.41	46
長期 (7-)	40	98.54	98.91	8.90	1.38	1.53	1.51	8.36	8.30	8.36	56
長期 (7-11)	40	98.54	98.91	8.90	1.38	1.53	1.51	8.36	8.30	8.36	56
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
空運業	315	93.49	93.68	8.22	0.98	1.76	1.68	7.40	7.32	7.39	79
短期 (1-3)	90	99.19	99.34	2.04	0.65	1.06	1.06	2.03	2.02	2.03	65
中期 (3-7)	40	95.51	95.60	4.77	0.36	1.34	1.32	4.72	4.69	4.72	69
長期 (7-)	185	90.27	90.52	11.97	1.28	2.22	2.10	10.88	10.76	10.86	88
長期 (7-11)	85	98.36	98.63	9.59	1.53	1.74	1.72	8.92	8.85	8.92	70
超長期 (11-)	100	83.40	83.62	13.99	1.07	2.70	2.48	12.83	12.68	12.80	106
倉庫・運輸関連業	159	94.89	95.06	6.50	0.56	1.34	1.30	6.15	6.11	6.15	55
短期 (1-3)	17	99.71	99.79	1.25	0.40	0.66	0.65	1.25	1.24	1.25	37
中期 (3-7)	105	95.79	95.92	5.37	0.46	1.29	1.26	5.28	5.25	5.28	60
長期 (7-)	37	90.07	90.37	12.21	0.93	1.84	1.74	11.33	11.23	11.32	49
長期 (7-11)	17	97.28	97.73	9.42	1.18	1.51	1.49	8.90	8.84	8.90	48
超長期 (11-)	20	84.11	84.30	14.50	0.72	2.15	1.98	13.66	13.53	13.64	51
情報・通信業	2,199	96.57	96.79	4.59	0.89	1.54	1.51	4.26	4.22	4.25	91
短期 (1-3)	850	99.17	99.37	2.02	0.71	1.15	1.14	2.00	1.99	2.00	74
中期 (3-7)	1,012	97.02	97.20	4.73	0.88	1.53	1.50	4.61	4.58	4.61	88
長期 (7-)	338	88.67	89.08	10.67	1.40	2.73	2.56	9.44	9.32	9.41	148
長期 (7-11)	220	92.73	93.10	8.58	1.23	2.25	2.17	8.09	8.01	8.09	124
超長期 (11-)	118	81.06	81.55	14.57	1.73	3.75	3.40	12.32	12.11	12.25	198
卸売業	1,302	97.52	97.72	6.40	0.90	1.17	1.15	6.02	5.98	6.02	40
短期 (1-3)	223	100.22	100.41	2.07	0.93	0.81	0.81	2.05	2.04	2.05	41
中期 (3-7)	622	99.18	99.35	4.92	0.85	1.04	1.03	4.81	4.79	4.81	40
長期 (7-)	457	93.96	94.19	10.53	0.96	1.55	1.49	9.83	9.75	9.82	40
長期 (7-11)	312	97.64	97.90	8.81	1.02	1.32	1.31	8.42	8.36	8.41	36
超長期 (11-)	145	86.06	86.22	14.23	0.82	2.09	1.94	13.28	13.15	13.25	50

出所:NFRG

- 東証 33 業種分類を参考に NFRG で分類

事業債 業種別・ポートフォリオ指標 (4/4) (2024年7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	1,214	98.41	98.54	4.02	0.56	0.94	0.93	3.88	3.85	3.87	38
短期 (1-3)	489	99.37	99.43	1.73	0.34	0.68	0.68	1.73	1.72	1.73	32
中期 (3-7)	548	98.48	98.64	4.21	0.60	1.00	0.99	4.15	4.13	4.15	40
長期 (7-)	177	95.53	95.79	9.76	1.03	1.53	1.49	9.18	9.11	9.17	46
長期 (7-11)	137	97.77	98.07	8.57	1.07	1.40	1.39	8.18	8.12	8.18	46
超長期 (11-)	40	87.86	87.96	13.84	0.88	2.00	1.88	12.98	12.86	12.96	46
銀行業	1,337	100.02	100.28	3.41	1.26	1.14	1.14	3.32	3.30	3.32	63
短期 (1-3)	667	100.96	101.26	1.98	1.51	1.04	1.04	1.96	1.95	1.96	65
中期 (3-7)	652	99.17	99.38	4.74	1.01	1.25	1.24	4.61	4.58	4.61	62
長期 (7-)	18	96.09	96.24	8.59	0.83	1.34	1.31	8.29	8.23	8.28	38
長期 (7-11)	18	96.09	96.24	8.59	0.83	1.34	1.31	8.29	8.23	8.28	38
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
証券、商品先物取引業	1,031	99.12	99.33	2.41	0.87	1.18	1.18	2.38	2.36	2.38	75
短期 (1-3)	775	99.37	99.57	1.90	0.87	1.14	1.14	1.88	1.87	1.88	76
中期 (3-7)	252	98.47	98.71	3.88	0.87	1.29	1.29	3.81	3.79	3.81	72
長期 (7-)	5	93.05	93.42	8.09	0.90	1.89	1.83	7.78	7.71	7.78	95
長期 (7-11)	5	93.05	93.42	8.09	0.90	1.89	1.83	7.78	7.71	7.78	95
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
保険業	335	97.95	98.04	3.61	0.38	0.95	0.94	3.54	3.52	3.54	40
短期 (1-3)	165	98.65	98.69	2.29	0.20	0.81	0.80	2.29	2.28	2.29	37
中期 (3-7)	120	98.37	98.49	3.52	0.46	0.94	0.93	3.49	3.47	3.49	39
長期 (7-)	50	94.62	94.84	8.21	0.75	1.49	1.45	7.95	7.89	7.95	55
長期 (7-11)	50	94.62	94.84	8.21	0.75	1.49	1.45	7.95	7.89	7.95	55
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
その他金融業	6,150	97.95	98.05	3.87	0.45	0.96	0.95	3.76	3.74	3.76	40
短期 (1-3)	2,833	99.08	99.15	1.97	0.31	0.79	0.78	1.96	1.96	1.96	39
中期 (3-7)	2,652	97.77	97.88	4.62	0.52	1.01	0.99	4.55	4.53	4.55	38
長期 (7-)	666	93.88	94.05	8.97	0.77	1.53	1.48	8.55	8.48	8.54	52
長期 (7-11)	588	95.14	95.31	8.27	0.74	1.43	1.39	8.01	7.95	8.00	49
超長期 (11-)	78	84.39	84.59	14.28	0.96	2.41	2.22	13.16	13.01	13.12	78
不動産業	2,620	94.69	94.87	7.73	0.73	1.32	1.27	6.70	6.64	6.67	46
短期 (1-3)	531	99.14	99.24	2.25	0.42	0.82	0.81	2.24	2.23	2.24	39
中期 (3-7)	1,038	97.66	97.81	4.75	0.61	1.09	1.08	4.67	4.64	4.67	45
長期 (7-)	1,051	89.52	89.77	13.43	1.00	1.85	1.73	11.37	11.27	11.31	51
長期 (7-11)	578	96.64	96.86	8.65	1.00	1.43	1.41	8.27	8.21	8.27	47
超長期 (11-)	473	80.83	81.10	19.27	1.00	2.46	2.21	15.90	15.72	15.75	57
サービス業	769	90.29	90.42	5.00	0.61	2.30	2.08	4.47	4.41	4.47	148
短期 (1-3)	267	97.82	97.90	1.90	0.36	1.40	1.38	1.88	1.87	1.88	100
中期 (3-7)	292	96.09	96.20	4.72	0.47	1.33	1.29	4.65	4.62	4.65	67
長期 (7-)	210	72.67	72.86	9.34	1.14	5.60	4.75	8.55	8.35	8.54	377
長期 (7-11)	160	75.74	75.91	8.23	1.04	5.23	4.54	7.75	7.58	7.75	365
超長期 (11-)	50	62.82	63.08	12.91	1.45	7.04	5.56	11.61	11.31	11.57	423
財投機関債	20,628	95.41	95.55	9.40	0.79	1.11	1.07	7.78	7.72	7.73	17
短期 (1-3)	5,687	99.60	99.67	1.97	0.35	0.56	0.56	1.97	1.96	1.97	17
中期 (3-7)	6,387	99.62	99.77	4.62	0.70	0.78	0.77	4.53	4.52	4.53	16
長期 (7-)	8,554	89.47	89.66	17.91	1.14	1.80	1.69	14.77	14.63	14.64	18
長期 (7-11)	2,302	99.57	99.75	8.68	1.06	1.11	1.11	8.28	8.24	8.28	17
超長期 (11-)	6,252	85.75	85.94	21.31	1.16	2.09	1.94	17.54	17.36	17.35	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7月末、8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	1,204	98.40	98.53	4.05	0.56	0.95	0.94	3.90	3.88	3.90	38
短期 (1-3)	499	99.34	99.40	1.80	0.35	0.69	0.69	1.79	1.78	1.79	32
中期 (3-7)	528	98.47	98.62	4.25	0.61	1.00	0.99	4.19	4.17	4.19	40
長期 (7-)	177	95.53	95.79	9.76	1.03	1.53	1.49	9.18	9.11	9.17	46
長期 (7-11)	137	97.77	98.07	8.57	1.07	1.40	1.39	8.18	8.12	8.18	46
超長期 (11-)	40	87.86	87.96	13.84	0.88	2.00	1.88	12.98	12.86	12.96	46
銀行業	1,337	100.02	100.28	3.41	1.26	1.14	1.14	3.32	3.30	3.32	63
短期 (1-3)	667	100.96	101.26	1.98	1.51	1.04	1.04	1.96	1.95	1.96	65
中期 (3-7)	652	99.17	99.38	4.74	1.01	1.25	1.24	4.61	4.58	4.61	62
長期 (7-)	18	96.09	96.24	8.59	0.83	1.34	1.31	8.29	8.23	8.28	38
長期 (7-11)	18	96.09	96.24	8.59	0.83	1.34	1.31	8.29	8.23	8.28	38
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
証券、商品先物取引業	1,006	99.10	99.30	2.45	0.87	1.20	1.19	2.41	2.40	2.41	76
短期 (1-3)	775	99.30	99.49	1.97	0.85	1.16	1.15	1.95	1.94	1.95	76
中期 (3-7)	227	98.52	98.77	3.98	0.92	1.32	1.31	3.90	3.88	3.90	74
長期 (7-)	5	93.05	93.42	8.09	0.90	1.89	1.83	7.78	7.71	7.78	95
長期 (7-11)	5	93.05	93.42	8.09	0.90	1.89	1.83	7.78	7.71	7.78	95
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
保険業	335	97.95	98.04	3.61	0.38	0.95	0.94	3.54	3.52	3.54	40
短期 (1-3)	165	98.65	98.69	2.29	0.20	0.81	0.80	2.29	2.28	2.29	37
中期 (3-7)	120	98.37	98.49	3.52	0.46	0.94	0.93	3.49	3.47	3.49	39
長期 (7-)	50	94.62	94.84	8.21	0.75	1.49	1.45	7.95	7.89	7.95	55
長期 (7-11)	50	94.62	94.84	8.21	0.75	1.49	1.45	7.95	7.89	7.95	55
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
その他金融業	6,540	98.08	98.18	3.99	0.49	0.97	0.95	3.88	3.86	3.88	40
短期 (1-3)	2,898	99.10	99.17	2.00	0.33	0.79	0.79	1.99	1.98	1.99	39
中期 (3-7)	2,877	97.93	98.05	4.65	0.55	1.00	0.99	4.58	4.56	4.58	38
長期 (7-)	766	94.74	94.92	9.06	0.86	1.52	1.47	8.61	8.54	8.60	50
長期 (7-11)	688	95.91	96.09	8.46	0.85	1.43	1.40	8.16	8.10	8.15	47
超長期 (11-)	78	84.39	84.59	14.28	0.96	2.41	2.22	13.16	13.01	13.12	78
不動産業	2,609	94.67	94.85	7.75	0.73	1.32	1.27	6.72	6.67	6.70	46
短期 (1-3)	553	99.08	99.19	2.32	0.42	0.83	0.83	2.31	2.30	2.31	40
中期 (3-7)	1,015	97.60	97.75	4.83	0.61	1.09	1.08	4.74	4.72	4.74	45
長期 (7-)	1,041	89.48	89.73	13.49	1.00	1.85	1.74	11.42	11.31	11.35	51
長期 (7-11)	568	96.69	96.91	8.68	1.01	1.44	1.41	8.30	8.24	8.29	47
超長期 (11-)	473	80.83	81.10	19.27	1.00	2.46	2.21	15.90	15.72	15.75	57
サービス業	769	90.29	90.42	5.00	0.61	2.30	2.08	4.47	4.41	4.47	148
短期 (1-3)	267	97.82	97.90	1.90	0.36	1.40	1.38	1.88	1.87	1.88	100
中期 (3-7)	292	96.09	96.20	4.72	0.47	1.33	1.29	4.65	4.62	4.65	67
長期 (7-)	210	72.67	72.86	9.34	1.14	5.60	4.75	8.55	8.35	8.54	377
長期 (7-11)	160	75.74	75.91	8.23	1.04	5.23	4.54	7.75	7.58	7.75	365
超長期 (11-)	50	62.82	63.08	12.91	1.45	7.04	5.56	11.61	11.31	11.57	423
財投機関債	20,699	95.41	95.56	9.45	0.79	1.12	1.07	7.82	7.76	7.77	17
短期 (1-3)	5,728	99.58	99.65	2.01	0.35	0.57	0.56	2.00	2.00	2.00	17
中期 (3-7)	6,324	99.63	99.79	4.65	0.71	0.78	0.78	4.56	4.54	4.56	16
長期 (7-)	8,647	89.57	89.75	17.89	1.14	1.80	1.69	14.75	14.62	14.62	18
長期 (7-11)	2,361	99.55	99.73	8.72	1.06	1.12	1.11	8.32	8.28	8.32	17
超長期 (11-)	6,286	85.82	86.00	21.33	1.17	2.09	1.94	17.56	17.38	17.37	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7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	73,045	95.62	95.78	7.32	0.74	1.21	1.17	6.25	6.20	6.22	41
短期 (1-3)	22,508	99.37	99.48	2.03	0.48	0.79	0.78	2.02	2.01	2.02	39
中期 (3-7)	26,654	98.43	98.59	4.67	0.69	1.03	1.02	4.58	4.56	4.58	40
長期 (7-)	23,882	88.95	89.17	15.26	1.04	1.89	1.77	12.77	12.65	12.68	43
長期 (7-11)	10,237	96.56	96.78	8.58	0.97	1.44	1.41	8.21	8.16	8.21	48
超長期 (11-)	13,645	83.24	83.47	20.27	1.08	2.28	2.08	16.74	16.56	16.57	38
AAA~A 格	72,008	95.58	95.75	7.36	0.74	1.21	1.17	6.29	6.24	6.26	40
短期 (1-3)	22,028	99.37	99.48	2.03	0.47	0.78	0.78	2.02	2.01	2.02	38
中期 (3-7)	26,224	98.43	98.59	4.67	0.69	1.02	1.01	4.58	4.56	4.58	40
長期 (7-)	23,756	88.92	89.15	15.28	1.03	1.89	1.76	12.78	12.66	12.69	43
長期 (7-11)	10,170	96.56	96.78	8.58	0.97	1.44	1.41	8.21	8.16	8.21	48
超長期 (11-)	13,586	83.21	83.44	20.29	1.08	2.28	2.07	16.75	16.57	16.58	38
AAA~AA 格	51,472	95.27	95.43	8.09	0.72	1.15	1.11	6.76	6.70	6.72	30
短期 (1-3)	15,126	99.47	99.56	2.01	0.42	0.68	0.68	2.00	1.99	2.00	29
中期 (3-7)	18,066	98.75	98.91	4.67	0.67	0.93	0.92	4.59	4.56	4.59	31
長期 (7-)	18,280	88.36	88.58	16.51	1.02	1.83	1.71	13.57	13.45	13.46	31
長期 (7-11)	7,015	97.30	97.51	8.56	0.92	1.28	1.26	8.22	8.17	8.21	34
超長期 (11-)	11,265	82.80	83.03	21.46	1.08	2.23	2.03	17.49	17.31	17.29	29
AAA 格	11,060	96.77	96.87	5.51	0.39	0.85	0.83	4.74	4.71	4.72	21
短期 (1-3)	4,350	99.17	99.22	1.93	0.16	0.59	0.58	1.93	1.92	1.93	20
中期 (3-7)	4,842	98.18	98.30	4.57	0.43	0.82	0.81	4.52	4.50	4.52	20
長期 (7-)	1,869	87.51	87.69	16.24	0.84	1.68	1.54	12.77	12.65	12.63	25
長期 (7-11)	1,067	96.37	96.51	8.41	0.71	1.19	1.17	8.15	8.10	8.15	26
超長期 (11-)	802	75.73	75.96	26.67	1.02	2.49	2.16	20.58	20.35	20.22	25
AA 格	40,411	94.86	95.04	8.80	0.81	1.23	1.18	7.32	7.26	7.28	33
短期 (1-3)	10,776	99.59	99.70	2.04	0.53	0.72	0.72	2.03	2.02	2.03	32
中期 (3-7)	13,225	98.96	99.13	4.71	0.76	0.97	0.96	4.61	4.59	4.61	35
長期 (7-)	16,411	88.46	88.69	16.54	1.04	1.85	1.73	13.67	13.54	13.55	31
長期 (7-11)	5,948	97.46	97.69	8.59	0.96	1.30	1.28	8.23	8.18	8.23	35
超長期 (11-)	10,463	83.34	83.57	21.06	1.08	2.22	2.02	17.28	17.10	17.09	29
A 格	20,536	96.36	96.53	5.52	0.78	1.36	1.32	5.12	5.08	5.11	65
短期 (1-3)	6,903	99.16	99.29	2.07	0.59	0.99	0.98	2.06	2.05	2.06	58
中期 (3-7)	8,157	97.71	97.88	4.66	0.73	1.23	1.22	4.57	4.54	4.57	60
長期 (7-)	5,476	90.80	91.04	11.16	1.09	2.07	1.95	10.22	10.11	10.20	81
長期 (7-11)	3,155	94.91	95.15	8.62	1.09	1.80	1.74	8.21	8.14	8.20	80
超長期 (11-)	2,322	85.21	85.46	14.61	1.10	2.47	2.28	13.26	13.11	13.21	83
BBB 格	1,037	98.19	98.37	4.35	0.93	1.33	1.32	4.08	4.05	4.08	74
短期 (1-3)	480	99.33	99.48	1.99	0.73	1.09	1.09	1.98	1.97	1.98	70
中期 (3-7)	431	98.30	98.49	4.75	0.99	1.37	1.36	4.63	4.60	4.63	74
長期 (7-)	126	93.52	93.76	11.94	1.47	2.16	2.09	10.63	10.52	10.59	88
長期 (7-11)	67	96.99	97.25	8.67	1.37	1.81	1.79	8.15	8.08	8.14	85
超長期 (11-)	59	89.57	89.79	15.67	1.58	2.59	2.46	13.69	13.52	13.61	93

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7月末、8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	73,689	95.65	95.82	7.33	0.74	1.21	1.17	6.27	6.22	6.24	41
短期 (1-3)	22,789	99.37	99.47	2.06	0.48	0.79	0.79	2.05	2.04	2.05	39
中期 (3-7)	26,893	98.42	98.58	4.70	0.70	1.03	1.02	4.62	4.59	4.61	40
長期 (7-)	24,008	89.03	89.26	15.27	1.04	1.89	1.77	12.78	12.66	12.69	43
長期 (7-11)	10,339	96.64	96.87	8.63	0.99	1.44	1.41	8.26	8.20	8.25	47
超長期 (11-)	13,669	83.27	83.50	20.29	1.09	2.28	2.08	16.75	16.57	16.58	38
AAA~A 格	72,659	95.62	95.78	7.37	0.74	1.21	1.17	6.30	6.25	6.27	40
短期 (1-3)	22,306	99.37	99.47	2.06	0.48	0.78	0.78	2.05	2.04	2.05	38
中期 (3-7)	26,472	98.42	98.58	4.70	0.69	1.03	1.02	4.61	4.59	4.61	40
長期 (7-)	23,882	89.01	89.23	15.29	1.04	1.88	1.76	12.79	12.67	12.70	42
長期 (7-11)	10,272	96.64	96.86	8.63	0.98	1.44	1.41	8.26	8.20	8.25	47
超長期 (11-)	13,610	83.24	83.47	20.31	1.08	2.28	2.08	16.77	16.59	16.59	38
AAA~AA 格	52,129	95.32	95.48	8.09	0.72	1.15	1.11	6.76	6.71	6.72	30
短期 (1-3)	15,362	99.46	99.55	2.04	0.42	0.69	0.69	2.03	2.02	2.03	29
中期 (3-7)	18,255	98.76	98.92	4.69	0.67	0.93	0.93	4.61	4.59	4.61	31
長期 (7-)	18,513	88.49	88.71	16.46	1.02	1.83	1.70	13.54	13.41	13.43	31
長期 (7-11)	7,194	97.36	97.58	8.60	0.93	1.28	1.27	8.25	8.20	8.24	34
超長期 (11-)	11,319	82.85	83.08	21.45	1.08	2.23	2.03	17.49	17.31	17.29	29
AAA 格	11,432	96.87	96.97	5.51	0.41	0.86	0.84	4.76	4.73	4.74	21
短期 (1-3)	4,517	99.17	99.21	1.97	0.17	0.59	0.59	1.97	1.96	1.97	20
中期 (3-7)	4,947	98.23	98.36	4.61	0.45	0.82	0.82	4.55	4.53	4.55	20
長期 (7-)	1,969	88.17	88.35	15.91	0.87	1.66	1.53	12.55	12.44	12.42	26
長期 (7-11)	1,167	96.72	96.87	8.51	0.77	1.21	1.20	8.23	8.18	8.22	27
超長期 (11-)	802	75.73	75.96	26.67	1.02	2.49	2.16	20.58	20.35	20.22	25
AA 格	40,697	94.88	95.06	8.81	0.81	1.24	1.19	7.34	7.28	7.29	33
短期 (1-3)	10,845	99.58	99.69	2.07	0.53	0.73	0.73	2.05	2.05	2.05	33
中期 (3-7)	13,308	98.96	99.13	4.72	0.76	0.97	0.97	4.63	4.61	4.63	35
長期 (7-)	16,544	88.53	88.76	16.52	1.04	1.85	1.73	13.66	13.53	13.54	31
長期 (7-11)	6,027	97.49	97.72	8.62	0.96	1.30	1.28	8.25	8.20	8.25	35
超長期 (11-)	10,517	83.39	83.62	21.05	1.09	2.22	2.02	17.28	17.10	17.09	29
A 格	20,530	96.37	96.55	5.54	0.78	1.36	1.32	5.14	5.10	5.13	65
短期 (1-3)	6,944	99.16	99.29	2.11	0.60	0.99	0.99	2.09	2.08	2.09	58
中期 (3-7)	8,217	97.67	97.84	4.72	0.73	1.24	1.22	4.63	4.60	4.63	60
長期 (7-)	5,369	90.78	91.02	11.24	1.10	2.07	1.96	10.28	10.18	10.26	81
長期 (7-11)	3,077	94.95	95.19	8.71	1.11	1.80	1.74	8.28	8.20	8.27	80
超長期 (11-)	2,292	85.18	85.43	14.64	1.10	2.48	2.28	13.28	13.13	13.23	83
BBB 格	1,030	98.20	98.37	4.36	0.93	1.33	1.32	4.09	4.06	4.08	73
短期 (1-3)	483	99.33	99.48	2.00	0.74	1.10	1.09	1.98	1.97	1.98	70
中期 (3-7)	421	98.29	98.48	4.79	0.99	1.36	1.35	4.67	4.64	4.67	73
長期 (7-)	126	93.52	93.76	11.94	1.47	2.16	2.09	10.63	10.52	10.59	88
長期 (7-11)	67	96.99	97.25	8.67	1.37	1.81	1.79	8.15	8.08	8.14	85
超長期 (11-)	59	89.57	89.79	15.67	1.58	2.59	2.46	13.69	13.52	13.61	93

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7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	50,117	95.17	95.33	8.22	0.72	1.15	1.11	6.86	6.80	6.82	29
短期(1-3)	14,443	99.47	99.56	2.01	0.41	0.67	0.67	2.00	1.99	2.00	28
中期(3-7)	17,465	98.74	98.90	4.69	0.66	0.92	0.91	4.61	4.58	4.61	30
長期(7-)	18,209	88.33	88.55	16.54	1.02	1.83	1.71	13.60	13.47	13.48	31
長期(7-11)	6,948	97.30	97.51	8.56	0.92	1.28	1.26	8.22	8.17	8.22	33
超長期(11-)	11,260	82.79	83.02	21.46	1.08	2.23	2.03	17.50	17.31	17.30	29
AAA~A格	68,929	95.44	95.60	7.53	0.72	1.20	1.16	6.41	6.36	6.38	38
短期(1-3)	20,424	99.37	99.46	2.02	0.44	0.75	0.75	2.01	2.00	2.01	35
中期(3-7)	25,026	98.43	98.59	4.69	0.67	1.00	1.00	4.61	4.58	4.61	38
長期(7-)	23,480	88.83	89.05	15.33	1.02	1.88	1.76	12.83	12.70	12.73	42
長期(7-11)	10,019	96.56	96.78	8.58	0.97	1.43	1.40	8.22	8.16	8.21	47
超長期(11-)	13,460	83.08	83.30	20.35	1.07	2.27	2.07	16.81	16.63	16.64	37
AAA~BBB格	69,496	95.45	95.62	7.49	0.72	1.20	1.16	6.39	6.34	6.36	39
短期(1-3)	20,725	99.36	99.46	2.02	0.44	0.75	0.75	2.01	2.00	2.01	36
中期(3-7)	25,246	98.42	98.58	4.69	0.67	1.01	1.00	4.61	4.58	4.61	38
長期(7-)	23,525	88.83	89.05	15.32	1.02	1.88	1.76	12.82	12.70	12.72	42
長期(7-11)	10,044	96.55	96.77	8.58	0.97	1.43	1.40	8.22	8.16	8.21	47
超長期(11-)	13,480	83.08	83.30	20.34	1.07	2.27	2.07	16.80	16.63	16.63	37
AAA~BB格	69,496	95.45	95.62	7.49	0.72	1.20	1.16	6.39	6.34	6.36	39
短期(1-3)	20,725	99.36	99.46	2.02	0.44	0.75	0.75	2.01	2.00	2.01	36
中期(3-7)	25,246	98.42	98.58	4.69	0.67	1.01	1.00	4.61	4.58	4.61	38
長期(7-)	23,525	88.83	89.05	15.32	1.02	1.88	1.76	12.82	12.70	12.72	42
長期(7-11)	10,044	96.55	96.77	8.58	0.97	1.43	1.40	8.22	8.16	8.21	47
超長期(11-)	13,480	83.08	83.30	20.34	1.07	2.27	2.07	16.80	16.63	16.63	37
AAA格	11,060	96.77	96.87	5.51	0.39	0.85	0.83	4.74	4.71	4.72	21
短期(1-3)	4,350	99.17	99.22	1.93	0.16	0.59	0.58	1.93	1.92	1.93	20
中期(3-7)	4,842	98.18	98.30	4.57	0.43	0.82	0.81	4.52	4.50	4.52	20
長期(7-)	1,869	87.51	87.69	16.24	0.84	1.68	1.54	12.77	12.65	12.63	25
長期(7-11)	1,067	96.37	96.51	8.41	0.71	1.19	1.17	8.15	8.10	8.15	26
超長期(11-)	802	75.73	75.96	26.67	1.02	2.49	2.16	20.58	20.35	20.22	25
AA格	39,056	94.71	94.89	8.99	0.81	1.24	1.19	7.47	7.41	7.42	32
短期(1-3)	10,093	99.60	99.71	2.04	0.51	0.71	0.71	2.03	2.02	2.03	31
中期(3-7)	12,623	98.96	99.13	4.73	0.75	0.96	0.95	4.64	4.62	4.64	33
長期(7-)	16,340	88.42	88.65	16.57	1.04	1.85	1.73	13.69	13.56	13.58	31
長期(7-11)	5,881	97.46	97.69	8.59	0.95	1.29	1.28	8.23	8.18	8.23	35
超長期(11-)	10,458	83.33	83.56	21.06	1.08	2.22	2.02	17.28	17.10	17.09	29
A格	18,813	96.15	96.32	5.67	0.74	1.34	1.30	5.25	5.21	5.24	62
短期(1-3)	5,981	99.12	99.23	2.05	0.51	0.93	0.93	2.03	2.02	2.03	53
中期(3-7)	7,561	97.70	97.87	4.70	0.71	1.20	1.19	4.61	4.58	4.61	57
長期(7-)	5,271	90.57	90.80	11.15	1.05	2.05	1.93	10.22	10.12	10.20	79
長期(7-11)	3,071	94.89	95.13	8.63	1.08	1.79	1.73	8.21	8.14	8.21	79
超長期(11-)	2,200	84.53	84.75	14.67	1.02	2.46	2.25	13.37	13.22	13.33	79
BBB格	566	97.59	97.75	3.56	0.69	1.27	1.25	3.40	3.38	3.40	74
短期(1-3)	302	99.08	99.23	1.87	0.62	1.11	1.11	1.86	1.85	1.86	73
中期(3-7)	220	97.32	97.49	4.43	0.75	1.36	1.34	4.34	4.31	4.34	74
長期(7-)	45	88.94	89.04	10.69	0.83	2.01	1.89	9.88	9.78	9.87	80
長期(7-11)	25	94.21	94.39	7.45	0.74	1.61	1.57	7.24	7.18	7.24	75
超長期(11-)	20	82.35	82.35	14.74	0.93	2.58	2.35	13.67	13.51	13.63	87
BB格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
B格以下	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
格付なし	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

出所:NFRC

- 格付は、格付会社4社の最高格付をもとにNFRCで分類

事業債 最高格付別・ポートフォリオ指標 (2024年7月末、8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	50,673	95.21	95.37	8.23	0.72	1.15	1.11	6.87	6.82	6.83	29
短期 (1-3)	14,589	99.46	99.55	2.04	0.41	0.67	0.67	2.03	2.02	2.03	28
中期 (3-7)	17,642	98.75	98.91	4.71	0.67	0.92	0.92	4.63	4.61	4.63	30
長期 (7-)	18,442	88.46	88.68	16.49	1.02	1.83	1.71	13.56	13.43	13.45	31
長期 (7-11)	7,127	97.36	97.58	8.60	0.93	1.28	1.27	8.25	8.20	8.25	33
超長期 (11-)	11,314	82.85	83.07	21.46	1.08	2.23	2.03	17.49	17.31	17.29	29
AAA~A 格	69,480	95.47	95.63	7.54	0.73	1.21	1.16	6.43	6.38	6.40	38
短期 (1-3)	20,611	99.36	99.45	2.05	0.44	0.75	0.75	2.04	2.03	2.04	35
中期 (3-7)	25,263	98.42	98.58	4.73	0.68	1.01	1.00	4.64	4.62	4.64	38
長期 (7-)	23,605	88.91	89.14	15.34	1.03	1.88	1.76	12.83	12.71	12.74	41
長期 (7-11)	10,121	96.65	96.87	8.63	0.98	1.43	1.40	8.26	8.20	8.26	47
超長期 (11-)	13,484	83.11	83.34	20.37	1.07	2.27	2.07	16.82	16.64	16.65	37
AAA~BBB 格	70,039	95.49	95.65	7.51	0.73	1.21	1.16	6.41	6.36	6.38	39
短期 (1-3)	20,916	99.35	99.45	2.05	0.44	0.76	0.76	2.04	2.03	2.04	36
中期 (3-7)	25,473	98.41	98.57	4.73	0.68	1.01	1.00	4.64	4.62	4.64	38
長期 (7-)	23,650	88.91	89.14	15.33	1.03	1.88	1.76	12.83	12.71	12.73	42
長期 (7-11)	10,146	96.64	96.86	8.63	0.98	1.43	1.40	8.26	8.20	8.25	47
超長期 (11-)	13,504	83.11	83.34	20.36	1.07	2.27	2.07	16.82	16.64	16.65	37
AAA~BB 格	70,039	95.49	95.65	7.51	0.73	1.21	1.16	6.41	6.36	6.38	39
短期 (1-3)	20,916	99.35	99.45	2.05	0.44	0.76	0.76	2.04	2.03	2.04	36
中期 (3-7)	25,473	98.41	98.57	4.73	0.68	1.01	1.00	4.64	4.62	4.64	38
長期 (7-)	23,650	88.91	89.14	15.33	1.03	1.88	1.76	12.83	12.71	12.73	42
長期 (7-11)	10,146	96.64	96.86	8.63	0.98	1.43	1.40	8.26	8.20	8.25	47
超長期 (11-)	13,504	83.11	83.34	20.36	1.07	2.27	2.07	16.82	16.64	16.65	37
AAA 格	11,432	96.87	96.97	5.51	0.41	0.86	0.84	4.76	4.73	4.74	21
短期 (1-3)	4,517	99.17	99.21	1.97	0.17	0.59	0.59	1.97	1.96	1.97	20
中期 (3-7)	4,947	98.23	98.36	4.61	0.45	0.82	0.82	4.55	4.53	4.55	20
長期 (7-)	1,969	88.17	88.35	15.91	0.87	1.66	1.53	12.55	12.44	12.42	26
長期 (7-11)	1,167	96.72	96.87	8.51	0.77	1.21	1.20	8.23	8.18	8.22	27
超長期 (11-)	802	75.73	75.96	26.67	1.02	2.49	2.16	20.58	20.35	20.22	25
AA 格	39,240	94.72	94.90	9.02	0.81	1.24	1.19	7.50	7.44	7.45	32
短期 (1-3)	10,072	99.59	99.70	2.06	0.51	0.71	0.71	2.05	2.04	2.05	31
中期 (3-7)	12,695	98.96	99.12	4.75	0.75	0.96	0.96	4.66	4.64	4.66	33
長期 (7-)	16,473	88.49	88.72	16.56	1.04	1.85	1.73	13.68	13.55	13.57	31
長期 (7-11)	5,960	97.49	97.72	8.62	0.96	1.29	1.28	8.26	8.20	8.25	34
超長期 (11-)	10,512	83.39	83.62	21.06	1.09	2.22	2.02	17.28	17.10	17.09	29
A 格	18,807	96.17	96.34	5.69	0.75	1.34	1.30	5.27	5.23	5.27	62
短期 (1-3)	6,023	99.11	99.23	2.09	0.52	0.94	0.94	2.08	2.07	2.08	53
中期 (3-7)	7,621	97.65	97.82	4.77	0.71	1.21	1.20	4.68	4.65	4.68	57
長期 (7-)	5,164	90.55	90.78	11.23	1.06	2.06	1.94	10.29	10.19	10.27	79
長期 (7-11)	2,994	94.94	95.17	8.71	1.10	1.79	1.73	8.28	8.21	8.28	79
超長期 (11-)	2,170	84.48	84.71	14.70	1.02	2.46	2.26	13.39	13.25	13.35	80
BBB 格	559	97.59	97.74	3.57	0.69	1.27	1.25	3.40	3.38	3.40	74
短期 (1-3)	305	99.09	99.24	1.88	0.63	1.12	1.11	1.87	1.86	1.87	74
中期 (3-7)	210	97.26	97.43	4.49	0.74	1.35	1.33	4.40	4.37	4.40	73
長期 (7-)	45	88.94	89.04	10.69	0.83	2.01	1.89	9.88	9.78	9.87	80
長期 (7-11)	25	94.21	94.39	7.45	0.74	1.61	1.57	7.24	7.18	7.24	75
超長期 (11-)	20	82.35	82.35	14.74	0.93	2.58	2.35	13.67	13.51	13.63	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7月末)

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
AAA~AA格	10,944	95.14	95.29	7.19	0.62	1.11	1.06	5.90	5.86	5.87	34
短期(1-3)	3,489	99.43	99.53	1.98	0.42	0.70	0.70	1.97	1.96	1.97	31
中期(3-7)	4,445	98.33	98.47	4.53	0.59	0.97	0.96	4.45	4.43	4.45	36
長期(7-)	3,010	85.46	85.68	17.18	0.89	1.89	1.73	13.65	13.52	13.51	34
長期(7-11)	1,255	96.47	96.66	8.60	0.83	1.31	1.29	8.28	8.23	8.28	35
超長期(11-)	1,755	77.59	77.82	23.32	0.93	2.40	2.12	18.43	18.22	18.16	33
AAA~A格	66,508	95.41	95.58	7.56	0.72	1.20	1.16	6.44	6.39	6.41	38
短期(1-3)	19,824	99.38	99.48	2.02	0.44	0.74	0.74	2.01	2.00	2.01	34
中期(3-7)	23,858	98.41	98.57	4.70	0.66	0.99	0.99	4.61	4.59	4.61	37
長期(7-)	22,826	88.84	89.06	15.37	1.03	1.88	1.76	12.85	12.72	12.75	41
長期(7-11)	9,707	96.59	96.81	8.58	0.97	1.43	1.40	8.22	8.16	8.21	47
超長期(11-)	13,119	83.10	83.33	20.40	1.07	2.26	2.06	16.83	16.65	16.65	37
AAA~BBB格	69,256	95.44	95.60	7.50	0.72	1.20	1.16	6.39	6.34	6.36	38
短期(1-3)	20,725	99.36	99.46	2.02	0.44	0.75	0.75	2.01	2.00	2.01	36
中期(3-7)	25,031	98.39	98.55	4.69	0.66	1.00	0.99	4.61	4.58	4.61	37
長期(7-)	23,500	88.83	89.05	15.32	1.02	1.88	1.76	12.82	12.70	12.72	42
長期(7-11)	10,044	96.55	96.77	8.58	0.97	1.43	1.40	8.22	8.16	8.21	47
超長期(11-)	13,455	83.06	83.29	20.35	1.07	2.27	2.07	16.81	16.63	16.64	37
AAA~BB格	69,496	95.45	95.62	7.49	0.72	1.20	1.16	6.39	6.34	6.36	39
短期(1-3)	20,725	99.36	99.46	2.02	0.44	0.75	0.75	2.01	2.00	2.01	36
中期(3-7)	25,246	98.42	98.58	4.69	0.67	1.01	1.00	4.61	4.58	4.61	38
長期(7-)	23,525	88.83	89.05	15.32	1.02	1.88	1.76	12.82	12.70	12.72	42
長期(7-11)	10,044	96.55	96.77	8.58	0.97	1.43	1.40	8.22	8.16	8.21	47
超長期(11-)	13,480	83.08	83.30	20.34	1.07	2.27	2.07	16.80	16.63	16.63	37
AAA格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA格	10,944	95.14	95.29	7.19	0.62	1.11	1.06	5.90	5.86	5.87	34
短期(1-3)	3,489	99.43	99.53	1.98	0.42	0.70	0.70	1.97	1.96	1.97	31
中期(3-7)	4,445	98.33	98.47	4.53	0.59	0.97	0.96	4.45	4.43	4.45	36
長期(7-)	3,010	85.46	85.68	17.18	0.89	1.89	1.73	13.65	13.52	13.51	34
長期(7-11)	1,255	96.47	96.66	8.60	0.83	1.31	1.29	8.28	8.23	8.28	35
超長期(11-)	1,755	77.59	77.82	23.32	0.93	2.40	2.12	18.43	18.22	18.16	33
A格	55,564	95.47	95.63	7.64	0.74	1.22	1.17	6.54	6.49	6.51	38
短期(1-3)	16,336	99.37	99.47	2.03	0.44	0.75	0.75	2.02	2.01	2.02	35
中期(3-7)	19,413	98.43	98.59	4.74	0.68	1.00	0.99	4.65	4.62	4.65	37
長期(7-)	19,816	89.35	89.58	15.10	1.05	1.88	1.76	12.73	12.61	12.64	42
長期(7-11)	8,452	96.61	96.84	8.58	0.99	1.45	1.42	8.21	8.15	8.20	49
超長期(11-)	11,364	83.96	84.18	19.95	1.09	2.25	2.05	16.60	16.42	16.43	37
BBB格	2,748	95.98	96.13	5.94	0.68	1.27	1.23	5.34	5.30	5.33	54
短期(1-3)	901	98.94	99.07	2.00	0.49	1.00	1.00	1.99	1.98	1.99	60
中期(3-7)	1,173	98.07	98.22	4.61	0.68	1.12	1.11	4.53	4.50	4.53	50
長期(7-)	674	88.38	88.58	13.55	0.93	1.95	1.82	11.92	11.81	11.87	54
長期(7-11)	338	95.44	95.65	8.55	0.90	1.53	1.49	8.21	8.15	8.21	56
超長期(11-)	336	81.29	81.48	18.58	0.96	2.44	2.21	16.29	16.11	16.18	52
BB格	240	100.33	100.90	5.83	2.26	2.04	2.04	5.26	5.20	5.25	134
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	215	101.28	101.87	4.66	2.25	1.93	1.94	4.43	4.38	4.42	133
長期(7-)	25	92.16	92.57	15.82	2.37	3.11	2.99	13.10	12.91	13.02	146
長期(7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期(11-)	25	92.16	92.57	15.82	2.37	3.11	2.99	13.10	12.91	13.02	146
B格以下	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
格付なし	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

出所:NFRC

- 格付は、格付会社4社の最低格付をもとにNFRCで分類

事業債 最低格付別・ポートフォリオ指標 (2024年7月末、8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	11,080	95.16	95.31	7.19	0.62	1.11	1.07	5.91	5.87	5.88	34
短期(1-3)	3,535	99.43	99.53	1.99	0.43	0.70	0.70	1.98	1.97	1.98	31
中期(3-7)	4,497	98.30	98.44	4.54	0.59	0.97	0.97	4.47	4.45	4.47	36
長期(7-)	3,048	85.56	85.78	17.14	0.89	1.89	1.73	13.64	13.51	13.50	34
長期(7-11)	1,266	96.52	96.71	8.63	0.84	1.31	1.29	8.31	8.26	8.31	35
超長期(11-)	1,782	77.78	78.01	23.18	0.93	2.39	2.12	18.34	18.14	18.07	33
AAA~A格	67,078	95.45	95.61	7.58	0.72	1.20	1.16	6.46	6.41	6.42	37
短期(1-3)	20,022	99.37	99.47	2.05	0.44	0.75	0.74	2.04	2.03	2.04	35
中期(3-7)	24,104	98.40	98.56	4.73	0.67	1.00	0.99	4.65	4.62	4.65	37
長期(7-)	22,952	88.93	89.15	15.38	1.03	1.88	1.75	12.85	12.73	12.76	41
長期(7-11)	9,809	96.68	96.90	8.63	0.98	1.43	1.40	8.26	8.20	8.26	46
超長期(11-)	13,143	83.14	83.37	20.41	1.07	2.27	2.06	16.84	16.66	16.66	37
AAA~BBB格	69,799	95.47	95.63	7.51	0.72	1.20	1.16	6.41	6.36	6.38	38
短期(1-3)	20,916	99.35	99.45	2.05	0.44	0.76	0.76	2.04	2.03	2.04	36
中期(3-7)	25,258	98.39	98.54	4.73	0.67	1.00	0.99	4.64	4.62	4.64	37
長期(7-)	23,625	88.91	89.13	15.33	1.03	1.88	1.76	12.83	12.71	12.73	41
長期(7-11)	10,146	96.64	96.86	8.63	0.98	1.43	1.40	8.26	8.20	8.25	47
超長期(11-)	13,479	83.09	83.32	20.37	1.07	2.27	2.07	16.83	16.65	16.65	37
AAA~BB格	70,039	95.49	95.65	7.51	0.73	1.21	1.16	6.41	6.36	6.38	39
短期(1-3)	20,916	99.35	99.45	2.05	0.44	0.76	0.76	2.04	2.03	2.04	36
中期(3-7)	25,473	98.41	98.57	4.73	0.68	1.01	1.00	4.64	4.62	4.64	38
長期(7-)	23,650	88.91	89.14	15.33	1.03	1.88	1.76	12.83	12.71	12.73	42
長期(7-11)	10,146	96.64	96.86	8.63	0.98	1.43	1.40	8.26	8.20	8.25	47
超長期(11-)	13,504	83.11	83.34	20.36	1.07	2.27	2.07	16.82	16.64	16.65	37
AAA格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA格	11,080	95.16	95.31	7.19	0.62	1.11	1.07	5.91	5.87	5.88	34
短期(1-3)	3,535	99.43	99.53	1.99	0.43	0.70	0.70	1.98	1.97	1.98	31
中期(3-7)	4,497	98.30	98.44	4.54	0.59	0.97	0.97	4.47	4.45	4.47	36
長期(7-)	3,048	85.56	85.78	17.14	0.89	1.89	1.73	13.64	13.51	13.50	34
長期(7-11)	1,266	96.52	96.71	8.63	0.84	1.31	1.29	8.31	8.26	8.31	35
超長期(11-)	1,782	77.78	78.01	23.18	0.93	2.39	2.12	18.34	18.14	18.07	33
A格	55,998	95.51	95.67	7.65	0.74	1.22	1.18	6.56	6.51	6.53	38
短期(1-3)	16,487	99.36	99.46	2.06	0.44	0.76	0.75	2.05	2.04	2.05	35
中期(3-7)	19,607	98.43	98.59	4.78	0.68	1.00	0.99	4.69	4.66	4.69	37
長期(7-)	19,903	89.44	89.67	15.11	1.05	1.87	1.76	12.74	12.62	12.65	42
長期(7-11)	8,542	96.71	96.93	8.64	1.00	1.45	1.42	8.25	8.19	8.25	48
超長期(11-)	11,361	83.98	84.21	19.98	1.09	2.25	2.06	16.62	16.45	16.46	37
BBB格	2,721	95.94	96.10	5.99	0.68	1.27	1.24	5.38	5.34	5.37	54
短期(1-3)	894	98.91	99.04	2.03	0.50	1.02	1.01	2.02	2.01	2.02	61
中期(3-7)	1,153	98.06	98.22	4.63	0.68	1.12	1.10	4.55	4.53	4.55	49
長期(7-)	674	88.38	88.58	13.55	0.93	1.95	1.82	11.92	11.81	11.87	54
長期(7-11)	338	95.44	95.65	8.55	0.90	1.53	1.49	8.21	8.15	8.21	56
超長期(11-)	336	81.29	81.48	18.58	0.96	2.44	2.21	16.29	16.11	16.18	52
BB格	240	100.33	100.90	5.83	2.26	2.04	2.04	5.26	5.20	5.25	134
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	215	101.28	101.87	4.66	2.25	1.93	1.94	4.43	4.38	4.42	133
長期(7-)	25	92.16	92.57	15.82	2.37	3.11	2.99	13.10	12.91	13.02	146
長期(7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期(11-)	25	92.16	92.57	15.82	2.37	3.11	2.99	13.10	12.91	13.02	146
B格以下	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
格付なし	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

出所:NFRC

- 格付は、格付会社4社の最低格付をもとにNFRCで分類

事業債 R&I 格付別・ポートフォリオ指標 (2024年7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	38,076	95.02	95.19	8.88	0.76	1.15	1.10	7.25	7.19	7.20	25
短期 (1-3)	10,689	99.55	99.64	2.01	0.41	0.64	0.63	2.00	1.99	2.00	24
中期 (3-7)	12,773	99.22	99.40	4.66	0.71	0.87	0.87	4.57	4.55	4.57	26
長期 (7-)	14,614	88.04	88.27	17.59	1.07	1.84	1.71	14.23	14.09	14.09	26
長期 (7-11)	5,038	98.15	98.38	8.70	0.99	1.23	1.22	8.32	8.27	8.32	28
超長期 (11-)	9,575	82.71	82.95	22.26	1.11	2.23	2.02	17.91	17.72	17.69	25
AAA~A 格	62,890	95.36	95.53	7.75	0.73	1.19	1.15	6.57	6.52	6.53	36
短期 (1-3)	18,501	99.39	99.48	2.03	0.42	0.72	0.72	2.02	2.01	2.02	32
中期 (3-7)	22,297	98.56	98.72	4.70	0.68	0.98	0.98	4.61	4.59	4.61	36
長期 (7-)	22,093	88.77	88.99	15.63	1.03	1.86	1.74	13.02	12.89	12.92	39
長期 (7-11)	9,143	96.82	97.05	8.61	0.95	1.38	1.36	8.24	8.19	8.24	42
超長期 (11-)	12,950	83.08	83.31	20.58	1.08	2.26	2.06	16.94	16.76	16.76	36
AAA~BBB 格	63,458	95.38	95.54	7.72	0.73	1.19	1.15	6.54	6.49	6.51	36
短期 (1-3)	18,762	99.38	99.48	2.03	0.43	0.73	0.73	2.02	2.01	2.02	33
中期 (3-7)	22,548	98.54	98.70	4.70	0.68	0.99	0.98	4.61	4.58	4.61	36
長期 (7-)	22,149	88.76	88.99	15.61	1.03	1.87	1.75	13.01	12.88	12.91	39
長期 (7-11)	9,179	96.79	97.02	8.60	0.95	1.38	1.36	8.24	8.18	8.23	43
超長期 (11-)	12,970	83.08	83.31	20.58	1.08	2.26	2.06	16.94	16.76	16.76	36
AAA~BB 格	63,458	95.38	95.54	7.72	0.73	1.19	1.15	6.54	6.49	6.51	36
短期 (1-3)	18,762	99.38	99.48	2.03	0.43	0.73	0.73	2.02	2.01	2.02	33
中期 (3-7)	22,548	98.54	98.70	4.70	0.68	0.99	0.98	4.61	4.58	4.61	36
長期 (7-)	22,149	88.76	88.99	15.61	1.03	1.87	1.75	13.01	12.88	12.91	39
長期 (7-11)	9,179	96.79	97.02	8.60	0.95	1.38	1.36	8.24	8.18	8.23	43
超長期 (11-)	12,970	83.08	83.31	20.58	1.08	2.26	2.06	16.94	16.76	16.76	36
AAA 格	955	97.95	98.03	3.78	0.31	0.81	0.80	3.69	3.67	3.68	26
短期 (1-3)	505	99.03	99.07	2.10	0.19	0.66	0.66	2.09	2.09	2.09	25
中期 (3-7)	350	97.84	97.96	4.54	0.41	0.88	0.87	4.48	4.46	4.48	26
長期 (7-)	100	92.88	92.97	9.64	0.57	1.37	1.32	9.31	9.25	9.30	29
長期 (7-11)	70	95.30	95.40	8.55	0.62	1.23	1.20	8.32	8.27	8.32	27
超長期 (11-)	30	87.22	87.30	12.17	0.45	1.72	1.61	11.82	11.73	11.81	32
AA 格	37,121	94.95	95.12	9.01	0.78	1.16	1.11	7.35	7.29	7.30	25
短期 (1-3)	10,184	99.58	99.67	2.00	0.42	0.63	0.63	1.99	1.99	1.99	24
中期 (3-7)	12,423	99.26	99.44	4.66	0.72	0.87	0.87	4.58	4.56	4.58	26
長期 (7-)	14,514	88.00	88.24	17.64	1.07	1.85	1.72	14.26	14.13	14.12	26
長期 (7-11)	4,968	98.19	98.42	8.70	1.00	1.23	1.22	8.32	8.27	8.32	28
超長期 (11-)	9,545	82.70	82.94	22.29	1.11	2.23	2.02	17.93	17.74	17.71	25
A 格	24,815	95.89	96.04	6.03	0.67	1.25	1.22	5.53	5.48	5.52	51
短期 (1-3)	7,812	99.18	99.27	2.06	0.44	0.84	0.83	2.05	2.04	2.05	43
中期 (3-7)	9,524	97.66	97.81	4.75	0.64	1.13	1.12	4.66	4.63	4.66	50
長期 (7-)	7,479	90.19	90.41	11.80	0.94	1.90	1.80	10.70	10.60	10.68	63
長期 (7-11)	4,104	95.19	95.41	8.49	0.91	1.57	1.53	8.14	8.08	8.14	61
超長期 (11-)	3,375	84.11	84.33	15.83	0.98	2.36	2.17	14.23	14.07	14.17	64
BBB 格	568	96.81	96.97	3.84	0.76	1.50	1.47	3.65	3.62	3.65	93
短期 (1-3)	261	98.71	98.87	1.92	0.69	1.33	1.32	1.91	1.89	1.91	94
中期 (3-7)	251	97.12	97.30	4.44	0.80	1.46	1.44	4.35	4.32	4.35	84
長期 (7-)	56	86.58	86.69	10.04	0.87	2.61	2.40	9.39	9.28	9.37	136
長期 (7-11)	36	88.93	89.09	7.43	0.84	2.63	2.43	7.19	7.10	7.19	161
超長期 (11-)	20	82.35	82.35	14.74	0.93	2.58	2.35	13.67	13.51	13.63	87
BB 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
B 格以下	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
格付なし	6,037	96.27	96.42	5.13	0.68	1.32	1.27	4.81	4.78	4.81	63
短期 (1-3)	1,964	99.15	99.30	1.94	0.58	1.00	0.99	1.92	1.91	1.92	61
中期 (3-7)	2,698	97.40	97.54	4.66	0.59	1.16	1.15	4.58	4.56	4.58	53
長期 (7-)	1,376	89.93	90.12	10.61	1.00	2.14	1.98	9.85	9.75	9.83	89
長期 (7-11)	866	94.00	94.21	8.36	1.10	1.98	1.86	7.97	7.90	7.97	96
超長期 (11-)	510	83.02	83.18	14.42	0.85	2.46	2.20	13.44	13.30	13.41	75

出所:NFRC

- 格付は、R&Iの格付をもとに NFRC で分類

事業債 R&I 格付別・ポートフォリオ指標 (2024年7月末、8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	38,507	95.07	95.25	8.88	0.77	1.15	1.10	7.26	7.21	7.22	25
短期 (1-3)	10,785	99.54	99.63	2.03	0.41	0.64	0.64	2.02	2.02	2.02	24
中期 (3-7)	12,915	99.24	99.41	4.68	0.72	0.88	0.87	4.60	4.58	4.60	26
長期 (7-)	14,807	88.19	88.42	17.52	1.08	1.84	1.71	14.18	14.05	14.05	26
長期 (7-11)	5,197	98.21	98.44	8.74	1.00	1.23	1.22	8.35	8.30	8.35	28
超長期 (11-)	9,609	82.77	83.00	22.27	1.11	2.23	2.02	17.92	17.73	17.70	25
AAA~A 格	63,424	95.40	95.56	7.77	0.73	1.19	1.15	6.59	6.54	6.55	36
短期 (1-3)	18,697	99.38	99.48	2.06	0.42	0.72	0.72	2.05	2.04	2.05	32
中期 (3-7)	22,509	98.55	98.71	4.74	0.69	0.99	0.98	4.65	4.63	4.65	36
長期 (7-)	22,218	88.86	89.08	15.63	1.03	1.86	1.74	13.02	12.90	12.92	38
長期 (7-11)	9,244	96.92	97.14	8.66	0.97	1.38	1.36	8.29	8.23	8.28	42
超長期 (11-)	12,974	83.11	83.34	20.60	1.08	2.26	2.06	16.96	16.78	16.78	36
AAA~BBB 格	63,982	95.41	95.57	7.73	0.73	1.19	1.15	6.56	6.51	6.53	36
短期 (1-3)	18,957	99.37	99.47	2.06	0.43	0.73	0.73	2.05	2.04	2.05	33
中期 (3-7)	22,750	98.53	98.69	4.74	0.69	0.99	0.99	4.65	4.62	4.65	37
長期 (7-)	22,274	88.85	89.08	15.62	1.03	1.86	1.74	13.01	12.89	12.91	39
長期 (7-11)	9,280	96.89	97.11	8.66	0.97	1.38	1.36	8.28	8.23	8.28	42
超長期 (11-)	12,994	83.11	83.34	20.59	1.08	2.26	2.06	16.95	16.77	16.77	36
AAA~BB 格	63,982	95.41	95.57	7.73	0.73	1.19	1.15	6.56	6.51	6.53	36
短期 (1-3)	18,957	99.37	99.47	2.06	0.43	0.73	0.73	2.05	2.04	2.05	33
中期 (3-7)	22,750	98.53	98.69	4.74	0.69	0.99	0.99	4.65	4.62	4.65	37
長期 (7-)	22,274	88.85	89.08	15.62	1.03	1.86	1.74	13.01	12.89	12.91	39
長期 (7-11)	9,280	96.89	97.11	8.66	0.97	1.38	1.36	8.28	8.23	8.28	42
超長期 (11-)	12,994	83.11	83.34	20.59	1.08	2.26	2.06	16.95	16.77	16.77	36
AAA 格	955	97.95	98.03	3.78	0.31	0.81	0.80	3.69	3.67	3.68	26
短期 (1-3)	505	99.03	99.07	2.10	0.19	0.66	0.66	2.09	2.09	2.09	25
中期 (3-7)	350	97.84	97.96	4.54	0.41	0.88	0.87	4.48	4.46	4.48	26
長期 (7-)	100	92.88	92.97	9.64	0.57	1.37	1.32	9.31	9.25	9.30	29
長期 (7-11)	70	95.30	95.40	8.55	0.62	1.23	1.20	8.32	8.27	8.32	27
超長期 (11-)	30	87.22	87.30	12.17	0.45	1.72	1.61	11.82	11.73	11.81	32
AA 格	37,552	95.00	95.18	9.01	0.78	1.16	1.11	7.36	7.30	7.31	25
短期 (1-3)	10,280	99.56	99.65	2.03	0.42	0.64	0.64	2.02	2.01	2.02	24
中期 (3-7)	12,565	99.28	99.45	4.69	0.73	0.88	0.87	4.60	4.58	4.60	26
長期 (7-)	14,707	88.16	88.39	17.57	1.08	1.84	1.71	14.22	14.08	14.08	26
長期 (7-11)	5,127	98.25	98.48	8.75	1.01	1.23	1.22	8.36	8.30	8.35	28
超長期 (11-)	9,579	82.75	82.99	22.30	1.12	2.23	2.03	17.94	17.75	17.72	25
A 格	24,917	95.90	96.05	6.05	0.67	1.26	1.22	5.55	5.51	5.54	51
短期 (1-3)	7,911	99.17	99.27	2.10	0.45	0.84	0.84	2.09	2.08	2.09	43
中期 (3-7)	9,594	97.62	97.76	4.81	0.64	1.14	1.13	4.72	4.70	4.72	50
長期 (7-)	7,412	90.19	90.40	11.87	0.95	1.90	1.80	10.76	10.66	10.73	62
長期 (7-11)	4,047	95.25	95.47	8.56	0.92	1.57	1.53	8.20	8.14	8.20	61
超長期 (11-)	3,365	84.10	84.32	15.84	0.98	2.36	2.17	14.24	14.09	14.18	65
BBB 格	558	96.78	96.94	3.85	0.75	1.50	1.47	3.66	3.63	3.66	93
短期 (1-3)	261	98.71	98.87	1.92	0.69	1.33	1.32	1.91	1.89	1.91	94
中期 (3-7)	241	97.06	97.24	4.49	0.79	1.46	1.43	4.40	4.37	4.40	83
長期 (7-)	56	86.58	86.69	10.04	0.87	2.61	2.40	9.39	9.28	9.37	136
長期 (7-11)	36	88.93	89.09	7.43	0.84	2.63	2.43	7.19	7.10	7.19	161
超長期 (11-)	20	82.35	82.35	14.74	0.93	2.58	2.35	13.67	13.51	13.63	87
BB 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
B 格以下	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
格付なし	6,057	96.28	96.43	5.14	0.69	1.32	1.27	4.82	4.79	4.82	63
短期 (1-3)	1,959	99.15	99.29	1.96	0.59	1.00	1.00	1.95	1.94	1.95	61
中期 (3-7)	2,723	97.42	97.56	4.66	0.60	1.16	1.15	4.58	4.56	4.58	53
長期 (7-)	1,376	89.93	90.12	10.61	1.00	2.14	1.98	9.85	9.75	9.83	89
長期 (7-11)	866	94.00	94.21	8.36	1.10	1.98	1.86	7.97	7.90	7.97	96
超長期 (11-)	510	83.02	83.18	14.42	0.85	2.46	2.20	13.44	13.30	13.41	75

出所:NFRC

- 格付は、R&Iの格付をもとに NFRC で分類

事業債 JCR 格付別・ポートフォリオ指標 (2024年7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	29,202	96.18	96.31	6.02	0.54	1.05	1.02	5.34	5.30	5.32	33
短期 (1-3)	9,952	99.30	99.37	1.99	0.35	0.69	0.69	1.98	1.98	1.98	30
中期 (3-7)	11,729	97.96	98.08	4.65	0.52	0.95	0.94	4.58	4.56	4.58	33
長期 (7-)	7,521	89.29	89.47	13.47	0.84	1.74	1.63	11.57	11.47	11.51	40
長期 (7-11)	4,100	95.81	95.99	8.39	0.76	1.34	1.31	8.11	8.06	8.11	40
超長期 (11-)	3,421	81.47	81.66	19.56	0.93	2.30	2.07	16.46	16.28	16.31	40
AAA~A 格	41,050	96.05	96.19	5.97	0.62	1.16	1.13	5.36	5.33	5.35	44
短期 (1-3)	13,380	99.23	99.33	2.00	0.39	0.76	0.76	1.99	1.98	1.99	37
中期 (3-7)	16,450	97.91	98.06	4.66	0.60	1.04	1.03	4.58	4.55	4.58	42
長期 (7-)	11,220	89.51	89.72	12.64	0.92	1.88	1.77	11.08	10.98	11.04	57
長期 (7-11)	6,259	95.09	95.29	8.48	0.87	1.54	1.50	8.15	8.09	8.15	58
超長期 (11-)	4,960	82.47	82.69	17.90	0.97	2.37	2.15	15.35	15.18	15.24	56
AAA~BBB 格	41,392	96.06	96.20	5.95	0.62	1.16	1.13	5.35	5.31	5.34	44
短期 (1-3)	13,575	99.23	99.33	2.00	0.40	0.77	0.76	1.99	1.98	1.99	37
中期 (3-7)	16,557	97.91	98.05	4.65	0.60	1.04	1.03	4.58	4.55	4.58	42
長期 (7-)	11,260	89.51	89.71	12.64	0.92	1.88	1.77	11.08	10.98	11.03	57
長期 (7-11)	6,279	95.09	95.28	8.48	0.87	1.54	1.50	8.15	8.09	8.14	58
超長期 (11-)	4,980	82.47	82.69	17.89	0.97	2.38	2.16	15.34	15.18	15.23	56
AAA~BB 格	41,392	96.06	96.20	5.95	0.62	1.16	1.13	5.35	5.31	5.34	44
短期 (1-3)	13,575	99.23	99.33	2.00	0.40	0.77	0.76	1.99	1.98	1.99	37
中期 (3-7)	16,557	97.91	98.05	4.65	0.60	1.04	1.03	4.58	4.55	4.58	42
長期 (7-)	11,260	89.51	89.71	12.64	0.92	1.88	1.77	11.08	10.98	11.03	57
長期 (7-11)	6,279	95.09	95.28	8.48	0.87	1.54	1.50	8.15	8.09	8.14	58
超長期 (11-)	4,980	82.47	82.69	17.89	0.97	2.38	2.16	15.34	15.18	15.23	56
AAA 格	10,515	96.65	96.75	5.64	0.40	0.86	0.84	4.84	4.81	4.81	20
短期 (1-3)	4,025	99.17	99.22	1.92	0.16	0.58	0.58	1.92	1.91	1.92	20
中期 (3-7)	4,622	98.15	98.28	4.60	0.42	0.81	0.81	4.54	4.52	4.54	20
長期 (7-)	1,869	87.51	87.69	16.24	0.84	1.68	1.54	12.77	12.65	12.63	25
長期 (7-11)	1,067	96.37	96.51	8.41	0.71	1.19	1.17	8.15	8.10	8.15	26
超長期 (11-)	802	75.73	75.96	26.67	1.02	2.49	2.16	20.58	20.35	20.22	25
AA 格	18,686	95.92	96.05	6.22	0.63	1.15	1.12	5.63	5.59	5.61	41
短期 (1-3)	5,928	99.38	99.48	2.04	0.48	0.77	0.77	2.03	2.02	2.03	37
中期 (3-7)	7,108	97.84	97.96	4.68	0.58	1.04	1.03	4.61	4.58	4.61	41
長期 (7-)	5,651	89.88	90.06	12.55	0.84	1.76	1.66	11.19	11.09	11.15	45
長期 (7-11)	3,033	95.62	95.80	8.38	0.79	1.39	1.36	8.09	8.04	8.09	45
超長期 (11-)	2,619	83.22	83.41	17.39	0.90	2.24	2.05	15.31	15.15	15.22	45
A 格	11,848	95.72	95.91	5.87	0.80	1.44	1.40	5.43	5.38	5.42	70
短期 (1-3)	3,428	99.06	99.19	2.02	0.52	0.97	0.96	2.01	2.00	2.01	57
中期 (3-7)	4,721	97.80	97.99	4.68	0.79	1.27	1.25	4.58	4.55	4.58	64
長期 (7-)	3,699	89.96	90.21	10.96	1.07	2.18	2.04	10.09	9.99	10.07	91
長期 (7-11)	2,160	93.71	93.95	8.65	1.07	1.94	1.86	8.23	8.15	8.22	92
超長期 (11-)	1,540	84.71	84.97	14.20	1.07	2.54	2.33	12.98	12.83	12.95	90
BBB 格	342	97.38	97.52	3.66	0.70	1.29	1.27	3.44	3.41	3.43	75
短期 (1-3)	195	99.14	99.29	1.82	0.64	1.11	1.10	1.80	1.79	1.80	74
中期 (3-7)	107	97.53	97.66	4.24	0.76	1.36	1.34	4.16	4.14	4.16	75
長期 (7-)	40	88.38	88.47	11.14	0.86	2.06	1.93	10.27	10.17	10.25	80
長期 (7-11)	20	94.42	94.59	7.54	0.79	1.61	1.57	7.31	7.25	7.31	74
超長期 (11-)	20	82.35	82.35	14.74	0.93	2.58	2.35	13.67	13.51	13.63	87
BB 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
B 格以下	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
格付なし	28,104	94.56	94.76	9.76	0.88	1.27	1.21	7.95	7.88	7.89	30
短期 (1-3)	7,150	99.60	99.71	2.06	0.53	0.73	0.72	2.05	2.04	2.05	32
中期 (3-7)	8,689	99.38	99.58	4.76	0.82	0.94	0.94	4.66	4.64	4.66	32
長期 (7-)	12,265	88.21	88.45	17.78	1.12	1.88	1.75	14.44	14.30	14.30	28
長期 (7-11)	3,765	99.00	99.26	8.76	1.13	1.26	1.25	8.33	8.27	8.32	30
超長期 (11-)	8,500	83.43	83.66	21.78	1.12	2.21	2.02	17.65	17.47	17.44	26

出所:NFRC

- 格付は、JCR の格付をもとに NFRC で分類

事業債 JCR 格付別・ポートフォリオ指標 (2024年7月末、8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	29,686	96.23	96.35	6.03	0.55	1.05	1.02	5.36	5.32	5.34	34
短期 (1-3)	10,165	99.28	99.36	2.02	0.35	0.70	0.69	2.01	2.01	2.01	30
中期 (3-7)	11,856	97.98	98.10	4.68	0.53	0.95	0.95	4.61	4.58	4.61	33
長期 (7-)	7,665	89.47	89.65	13.42	0.85	1.73	1.63	11.54	11.44	11.48	40
長期 (7-11)	4,217	95.95	96.12	8.43	0.79	1.34	1.32	8.14	8.09	8.14	40
超長期 (11-)	3,448	81.53	81.73	19.53	0.93	2.30	2.07	16.43	16.26	16.28	41
AAA~A 格	41,461	96.08	96.23	5.99	0.62	1.16	1.13	5.38	5.34	5.37	44
短期 (1-3)	13,654	99.23	99.32	2.04	0.40	0.77	0.76	2.02	2.02	2.02	37
中期 (3-7)	16,573	97.90	98.04	4.71	0.60	1.05	1.04	4.63	4.60	4.62	42
長期 (7-)	11,234	89.59	89.79	12.68	0.93	1.88	1.76	11.11	11.01	11.06	57
長期 (7-11)	6,266	95.21	95.41	8.53	0.89	1.54	1.50	8.20	8.13	8.19	57
超長期 (11-)	4,967	82.49	82.71	17.90	0.98	2.37	2.15	15.35	15.18	15.24	56
AAA~BBB 格	41,806	96.10	96.24	5.97	0.62	1.16	1.13	5.36	5.33	5.35	44
短期 (1-3)	13,853	99.22	99.32	2.03	0.40	0.77	0.77	2.02	2.01	2.02	37
中期 (3-7)	16,679	97.90	98.04	4.70	0.60	1.05	1.04	4.62	4.60	4.62	42
長期 (7-)	11,274	89.58	89.79	12.67	0.93	1.88	1.77	11.11	11.00	11.06	57
長期 (7-11)	6,286	95.21	95.41	8.53	0.89	1.54	1.50	8.19	8.13	8.19	57
超長期 (11-)	4,987	82.49	82.71	17.89	0.98	2.38	2.16	15.34	15.18	15.23	56
AAA~BB 格	41,806	96.10	96.24	5.97	0.62	1.16	1.13	5.36	5.33	5.35	44
短期 (1-3)	13,853	99.22	99.32	2.03	0.40	0.77	0.77	2.02	2.01	2.02	37
中期 (3-7)	16,679	97.90	98.04	4.70	0.60	1.05	1.04	4.62	4.60	4.62	42
長期 (7-)	11,274	89.58	89.79	12.67	0.93	1.88	1.77	11.11	11.00	11.06	57
長期 (7-11)	6,286	95.21	95.41	8.53	0.89	1.54	1.50	8.19	8.13	8.19	57
超長期 (11-)	4,987	82.49	82.71	17.89	0.98	2.38	2.16	15.34	15.18	15.23	56
AAA 格	10,887	96.76	96.87	5.65	0.42	0.87	0.84	4.86	4.83	4.84	21
短期 (1-3)	4,192	99.17	99.21	1.97	0.17	0.58	0.58	1.96	1.95	1.96	19
中期 (3-7)	4,727	98.21	98.34	4.63	0.45	0.82	0.82	4.57	4.55	4.57	20
長期 (7-)	1,969	88.17	88.35	15.91	0.87	1.66	1.53	12.55	12.44	12.42	26
長期 (7-11)	1,167	96.72	96.87	8.51	0.77	1.21	1.20	8.23	8.18	8.22	27
超長期 (11-)	802	75.73	75.96	26.67	1.02	2.49	2.16	20.58	20.35	20.22	25
AA 格	18,798	95.92	96.05	6.25	0.63	1.16	1.12	5.65	5.61	5.64	41
短期 (1-3)	5,974	99.36	99.47	2.06	0.48	0.77	0.77	2.05	2.04	2.05	37
中期 (3-7)	7,130	97.82	97.95	4.71	0.58	1.04	1.03	4.63	4.61	4.63	41
長期 (7-)	5,695	89.91	90.10	12.56	0.84	1.76	1.66	11.20	11.10	11.16	45
長期 (7-11)	3,050	95.66	95.84	8.40	0.79	1.39	1.36	8.11	8.05	8.10	45
超長期 (11-)	2,646	83.29	83.48	17.36	0.90	2.24	2.05	15.29	15.13	15.20	45
A 格	11,775	95.72	95.91	5.89	0.80	1.45	1.40	5.44	5.40	5.44	70
短期 (1-3)	3,489	99.06	99.19	2.07	0.53	0.98	0.97	2.06	2.05	2.06	57
中期 (3-7)	4,716	97.70	97.88	4.78	0.79	1.28	1.26	4.67	4.64	4.67	64
長期 (7-)	3,569	89.85	90.10	11.08	1.08	2.20	2.06	10.19	10.09	10.17	92
長期 (7-11)	2,050	93.69	93.93	8.75	1.09	1.96	1.88	8.31	8.24	8.31	93
超長期 (11-)	1,520	84.67	84.93	14.22	1.08	2.55	2.33	12.99	12.84	12.96	90
BBB 格	345	97.40	97.54	3.65	0.71	1.29	1.27	3.43	3.41	3.43	76
短期 (1-3)	198	99.15	99.30	1.83	0.65	1.12	1.11	1.82	1.81	1.82	75
中期 (3-7)	107	97.53	97.66	4.24	0.76	1.36	1.34	4.16	4.14	4.16	75
長期 (7-)	40	88.38	88.47	11.14	0.86	2.06	1.93	10.27	10.17	10.25	80
長期 (7-11)	20	94.42	94.59	7.54	0.79	1.61	1.57	7.31	7.25	7.31	74
超長期 (11-)	20	82.35	82.35	14.74	0.93	2.58	2.35	13.67	13.51	13.63	87
BB 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
B 格以下	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
格付なし	28,233	94.58	94.78	9.79	0.88	1.27	1.22	7.98	7.91	7.92	30
短期 (1-3)	7,063	99.60	99.71	2.08	0.53	0.73	0.73	2.07	2.06	2.07	33
中期 (3-7)	8,793	99.39	99.58	4.78	0.82	0.94	0.94	4.68	4.65	4.68	31
長期 (7-)	12,377	88.30	88.54	17.75	1.13	1.88	1.75	14.42	14.28	14.28	28
長期 (7-11)	3,860	98.97	99.23	8.80	1.13	1.26	1.25	8.36	8.31	8.36	30
超長期 (11-)	8,517	83.47	83.70	21.81	1.13	2.21	2.02	17.67	17.49	17.46	26

出所:NFRC

- 格付は、JCR の格付をもとに NFRC で分類

事業債 Moody's 格付別・ポートフォリオ指標 (2024年7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	22,918	95.63	95.78	8.69	0.78	1.14	1.10	7.28	7.22	7.23	25
短期 (1-3)	6,666	99.51	99.58	2.02	0.39	0.63	0.63	2.01	2.01	2.01	24
中期 (3-7)	7,278	99.02	99.17	4.63	0.66	0.85	0.84	4.55	4.53	4.55	23
長期 (7-)	8,974	90.01	90.20	16.95	1.16	1.83	1.72	14.02	13.89	13.90	28
長期 (7-11)	3,073	98.31	98.51	8.76	1.03	1.26	1.25	8.37	8.32	8.36	30
超長期 (11-)	5,901	85.69	85.88	21.21	1.22	2.17	2.01	17.40	17.22	17.21	27
AAA~BBB 格	24,942	95.64	95.79	8.58	0.78	1.16	1.12	7.21	7.15	7.16	27
短期 (1-3)	6,996	99.48	99.56	2.03	0.39	0.64	0.64	2.02	2.01	2.02	24
中期 (3-7)	8,334	99.01	99.17	4.64	0.70	0.89	0.89	4.56	4.54	4.56	27
長期 (7-)	9,613	89.92	90.11	16.75	1.15	1.84	1.73	13.90	13.77	13.79	29
長期 (7-11)	3,370	98.13	98.33	8.76	1.02	1.27	1.26	8.37	8.31	8.36	31
超長期 (11-)	6,243	85.49	85.68	21.06	1.21	2.19	2.02	17.33	17.15	17.15	28
AAA~BB 格	24,942	95.64	95.79	8.58	0.78	1.16	1.12	7.21	7.15	7.16	27
短期 (1-3)	6,996	99.48	99.56	2.03	0.39	0.64	0.64	2.02	2.01	2.02	24
中期 (3-7)	8,334	99.01	99.17	4.64	0.70	0.89	0.89	4.56	4.54	4.56	27
長期 (7-)	9,613	89.92	90.11	16.75	1.15	1.84	1.73	13.90	13.77	13.79	29
長期 (7-11)	3,370	98.13	98.33	8.76	1.02	1.27	1.26	8.37	8.31	8.36	31
超長期 (11-)	6,243	85.49	85.68	21.06	1.21	2.19	2.02	17.33	17.15	17.15	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	22,918	95.63	95.78	8.69	0.78	1.14	1.10	7.28	7.22	7.23	25
短期 (1-3)	6,666	99.51	99.58	2.02	0.39	0.63	0.63	2.01	2.01	2.01	24
中期 (3-7)	7,278	99.02	99.17	4.63	0.66	0.85	0.84	4.55	4.53	4.55	23
長期 (7-)	8,974	90.01	90.20	16.95	1.16	1.83	1.72	14.02	13.89	13.90	28
長期 (7-11)	3,073	98.31	98.51	8.76	1.03	1.26	1.25	8.37	8.32	8.36	30
超長期 (11-)	5,901	85.69	85.88	21.21	1.22	2.17	2.01	17.40	17.22	17.21	27
BBB 格	2,024	95.72	95.92	7.23	0.86	1.33	1.29	6.42	6.37	6.40	50
短期 (1-3)	330	99.05	99.12	2.16	0.29	0.72	0.72	2.15	2.15	2.15	30
中期 (3-7)	1,056	98.96	99.18	4.72	0.96	1.19	1.18	4.61	4.58	4.61	56
長期 (7-)	638	88.65	88.87	13.99	0.99	1.94	1.82	12.22	12.10	12.16	51
長期 (7-11)	297	96.26	96.48	8.69	0.91	1.40	1.38	8.34	8.28	8.33	44
超長期 (11-)	341	82.03	82.24	18.60	1.07	2.49	2.26	16.18	16.00	16.07	58
BB 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
B 格以下	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
格付なし	44,554	95.35	95.52	6.89	0.69	1.23	1.19	5.93	5.89	5.91	45
短期 (1-3)	13,730	99.30	99.41	2.01	0.47	0.81	0.81	2.00	1.99	2.00	41
中期 (3-7)	16,912	98.13	98.29	4.72	0.66	1.07	1.06	4.63	4.61	4.63	44
長期 (7-)	13,912	88.08	88.32	14.33	0.94	1.91	1.78	12.06	11.94	11.97	51
長期 (7-11)	6,674	95.76	95.99	8.49	0.94	1.52	1.48	8.14	8.08	8.13	56
超長期 (11-)	7,238	80.99	81.25	19.72	0.94	2.35	2.11	16.32	16.15	16.16	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7月末、8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	23,831	95.65	95.80	8.75	0.79	1.15	1.11	7.35	7.29	7.30	25
短期 (1-3)	6,811	99.49	99.57	2.05	0.39	0.64	0.64	2.04	2.04	2.04	24
中期 (3-7)	7,525	99.17	99.32	4.68	0.69	0.85	0.84	4.60	4.58	4.60	23
長期 (7-)	9,496	90.11	90.30	16.77	1.14	1.81	1.71	13.93	13.80	13.82	27
長期 (7-11)	3,267	98.38	98.57	8.78	1.03	1.25	1.24	8.38	8.33	8.38	29
超長期 (11-)	6,229	85.77	85.96	20.96	1.20	2.15	1.99	17.27	17.09	17.09	26
AAA~BBB 格	25,836	95.65	95.80	8.63	0.79	1.16	1.12	7.28	7.22	7.24	27
短期 (1-3)	7,121	99.47	99.55	2.06	0.39	0.64	0.64	2.05	2.05	2.05	24
中期 (3-7)	8,581	99.14	99.30	4.69	0.72	0.89	0.89	4.60	4.58	4.60	27
長期 (7-)	10,134	90.02	90.21	16.59	1.13	1.82	1.72	13.83	13.70	13.72	29
長期 (7-11)	3,564	98.20	98.40	8.77	1.02	1.26	1.25	8.38	8.32	8.37	30
超長期 (11-)	6,571	85.58	85.77	20.84	1.20	2.17	2.01	17.22	17.04	17.04	27
AAA~BB 格	25,836	95.65	95.80	8.63	0.79	1.16	1.12	7.28	7.22	7.24	27
短期 (1-3)	7,121	99.47	99.55	2.06	0.39	0.64	0.64	2.05	2.05	2.05	24
中期 (3-7)	8,581	99.14	99.30	4.69	0.72	0.89	0.89	4.60	4.58	4.60	27
長期 (7-)	10,134	90.02	90.21	16.59	1.13	1.82	1.72	13.83	13.70	13.72	29
長期 (7-11)	3,564	98.20	98.40	8.77	1.02	1.26	1.25	8.38	8.32	8.37	30
超長期 (11-)	6,571	85.58	85.77	20.84	1.20	2.17	2.01	17.22	17.04	17.04	27
AAA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
A 格	23,831	95.65	95.80	8.75	0.79	1.15	1.11	7.35	7.29	7.30	25
短期 (1-3)	6,811	99.49	99.57	2.05	0.39	0.64	0.64	2.04	2.04	2.04	24
中期 (3-7)	7,525	99.17	99.32	4.68	0.69	0.85	0.84	4.60	4.58	4.60	23
長期 (7-)	9,496	90.11	90.30	16.77	1.14	1.81	1.71	13.93	13.80	13.82	27
長期 (7-11)	3,267	98.38	98.57	8.78	1.03	1.25	1.24	8.38	8.33	8.38	29
超長期 (11-)	6,229	85.77	85.96	20.96	1.20	2.15	1.99	17.27	17.09	17.09	26
BBB 格	2,004	95.68	95.88	7.29	0.86	1.34	1.30	6.47	6.42	6.46	51
短期 (1-3)	310	99.01	99.07	2.23	0.29	0.73	0.73	2.22	2.22	2.22	30
中期 (3-7)	1,056	98.96	99.18	4.72	0.96	1.19	1.18	4.61	4.58	4.61	56
長期 (7-)	638	88.65	88.87	13.99	0.99	1.94	1.82	12.22	12.10	12.16	51
長期 (7-11)	297	96.26	96.48	8.69	0.91	1.40	1.38	8.34	8.28	8.33	44
超長期 (11-)	341	82.03	82.24	18.60	1.07	2.49	2.26	16.18	16.00	16.07	58
BB 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
B 格以下	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
格付なし	44,203	95.39	95.56	6.85	0.69	1.23	1.19	5.90	5.85	5.88	45
短期 (1-3)	13,795	99.29	99.40	2.04	0.47	0.82	0.82	2.03	2.02	2.03	42
中期 (3-7)	16,892	98.04	98.20	4.75	0.66	1.07	1.06	4.66	4.64	4.66	44
長期 (7-)	13,516	88.09	88.34	14.38	0.95	1.92	1.79	12.06	11.95	11.98	52
長期 (7-11)	6,583	95.80	96.03	8.56	0.95	1.52	1.48	8.19	8.13	8.19	56
超長期 (11-)	6,934	80.77	81.03	19.91	0.95	2.37	2.13	16.42	16.24	16.25	47

出所:NFRC

- 格付は、Moody's の格付をもとに NFRC で分類

事業債 S&P 格付別・ポートフォリオ指標 (2024年7月末)

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
AAA~AA 格	851	84.49	84.70	17.79	0.98	1.87	1.68	13.69	13.55	13.55	31
短期 (1-3)	40	102.72	102.93	2.40	1.75	0.69	0.69	2.36	2.35	2.36	25
中期 (3-7)	115	95.77	95.82	5.66	0.22	0.99	0.97	5.61	5.58	5.61	29
長期 (7-)	696	81.58	81.81	20.68	1.06	2.13	1.89	16.07	15.90	15.90	32
長期 (7-11)	212	99.92	100.22	8.87	1.25	1.26	1.26	8.39	8.33	8.38	30
超長期 (11-)	484	73.54	73.75	25.85	0.98	2.65	2.27	20.65	20.41	20.38	33
AAA~A 格	16,203	94.18	94.38	9.08	0.74	1.18	1.12	7.42	7.36	7.37	26
短期 (1-3)	3,995	99.65	99.76	2.01	0.43	0.63	0.63	2.00	2.00	2.00	23
中期 (3-7)	5,446	98.86	99.03	4.92	0.67	0.89	0.89	4.83	4.81	4.83	26
長期 (7-)	6,762	87.17	87.45	16.61	0.96	1.80	1.66	13.43	13.31	13.31	28
長期 (7-11)	2,738	98.40	98.67	8.59	1.02	1.22	1.21	8.21	8.16	8.20	28
超長期 (11-)	4,025	79.53	79.82	22.07	0.93	2.29	2.04	17.83	17.64	17.61	28
AAA~BBB 格	16,675	94.29	94.49	8.92	0.73	1.17	1.12	7.30	7.24	7.25	27
短期 (1-3)	4,251	99.62	99.72	2.01	0.44	0.65	0.64	2.00	1.99	2.00	25
中期 (3-7)	5,617	98.84	99.02	4.90	0.67	0.90	0.89	4.80	4.78	4.80	26
長期 (7-)	6,807	87.22	87.50	16.56	0.96	1.80	1.66	13.40	13.27	13.28	28
長期 (7-11)	2,772	98.38	98.65	8.58	1.02	1.22	1.21	8.20	8.15	8.20	29
超長期 (11-)	4,035	79.55	79.84	22.05	0.93	2.29	2.04	17.81	17.62	17.60	28
AAA~BB 格	16,915	94.38	94.59	8.88	0.75	1.18	1.13	7.27	7.21	7.22	28
短期 (1-3)	4,251	99.62	99.72	2.01	0.44	0.65	0.64	2.00	1.99	2.00	25
中期 (3-7)	5,832	98.93	99.12	4.89	0.73	0.94	0.93	4.79	4.77	4.79	30
長期 (7-)	6,832	87.23	87.51	16.56	0.97	1.81	1.66	13.40	13.27	13.28	29
長期 (7-11)	2,772	98.38	98.65	8.58	1.02	1.22	1.21	8.20	8.15	8.20	29
超長期 (11-)	4,060	79.63	79.91	22.01	0.94	2.30	2.04	17.78	17.59	17.56	29
AAA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA 格	851	84.49	84.70	17.79	0.98	1.87	1.68	13.69	13.55	13.55	31
短期 (1-3)	40	102.72	102.93	2.40	1.75	0.69	0.69	2.36	2.35	2.36	25
中期 (3-7)	115	95.77	95.82	5.66	0.22	0.99	0.97	5.61	5.58	5.61	29
長期 (7-)	696	81.58	81.81	20.68	1.06	2.13	1.89	16.07	15.90	15.90	32
長期 (7-11)	212	99.92	100.22	8.87	1.25	1.26	1.26	8.39	8.33	8.38	30
超長期 (11-)	484	73.54	73.75	25.85	0.98	2.65	2.27	20.65	20.41	20.38	33
A 格	15,352	94.71	94.91	8.60	0.72	1.14	1.09	7.11	7.06	7.07	26
短期 (1-3)	3,955	99.62	99.72	2.01	0.42	0.63	0.63	2.00	1.99	2.00	23
中期 (3-7)	5,331	98.93	99.10	4.91	0.68	0.89	0.89	4.81	4.79	4.81	25
長期 (7-)	6,066	87.81	88.10	16.14	0.95	1.77	1.63	13.15	13.03	13.04	28
長期 (7-11)	2,526	98.27	98.54	8.57	1.00	1.22	1.21	8.19	8.14	8.19	28
超長期 (11-)	3,541	80.35	80.65	21.55	0.92	2.25	2.01	17.47	17.29	17.26	27
BBB 格	473	98.31	98.50	3.35	0.58	1.04	1.03	3.24	3.22	3.24	53
短期 (1-3)	257	99.05	99.22	1.88	0.48	0.93	0.93	1.87	1.86	1.87	55
中期 (3-7)	172	98.29	98.46	3.97	0.63	1.07	1.06	3.91	3.89	3.91	49
長期 (7-)	45	94.16	94.47	9.42	0.97	1.62	1.57	8.84	8.76	8.83	57
長期 (7-11)	35	96.73	97.08	8.13	0.97	1.43	1.41	7.79	7.74	7.79	52
超長期 (11-)	10	85.31	85.43	13.87	0.95	2.36	2.18	12.92	12.78	12.89	77
BB 格	240	100.33	100.90	5.83	2.26	2.04	2.04	5.26	5.20	5.25	134
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	215	101.28	101.87	4.66	2.25	1.93	1.94	4.43	4.38	4.42	133
長期 (7-)	25	92.16	92.57	15.82	2.37	3.11	2.99	13.10	12.91	13.02	146
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	25	92.16	92.57	15.82	2.37	3.11	2.99	13.10	12.91	13.02	146
B 格以下	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
格付なし	52,581	95.80	95.95	7.05	0.71	1.21	1.17	6.11	6.06	6.09	42
短期 (1-3)	16,474	99.30	99.39	2.02	0.44	0.78	0.78	2.01	2.00	2.01	38
中期 (3-7)	19,414	98.26	98.42	4.63	0.66	1.03	1.02	4.55	4.53	4.55	41
長期 (7-)	16,693	89.48	89.68	14.81	1.05	1.91	1.80	12.59	12.47	12.50	47
長期 (7-11)	7,272	95.86	96.06	8.58	0.95	1.51	1.48	8.22	8.16	8.22	55
超長期 (11-)	9,420	84.56	84.76	19.63	1.12	2.26	2.08	16.41	16.23	16.25	41

出所:NFRC

- 格付は、S&P の格付をもとに NFRC で分類

事業債 S&P 格付別・ポートフォリオ指標 (2024年7月末、8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	84.49	84.70	17.79	0.98	1.87	1.68	13.69	13.55	13.55	31
短期 (1-3)	40	102.72	102.93	2.40	1.75	0.69	0.69	2.36	2.35	2.36	25
中期 (3-7)	115	95.77	95.82	5.66	0.22	0.99	0.97	5.61	5.58	5.61	29
長期 (7-)	696	81.58	81.81	20.68	1.06	2.13	1.89	16.07	15.90	15.90	32
長期 (7-11)	212	99.92	100.22	8.87	1.25	1.26	1.26	8.39	8.33	8.38	30
超長期 (11-)	484	73.54	73.75	25.85	0.98	2.65	2.27	20.65	20.41	20.38	33
AAA~A 格	16,488	94.28	94.48	9.05	0.74	1.18	1.12	7.41	7.35	7.36	26
短期 (1-3)	4,005	99.65	99.75	2.03	0.44	0.63	0.63	2.02	2.02	2.02	23
中期 (3-7)	5,611	98.89	99.07	4.94	0.68	0.90	0.89	4.84	4.82	4.84	26
長期 (7-)	6,872	87.38	87.66	16.50	0.97	1.80	1.65	13.35	13.23	13.23	28
長期 (7-11)	2,868	98.47	98.74	8.65	1.04	1.23	1.22	8.25	8.20	8.25	29
超長期 (11-)	4,005	79.44	79.73	22.12	0.93	2.30	2.04	17.87	17.68	17.65	28
AAA~BBB 格	16,960	94.39	94.59	8.89	0.74	1.17	1.12	7.29	7.23	7.24	27
短期 (1-3)	4,271	99.61	99.72	2.03	0.44	0.65	0.65	2.02	2.01	2.02	25
中期 (3-7)	5,772	98.88	99.05	4.91	0.68	0.90	0.90	4.82	4.79	4.82	26
長期 (7-)	6,917	87.42	87.70	16.45	0.97	1.79	1.65	13.32	13.20	13.20	28
長期 (7-11)	2,902	98.45	98.72	8.64	1.04	1.23	1.22	8.25	8.20	8.24	29
超長期 (11-)	4,015	79.45	79.74	22.10	0.93	2.30	2.04	17.86	17.67	17.64	28
AAA~BB 格	17,200	94.47	94.68	8.85	0.76	1.18	1.13	7.26	7.20	7.21	28
短期 (1-3)	4,271	99.61	99.72	2.03	0.44	0.65	0.65	2.02	2.01	2.02	25
中期 (3-7)	5,987	98.96	99.15	4.90	0.74	0.94	0.93	4.80	4.78	4.80	30
長期 (7-)	6,942	87.44	87.72	16.45	0.98	1.80	1.66	13.32	13.20	13.20	29
長期 (7-11)	2,902	98.45	98.72	8.64	1.04	1.23	1.22	8.25	8.20	8.24	29
超長期 (11-)	4,040	79.53	79.82	22.06	0.94	2.30	2.05	17.83	17.64	17.61	29
AAA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA 格	851	84.49	84.70	17.79	0.98	1.87	1.68	13.69	13.55	13.55	31
短期 (1-3)	40	102.72	102.93	2.40	1.75	0.69	0.69	2.36	2.35	2.36	25
中期 (3-7)	115	95.77	95.82	5.66	0.22	0.99	0.97	5.61	5.58	5.61	29
長期 (7-)	696	81.58	81.81	20.68	1.06	2.13	1.89	16.07	15.90	15.90	32
長期 (7-11)	212	99.92	100.22	8.87	1.25	1.26	1.26	8.39	8.33	8.38	30
超長期 (11-)	484	73.54	73.75	25.85	0.98	2.65	2.27	20.65	20.41	20.38	33
A 格	15,637	94.81	95.01	8.57	0.73	1.14	1.09	7.11	7.05	7.06	26
短期 (1-3)	3,965	99.62	99.72	2.03	0.42	0.63	0.63	2.02	2.01	2.02	23
中期 (3-7)	5,496	98.96	99.13	4.92	0.69	0.89	0.89	4.82	4.80	4.82	26
長期 (7-)	6,176	88.03	88.32	16.03	0.96	1.76	1.63	13.07	12.95	12.96	28
長期 (7-11)	2,656	98.36	98.62	8.63	1.02	1.23	1.22	8.24	8.19	8.24	28
超長期 (11-)	3,521	80.25	80.55	21.61	0.92	2.25	2.01	17.52	17.34	17.31	27
BBB 格	473	98.31	98.50	3.35	0.58	1.04	1.03	3.24	3.22	3.24	53
短期 (1-3)	267	99.00	99.18	1.93	0.48	0.94	0.94	1.91	1.91	1.91	55
中期 (3-7)	162	98.31	98.48	4.02	0.65	1.06	1.05	3.97	3.95	3.97	48
長期 (7-)	45	94.16	94.47	9.42	0.97	1.62	1.57	8.84	8.76	8.83	57
長期 (7-11)	35	96.73	97.08	8.13	0.97	1.43	1.41	7.79	7.74	7.79	52
超長期 (11-)	10	85.31	85.43	13.87	0.95	2.36	2.18	12.92	12.78	12.89	77
BB 格	240	100.33	100.90	5.83	2.26	2.04	2.04	5.26	5.20	5.25	134
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	215	101.28	101.87	4.66	2.25	1.93	1.94	4.43	4.38	4.42	133
長期 (7-)	25	92.16	92.57	15.82	2.37	3.11	2.99	13.10	12.91	13.02	146
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	25	92.16	92.57	15.82	2.37	3.11	2.99	13.10	12.91	13.02	146
B 格以下	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
格付なし	52,839	95.81	95.96	7.07	0.72	1.21	1.17	6.14	6.09	6.11	42
短期 (1-3)	16,645	99.29	99.38	2.06	0.44	0.79	0.78	2.04	2.04	2.04	38
中期 (3-7)	19,485	98.24	98.39	4.68	0.66	1.03	1.02	4.59	4.57	4.59	41
長期 (7-)	16,709	89.53	89.73	14.86	1.05	1.91	1.80	12.63	12.51	12.54	47
長期 (7-11)	7,244	95.91	96.11	8.63	0.95	1.51	1.47	8.26	8.20	8.26	54
超長期 (11-)	9,464	84.64	84.84	19.63	1.13	2.26	2.08	16.41	16.24	16.26	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7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	1,355	99.18	99.34	3.29	0.83	1.09	1.08	3.21	3.19	3.21	58
短期(1-3)	683	99.52	99.63	2.00	0.71	0.95	0.95	1.99	1.98	1.99	56
中期(3-7)	601	98.99	99.21	4.11	0.92	1.18	1.17	4.03	4.00	4.03	59
長期(7-)	71	97.39	97.61	8.76	1.21	1.58	1.56	8.26	8.20	8.25	62
長期(7-11)	67	97.48	97.71	8.42	1.16	1.53	1.52	8.02	7.96	8.01	60
超長期(11-)	4	95.85	95.92	14.17	1.99	2.38	2.34	12.22	12.08	12.16	94
AAA~A格	3,078	98.85	99.06	3.67	1.04	1.34	1.33	3.50	3.47	3.50	79
短期(1-3)	1,605	99.49	99.66	2.13	0.94	1.16	1.16	2.10	2.09	2.10	75
中期(3-7)	1,197	98.44	98.65	4.09	0.98	1.37	1.36	4.00	3.97	4.00	78
長期(7-)	276	96.92	97.32	10.82	1.86	2.26	2.22	9.60	9.49	9.57	111
長期(7-11)	150	96.37	96.64	8.46	1.34	1.86	1.83	7.98	7.91	7.97	91
超長期(11-)	126	97.58	98.14	13.65	2.49	2.73	2.68	11.51	11.36	11.45	133
AAA~BBB格	3,549	98.86	99.07	3.89	1.06	1.35	1.34	3.69	3.66	3.68	79
短期(1-3)	1,783	99.51	99.69	2.13	0.93	1.15	1.15	2.11	2.10	2.11	74
中期(3-7)	1,408	98.57	98.78	4.24	1.02	1.37	1.36	4.14	4.11	4.14	78
長期(7-)	357	96.73	97.11	11.24	1.85	2.25	2.21	9.92	9.81	9.88	107
長期(7-11)	193	96.87	97.14	8.66	1.43	1.87	1.84	8.13	8.06	8.13	91
超長期(11-)	165	96.57	97.07	14.24	2.36	2.70	2.64	12.01	11.85	11.94	125
AAA~BB格	3,549	98.86	99.07	3.89	1.06	1.35	1.34	3.69	3.66	3.68	79
短期(1-3)	1,783	99.51	99.69	2.13	0.93	1.15	1.15	2.11	2.10	2.11	74
中期(3-7)	1,408	98.57	98.78	4.24	1.02	1.37	1.36	4.14	4.11	4.14	78
長期(7-)	357	96.73	97.11	11.24	1.85	2.25	2.21	9.92	9.81	9.88	107
長期(7-11)	193	96.87	97.14	8.66	1.43	1.87	1.84	8.13	8.06	8.13	91
超長期(11-)	165	96.57	97.07	14.24	2.36	2.70	2.64	12.01	11.85	11.94	125
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	99.18	99.34	3.29	0.83	1.09	1.08	3.21	3.19	3.21	58
短期(1-3)	683	99.52	99.63	2.00	0.71	0.95	0.95	1.99	1.98	1.99	56
中期(3-7)	601	98.99	99.21	4.11	0.92	1.18	1.17	4.03	4.00	4.03	59
長期(7-)	71	97.39	97.61	8.76	1.21	1.58	1.56	8.26	8.20	8.25	62
長期(7-11)	67	97.48	97.71	8.42	1.16	1.53	1.52	8.02	7.96	8.01	60
超長期(11-)	4	95.85	95.92	14.17	1.99	2.38	2.34	12.22	12.08	12.16	94
A格	1,723	98.60	98.84	3.97	1.20	1.54	1.53	3.73	3.70	3.72	97
短期(1-3)	922	99.46	99.69	2.22	1.10	1.32	1.32	2.19	2.18	2.19	90
中期(3-7)	596	97.89	98.08	4.06	1.03	1.57	1.55	3.98	3.95	3.98	98
長期(7-)	205	96.77	97.22	11.54	2.09	2.49	2.45	10.07	9.94	10.03	127
長期(7-11)	84	95.49	95.78	8.49	1.47	2.13	2.08	7.95	7.87	7.94	116
超長期(11-)	122	97.64	98.21	13.63	2.51	2.74	2.70	11.48	11.33	11.43	135
BBB格	471	98.92	99.13	5.30	1.22	1.40	1.39	4.90	4.86	4.89	73
短期(1-3)	178	99.75	99.90	2.20	0.91	1.06	1.06	2.18	2.16	2.18	64
中期(3-7)	211	99.32	99.53	5.10	1.25	1.38	1.37	4.93	4.90	4.93	73
長期(7-)	81	96.07	96.38	12.64	1.82	2.23	2.19	11.02	10.89	10.96	93
長期(7-11)	42	98.64	98.94	9.40	1.74	1.92	1.91	8.67	8.59	8.66	91
超長期(11-)	39	93.29	93.61	16.15	1.91	2.59	2.51	13.70	13.53	13.59	96
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7月末、8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	1,457	99.21	99.36	3.28	0.83	1.08	1.07	3.20	3.19	3.20	57
短期 (1-3)	773	99.54	99.64	2.11	0.72	0.95	0.95	2.09	2.08	2.09	54
中期 (3-7)	613	99.01	99.23	4.12	0.93	1.18	1.17	4.04	4.02	4.04	59
長期 (7-)	71	97.39	97.61	8.76	1.21	1.58	1.56	8.26	8.20	8.25	62
長期 (7-11)	67	97.48	97.71	8.42	1.16	1.53	1.52	8.02	7.96	8.01	60
超長期 (11-)	4	95.85	95.92	14.17	1.99	2.38	2.34	12.22	12.08	12.16	94
AAA~A 格	3,180	98.88	99.08	3.65	1.03	1.33	1.32	3.49	3.46	3.49	78
短期 (1-3)	1,695	99.49	99.66	2.17	0.93	1.15	1.15	2.15	2.13	2.15	74
中期 (3-7)	1,209	98.46	98.66	4.09	0.98	1.37	1.36	4.01	3.98	4.01	78
長期 (7-)	276	96.92	97.32	10.82	1.86	2.26	2.22	9.60	9.49	9.57	111
長期 (7-11)	150	96.37	96.64	8.46	1.34	1.86	1.83	7.98	7.91	7.97	91
超長期 (11-)	126	97.58	98.14	13.65	2.49	2.73	2.68	11.51	11.36	11.45	133
AAA~BBB 格	3,650	98.88	99.09	3.86	1.05	1.34	1.33	3.67	3.64	3.67	78
短期 (1-3)	1,873	99.52	99.69	2.17	0.93	1.14	1.14	2.15	2.14	2.15	73
中期 (3-7)	1,420	98.58	98.79	4.24	1.02	1.37	1.36	4.15	4.12	4.15	77
長期 (7-)	357	96.73	97.11	11.24	1.85	2.25	2.21	9.92	9.81	9.88	107
長期 (7-11)	193	96.87	97.14	8.66	1.43	1.87	1.84	8.13	8.06	8.13	91
超長期 (11-)	165	96.57	97.07	14.24	2.36	2.70	2.64	12.01	11.85	11.94	125
AAA~BB 格	3,650	98.88	99.09	3.86	1.05	1.34	1.33	3.67	3.64	3.67	78
短期 (1-3)	1,873	99.52	99.69	2.17	0.93	1.14	1.14	2.15	2.14	2.15	73
中期 (3-7)	1,420	98.58	98.79	4.24	1.02	1.37	1.36	4.15	4.12	4.15	77
長期 (7-)	357	96.73	97.11	11.24	1.85	2.25	2.21	9.92	9.81	9.88	107
長期 (7-11)	193	96.87	97.14	8.66	1.43	1.87	1.84	8.13	8.06	8.13	91
超長期 (11-)	165	96.57	97.07	14.24	2.36	2.70	2.64	12.01	11.85	11.94	125
AAA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA 格	1,457	99.21	99.36	3.28	0.83	1.08	1.07	3.20	3.19	3.20	57
短期 (1-3)	773	99.54	99.64	2.11	0.72	0.95	0.95	2.09	2.08	2.09	54
中期 (3-7)	613	99.01	99.23	4.12	0.93	1.18	1.17	4.04	4.02	4.04	59
長期 (7-)	71	97.39	97.61	8.76	1.21	1.58	1.56	8.26	8.20	8.25	62
長期 (7-11)	67	97.48	97.71	8.42	1.16	1.53	1.52	8.02	7.96	8.01	60
超長期 (11-)	4	95.85	95.92	14.17	1.99	2.38	2.34	12.22	12.08	12.16	94
A 格	1,723	98.60	98.84	3.97	1.20	1.54	1.53	3.73	3.70	3.72	97
短期 (1-3)	922	99.46	99.69	2.22	1.10	1.32	1.32	2.19	2.18	2.19	90
中期 (3-7)	596	97.89	98.08	4.06	1.03	1.57	1.55	3.98	3.95	3.98	98
長期 (7-)	205	96.77	97.22	11.54	2.09	2.49	2.45	10.07	9.94	10.03	127
長期 (7-11)	84	95.49	95.78	8.49	1.47	2.13	2.08	7.95	7.87	7.94	116
超長期 (11-)	122	97.64	98.21	13.63	2.51	2.74	2.70	11.48	11.33	11.43	135
BBB 格	471	98.92	99.13	5.30	1.22	1.40	1.39	4.90	4.86	4.89	73
短期 (1-3)	178	99.75	99.90	2.20	0.91	1.06	1.06	2.18	2.16	2.18	64
中期 (3-7)	211	99.32	99.53	5.10	1.25	1.38	1.37	4.93	4.90	4.93	73
長期 (7-)	81	96.07	96.38	12.64	1.82	2.23	2.19	11.02	10.89	10.96	93
長期 (7-11)	42	98.64	98.94	9.40	1.74	1.92	1.91	8.67	8.59	8.66	91
超長期 (11-)	39	93.29	93.61	16.15	1.91	2.59	2.51	13.70	13.53	13.59	96
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7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	276	99.02	99.17	3.14	0.76	1.07	1.06	3.08	3.06	3.08	58
短期(1-3)	158	99.49	99.61	1.95	0.73	0.99	0.99	1.94	1.93	1.94	60
中期(3-7)	104	98.55	98.70	4.26	0.78	1.15	1.14	4.19	4.17	4.19	55
長期(7-)	14	97.19	97.57	8.29	0.94	1.36	1.34	7.96	7.91	7.96	44
長期(7-11)	14	97.19	97.57	8.29	0.94	1.36	1.34	7.96	7.91	7.96	44
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AAA~A格	2,031	99.41	99.60	3.50	0.96	1.17	1.17	3.37	3.35	3.37	64
短期(1-3)	1,128	99.61	99.77	2.11	0.87	1.05	1.05	2.09	2.08	2.09	64
中期(3-7)	751	98.96	99.16	4.11	0.95	1.20	1.20	4.03	4.00	4.03	62
長期(7-)	152	100.08	100.44	10.72	1.76	1.85	1.86	9.61	9.52	9.58	74
長期(7-11)	91	96.96	97.18	8.46	1.09	1.54	1.52	8.07	8.01	8.07	60
超長期(11-)	62	104.65	105.22	14.04	2.73	2.27	2.32	11.70	11.56	11.63	94
AAA~BBB格	3,549	98.86	99.07	3.89	1.06	1.35	1.34	3.69	3.66	3.68	79
短期(1-3)	1,783	99.51	99.69	2.13	0.93	1.15	1.15	2.11	2.10	2.11	74
中期(3-7)	1,408	98.57	98.78	4.24	1.02	1.37	1.36	4.14	4.11	4.14	78
長期(7-)	357	96.73	97.11	11.24	1.85	2.25	2.21	9.92	9.81	9.88	107
長期(7-11)	193	96.87	97.14	8.66	1.43	1.87	1.84	8.13	8.06	8.13	91
超長期(11-)	165	96.57	97.07	14.24	2.36	2.70	2.64	12.01	11.85	11.94	125
AAA~BB格	3,549	98.86	99.07	3.89	1.06	1.35	1.34	3.69	3.66	3.68	79
短期(1-3)	1,783	99.51	99.69	2.13	0.93	1.15	1.15	2.11	2.10	2.11	74
中期(3-7)	1,408	98.57	98.78	4.24	1.02	1.37	1.36	4.14	4.11	4.14	78
長期(7-)	357	96.73	97.11	11.24	1.85	2.25	2.21	9.92	9.81	9.88	107
長期(7-11)	193	96.87	97.14	8.66	1.43	1.87	1.84	8.13	8.06	8.13	91
超長期(11-)	165	96.57	97.07	14.24	2.36	2.70	2.64	12.01	11.85	11.94	125
AAA格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA格	276	99.02	99.17	3.14	0.76	1.07	1.06	3.08	3.06	3.08	58
短期(1-3)	158	99.49	99.61	1.95	0.73	0.99	0.99	1.94	1.93	1.94	60
中期(3-7)	104	98.55	98.70	4.26	0.78	1.15	1.14	4.19	4.17	4.19	55
長期(7-)	14	97.19	97.57	8.29	0.94	1.36	1.34	7.96	7.91	7.96	44
長期(7-11)	14	97.19	97.57	8.29	0.94	1.36	1.34	7.96	7.91	7.96	44
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
A格	1,755	99.47	99.66	3.55	1.00	1.18	1.18	3.42	3.40	3.42	65
短期(1-3)	970	99.63	99.80	2.14	0.89	1.06	1.06	2.12	2.11	2.12	65
中期(3-7)	647	99.02	99.24	4.08	0.97	1.21	1.21	4.00	3.98	4.00	63
長期(7-)	139	100.36	100.72	10.97	1.84	1.90	1.91	9.77	9.67	9.74	77
長期(7-11)	77	96.92	97.11	8.49	1.12	1.57	1.55	8.10	8.03	8.09	63
超長期(11-)	62	104.65	105.22	14.04	2.73	2.27	2.32	11.70	11.56	11.63	94
BBB格	1,518	98.13	98.36	4.40	1.19	1.59	1.57	4.11	4.07	4.10	98
短期(1-3)	655	99.34	99.54	2.17	1.05	1.32	1.32	2.14	2.13	2.14	91
中期(3-7)	658	98.14	98.35	4.38	1.10	1.57	1.55	4.27	4.24	4.27	96
長期(7-)	205	94.25	94.64	11.62	1.93	2.57	2.49	10.16	10.03	10.12	132
長期(7-11)	102	96.79	97.11	8.84	1.72	2.17	2.14	8.18	8.10	8.18	119
超長期(11-)	103	91.74	92.20	14.36	2.13	2.99	2.87	12.22	12.05	12.15	146
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7月末、8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	336	99.11	99.25	3.09	0.77	1.05	1.05	3.04	3.02	3.04	56
短期 (1-3)	218	99.50	99.62	2.21	0.75	0.99	0.98	2.19	2.18	2.19	57
中期 (3-7)	104	98.55	98.70	4.26	0.78	1.15	1.14	4.19	4.17	4.19	55
長期 (7-)	14	97.19	97.57	8.29	0.94	1.36	1.34	7.96	7.91	7.96	44
長期 (7-11)	14	97.19	97.57	8.29	0.94	1.36	1.34	7.96	7.91	7.96	44
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AAA~A 格	2,132	99.42	99.60	3.48	0.96	1.16	1.16	3.36	3.34	3.36	63
短期 (1-3)	1,218	99.61	99.77	2.17	0.87	1.05	1.05	2.15	2.14	2.15	63
中期 (3-7)	762	98.97	99.18	4.12	0.95	1.20	1.20	4.04	4.01	4.04	61
長期 (7-)	152	100.08	100.44	10.72	1.76	1.85	1.86	9.61	9.52	9.58	74
長期 (7-11)	91	96.96	97.18	8.46	1.09	1.54	1.52	8.07	8.01	8.07	60
超長期 (11-)	62	104.65	105.22	14.04	2.73	2.27	2.32	11.70	11.56	11.63	94
AAA~BBB 格	3,650	98.88	99.09	3.86	1.05	1.34	1.33	3.67	3.64	3.67	78
短期 (1-3)	1,873	99.52	99.69	2.17	0.93	1.14	1.14	2.15	2.14	2.15	73
中期 (3-7)	1,420	98.58	98.79	4.24	1.02	1.37	1.36	4.15	4.12	4.15	77
長期 (7-)	357	96.73	97.11	11.24	1.85	2.25	2.21	9.92	9.81	9.88	107
長期 (7-11)	193	96.87	97.14	8.66	1.43	1.87	1.84	8.13	8.06	8.13	91
超長期 (11-)	165	96.57	97.07	14.24	2.36	2.70	2.64	12.01	11.85	11.94	125
AAA~BB 格	3,650	98.88	99.09	3.86	1.05	1.34	1.33	3.67	3.64	3.67	78
短期 (1-3)	1,873	99.52	99.69	2.17	0.93	1.14	1.14	2.15	2.14	2.15	73
中期 (3-7)	1,420	98.58	98.79	4.24	1.02	1.37	1.36	4.15	4.12	4.15	77
長期 (7-)	357	96.73	97.11	11.24	1.85	2.25	2.21	9.92	9.81	9.88	107
長期 (7-11)	193	96.87	97.14	8.66	1.43	1.87	1.84	8.13	8.06	8.13	91
超長期 (11-)	165	96.57	97.07	14.24	2.36	2.70	2.64	12.01	11.85	11.94	125
AAA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA 格	336	99.11	99.25	3.09	0.77	1.05	1.05	3.04	3.02	3.04	56
短期 (1-3)	218	99.50	99.62	2.21	0.75	0.99	0.98	2.19	2.18	2.19	57
中期 (3-7)	104	98.55	98.70	4.26	0.78	1.15	1.14	4.19	4.17	4.19	55
長期 (7-)	14	97.19	97.57	8.29	0.94	1.36	1.34	7.96	7.91	7.96	44
長期 (7-11)	14	97.19	97.57	8.29	0.94	1.36	1.34	7.96	7.91	7.96	44
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
A 格	1,796	99.47	99.67	3.55	0.99	1.18	1.18	3.42	3.40	3.42	65
短期 (1-3)	1,000	99.64	99.80	2.17	0.89	1.06	1.06	2.14	2.13	2.14	64
中期 (3-7)	658	99.04	99.25	4.10	0.97	1.21	1.20	4.01	3.99	4.01	62
長期 (7-)	139	100.36	100.72	10.97	1.84	1.90	1.91	9.77	9.67	9.74	77
長期 (7-11)	77	96.92	97.11	8.49	1.12	1.57	1.55	8.10	8.03	8.09	63
超長期 (11-)	62	104.65	105.22	14.04	2.73	2.27	2.32	11.70	11.56	11.63	94
BBB 格	1,518	98.13	98.36	4.40	1.19	1.59	1.57	4.11	4.07	4.10	98
短期 (1-3)	655	99.34	99.54	2.17	1.05	1.32	1.32	2.14	2.13	2.14	91
中期 (3-7)	658	98.14	98.35	4.38	1.10	1.57	1.55	4.27	4.24	4.27	96
長期 (7-)	205	94.25	94.64	11.62	1.93	2.57	2.49	10.16	10.03	10.12	132
長期 (7-11)	102	96.79	97.11	8.84	1.72	2.17	2.14	8.18	8.10	8.18	119
超長期 (11-)	103	91.74	92.20	14.36	2.13	2.99	2.87	12.22	12.05	12.15	146
BB 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
B 格以下	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
格付なし	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

出所:NFRC

- 格付は、格付会社4社の最低格付をもとにNFRCで分類

円建外債 R&I 格付別・ポートフォリオ指標 (2024年7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	100.14	100.22	1.93	1.37	1.31	1.31	1.91	1.89	1.91	92
短期 (1-3)	30	100.14	100.22	1.93	1.37	1.31	1.31	1.91	1.89	1.91	92
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AAA~A 格	754	98.76	98.87	3.22	0.98	1.34	1.33	3.15	3.12	3.15	83
短期 (1-3)	408	99.30	99.42	2.20	0.95	1.24	1.23	2.17	2.16	2.17	82
中期 (3-7)	317	98.41	98.52	4.07	1.02	1.44	1.43	3.99	3.96	3.99	85
長期 (7-)	29	95.04	95.12	8.26	0.96	1.66	1.62	7.94	7.88	7.94	73
長期 (7-11)	29	95.04	95.12	8.26	0.96	1.66	1.62	7.94	7.88	7.94	73
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AAA~BBB 格	766	98.59	98.70	3.35	0.99	1.36	1.34	3.25	3.23	3.25	83
短期 (1-3)	408	99.30	99.42	2.20	0.95	1.24	1.23	2.17	2.16	2.17	82
中期 (3-7)	317	98.41	98.52	4.07	1.02	1.44	1.43	3.99	3.96	3.99	85
長期 (7-)	41	92.79	92.91	9.42	1.06	1.94	1.87	8.84	8.75	8.83	87
長期 (7-11)	29	95.04	95.12	8.26	0.96	1.66	1.62	7.94	7.88	7.94	73
超長期 (11-)	11	87.07	87.26	12.36	1.32	2.72	2.55	11.34	11.19	11.31	126
AAA~BB 格	766	98.59	98.70	3.35	0.99	1.36	1.34	3.25	3.23	3.25	83
短期 (1-3)	408	99.30	99.42	2.20	0.95	1.24	1.23	2.17	2.16	2.17	82
中期 (3-7)	317	98.41	98.52	4.07	1.02	1.44	1.43	3.99	3.96	3.99	85
長期 (7-)	41	92.79	92.91	9.42	1.06	1.94	1.87	8.84	8.75	8.83	87
長期 (7-11)	29	95.04	95.12	8.26	0.96	1.66	1.62	7.94	7.88	7.94	73
超長期 (11-)	11	87.07	87.26	12.36	1.32	2.72	2.55	11.34	11.19	11.31	126
AAA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA 格	30	100.14	100.22	1.93	1.37	1.31	1.31	1.91	1.89	1.91	92
短期 (1-3)	30	100.14	100.22	1.93	1.37	1.31	1.31	1.91	1.89	1.91	92
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
A 格	724	98.71	98.82	3.27	0.97	1.34	1.33	3.20	3.18	3.20	82
短期 (1-3)	378	99.24	99.35	2.22	0.92	1.23	1.23	2.19	2.18	2.19	81
中期 (3-7)	317	98.41	98.52	4.07	1.02	1.44	1.43	3.99	3.96	3.99	85
長期 (7-)	29	95.04	95.12	8.26	0.96	1.66	1.62	7.94	7.88	7.94	73
長期 (7-11)	29	95.04	95.12	8.26	0.96	1.66	1.62	7.94	7.88	7.94	73
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
BBB 格	11	87.07	87.26	12.36	1.32	2.72	2.55	11.34	11.19	11.31	126
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	11	87.07	87.26	12.36	1.32	2.72	2.55	11.34	11.19	11.31	126
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	11	87.07	87.26	12.36	1.32	2.72	2.55	11.34	11.19	11.31	126
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	98.93	99.17	4.03	1.08	1.35	1.34	3.80	3.77	3.80	77
短期 (1-3)	1,375	99.58	99.77	2.12	0.93	1.13	1.13	2.09	2.08	2.09	72
中期 (3-7)	1,092	98.62	98.86	4.29	1.01	1.36	1.35	4.19	4.16	4.19	75
長期 (7-)	317	97.23	97.64	11.47	1.96	2.29	2.25	10.05	9.94	10.01	109
長期 (7-11)	163	97.20	97.50	8.73	1.51	1.91	1.88	8.17	8.09	8.16	94
超長期 (11-)	154	97.27	97.80	14.38	2.43	2.70	2.65	12.05	11.89	11.98	125

出所:NFRC

- 格付は、R&Iの格付をもとにNFRCで分類

円建外債 R&I 格付別・ポートフォリオ指標 (2024年7月末、8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	100.14	100.22	1.93	1.37	1.31	1.31	1.91	1.89	1.91	92
短期 (1-3)	30	100.14	100.22	1.93	1.37	1.31	1.31	1.91	1.89	1.91	92
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AAA~A 格	754	98.76	98.87	3.22	0.98	1.34	1.33	3.15	3.12	3.15	83
短期 (1-3)	408	99.30	99.42	2.20	0.95	1.24	1.23	2.17	2.16	2.17	82
中期 (3-7)	317	98.41	98.52	4.07	1.02	1.44	1.43	3.99	3.96	3.99	85
長期 (7-)	29	95.04	95.12	8.26	0.96	1.66	1.62	7.94	7.88	7.94	73
長期 (7-11)	29	95.04	95.12	8.26	0.96	1.66	1.62	7.94	7.88	7.94	73
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AAA~BBB 格	766	98.59	98.70	3.35	0.99	1.36	1.34	3.25	3.23	3.25	83
短期 (1-3)	408	99.30	99.42	2.20	0.95	1.24	1.23	2.17	2.16	2.17	82
中期 (3-7)	317	98.41	98.52	4.07	1.02	1.44	1.43	3.99	3.96	3.99	85
長期 (7-)	41	92.79	92.91	9.42	1.06	1.94	1.87	8.84	8.75	8.83	87
長期 (7-11)	29	95.04	95.12	8.26	0.96	1.66	1.62	7.94	7.88	7.94	73
超長期 (11-)	11	87.07	87.26	12.36	1.32	2.72	2.55	11.34	11.19	11.31	126
AAA~BB 格	766	98.59	98.70	3.35	0.99	1.36	1.34	3.25	3.23	3.25	83
短期 (1-3)	408	99.30	99.42	2.20	0.95	1.24	1.23	2.17	2.16	2.17	82
中期 (3-7)	317	98.41	98.52	4.07	1.02	1.44	1.43	3.99	3.96	3.99	85
長期 (7-)	41	92.79	92.91	9.42	1.06	1.94	1.87	8.84	8.75	8.83	87
長期 (7-11)	29	95.04	95.12	8.26	0.96	1.66	1.62	7.94	7.88	7.94	73
超長期 (11-)	11	87.07	87.26	12.36	1.32	2.72	2.55	11.34	11.19	11.31	126
AAA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA 格	30	100.14	100.22	1.93	1.37	1.31	1.31	1.91	1.89	1.91	92
短期 (1-3)	30	100.14	100.22	1.93	1.37	1.31	1.31	1.91	1.89	1.91	92
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
A 格	724	98.71	98.82	3.27	0.97	1.34	1.33	3.20	3.18	3.20	82
短期 (1-3)	378	99.24	99.35	2.22	0.92	1.23	1.23	2.19	2.18	2.19	81
中期 (3-7)	317	98.41	98.52	4.07	1.02	1.44	1.43	3.99	3.96	3.99	85
長期 (7-)	29	95.04	95.12	8.26	0.96	1.66	1.62	7.94	7.88	7.94	73
長期 (7-11)	29	95.04	95.12	8.26	0.96	1.66	1.62	7.94	7.88	7.94	73
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
BBB 格	11	87.07	87.26	12.36	1.32	2.72	2.55	11.34	11.19	11.31	126
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	11	87.07	87.26	12.36	1.32	2.72	2.55	11.34	11.19	11.31	126
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	11	87.07	87.26	12.36	1.32	2.72	2.55	11.34	11.19	11.31	126
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	2,885	98.96	99.19	4.00	1.07	1.33	1.32	3.78	3.75	3.77	76
短期 (1-3)	1,465	99.58	99.76	2.16	0.92	1.12	1.11	2.14	2.13	2.14	70
中期 (3-7)	1,103	98.64	98.87	4.29	1.01	1.35	1.34	4.19	4.16	4.19	75
長期 (7-)	317	97.23	97.64	11.47	1.96	2.29	2.25	10.05	9.94	10.01	109
長期 (7-11)	163	97.20	97.50	8.73	1.51	1.91	1.88	8.17	8.09	8.16	94
超長期 (11-)	154	97.27	97.80	14.38	2.43	2.70	2.65	12.05	11.89	11.98	125

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7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	255	99.10	99.18	3.39	1.04	1.29	1.28	3.28	3.26	3.28	76
短期 (1-3)	160	99.61	99.67	2.26	0.96	1.16	1.15	2.23	2.22	2.23	73
中期 (3-7)	73	98.90	99.01	4.17	1.12	1.40	1.39	4.08	4.05	4.08	81
長期 (7-)	22	96.10	96.24	9.05	1.36	1.89	1.86	8.38	8.30	8.36	90
長期 (7-11)	18	96.15	96.31	7.85	1.21	1.78	1.75	7.49	7.42	7.48	89
超長期 (11-)	4	95.85	95.92	14.17	1.99	2.38	2.34	12.22	12.08	12.16	94
AAA~A 格	994	98.53	98.80	4.53	1.33	1.66	1.64	4.16	4.12	4.15	104
短期 (1-3)	521	99.65	99.87	2.18	1.16	1.34	1.34	2.16	2.14	2.16	92
中期 (3-7)	288	97.68	97.95	4.09	1.10	1.69	1.67	3.99	3.96	3.99	109
長期 (7-)	186	96.69	97.13	11.78	2.14	2.55	2.50	10.22	10.09	10.18	131
長期 (7-11)	73	95.84	96.17	8.42	1.62	2.22	2.18	7.83	7.75	7.83	127
超長期 (11-)	113	97.23	97.75	13.94	2.48	2.76	2.70	11.73	11.57	11.66	133
AAA~BBB 格	995	98.52	98.80	4.53	1.33	1.66	1.65	4.16	4.12	4.16	104
短期 (1-3)	521	99.65	99.87	2.18	1.16	1.34	1.34	2.16	2.14	2.16	92
中期 (3-7)	289	97.66	97.93	4.10	1.10	1.69	1.67	4.00	3.96	4.00	109
長期 (7-)	186	96.69	97.13	11.78	2.14	2.55	2.50	10.22	10.09	10.18	131
長期 (7-11)	73	95.84	96.17	8.42	1.62	2.22	2.18	7.83	7.75	7.83	127
超長期 (11-)	113	97.23	97.75	13.94	2.48	2.76	2.70	11.73	11.57	11.66	133
AAA~BB 格	995	98.52	98.80	4.53	1.33	1.66	1.65	4.16	4.12	4.16	104
短期 (1-3)	521	99.65	99.87	2.18	1.16	1.34	1.34	2.16	2.14	2.16	92
中期 (3-7)	289	97.66	97.93	4.10	1.10	1.69	1.67	4.00	3.96	4.00	109
長期 (7-)	186	96.69	97.13	11.78	2.14	2.55	2.50	10.22	10.09	10.18	131
長期 (7-11)	73	95.84	96.17	8.42	1.62	2.22	2.18	7.83	7.75	7.83	127
超長期 (11-)	113	97.23	97.75	13.94	2.48	2.76	2.70	11.73	11.57	11.66	133
AAA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA 格	255	99.10	99.18	3.39	1.04	1.29	1.28	3.28	3.26	3.28	76
短期 (1-3)	160	99.61	99.67	2.26	0.96	1.16	1.15	2.23	2.22	2.23	73
中期 (3-7)	73	98.90	99.01	4.17	1.12	1.40	1.39	4.08	4.05	4.08	81
長期 (7-)	22	96.10	96.24	9.05	1.36	1.89	1.86	8.38	8.30	8.36	90
長期 (7-11)	18	96.15	96.31	7.85	1.21	1.78	1.75	7.49	7.42	7.48	89
超長期 (11-)	4	95.85	95.92	14.17	1.99	2.38	2.34	12.22	12.08	12.16	94
A 格	739	98.33	98.67	4.92	1.43	1.79	1.77	4.47	4.42	4.46	114
短期 (1-3)	361	99.67	99.96	2.15	1.25	1.42	1.42	2.12	2.11	2.12	101
中期 (3-7)	215	97.27	97.59	4.07	1.10	1.79	1.76	3.96	3.93	3.96	119
長期 (7-)	163	96.77	97.25	12.15	2.25	2.64	2.59	10.47	10.33	10.42	136
長期 (7-11)	55	95.73	96.13	8.61	1.75	2.37	2.32	7.95	7.86	7.94	140
超長期 (11-)	109	97.28	97.82	13.93	2.50	2.77	2.72	11.71	11.55	11.65	134
BBB 格	1	92.90	93.28	5.14	1.05	2.62	2.53	4.99	4.93	4.99	189
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	1	92.90	93.28	5.14	1.05	2.62	2.53	4.99	4.93	4.99	189
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	2,554	98.99	99.17	3.64	0.95	1.23	1.22	3.50	3.48	3.50	69
短期 (1-3)	1,262	99.46	99.61	2.11	0.84	1.08	1.07	2.09	2.08	2.09	67
中期 (3-7)	1,120	98.81	99.00	4.27	0.99	1.29	1.29	4.18	4.15	4.18	69
長期 (7-)	172	96.78	97.08	10.65	1.54	1.93	1.90	9.59	9.50	9.56	81
長期 (7-11)	120	97.49	97.73	8.81	1.31	1.66	1.65	8.31	8.24	8.30	70
超長期 (11-)	52	95.13	95.59	14.90	2.08	2.57	2.51	12.63	12.47	12.55	107

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7月末、8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	255	99.10	99.18	3.39	1.04	1.29	1.28	3.28	3.26	3.28	76
短期 (1-3)	160	99.61	99.67	2.26	0.96	1.16	1.15	2.23	2.22	2.23	73
中期 (3-7)	73	98.90	99.01	4.17	1.12	1.40	1.39	4.08	4.05	4.08	81
長期 (7-)	22	96.10	96.24	9.05	1.36	1.89	1.86	8.38	8.30	8.36	90
長期 (7-11)	18	96.15	96.31	7.85	1.21	1.78	1.75	7.49	7.42	7.48	89
超長期 (11-)	4	95.85	95.92	14.17	1.99	2.38	2.34	12.22	12.08	12.16	94
AAA~A 格	994	98.53	98.80	4.53	1.33	1.66	1.64	4.16	4.12	4.15	104
短期 (1-3)	521	99.65	99.87	2.18	1.16	1.34	1.34	2.16	2.14	2.16	92
中期 (3-7)	288	97.68	97.95	4.09	1.10	1.69	1.67	3.99	3.96	3.99	109
長期 (7-)	186	96.69	97.13	11.78	2.14	2.55	2.50	10.22	10.09	10.18	131
長期 (7-11)	73	95.84	96.17	8.42	1.62	2.22	2.18	7.83	7.75	7.83	127
超長期 (11-)	113	97.23	97.75	13.94	2.48	2.76	2.70	11.73	11.57	11.66	133
AAA~BBB 格	995	98.52	98.80	4.53	1.33	1.66	1.65	4.16	4.12	4.16	104
短期 (1-3)	521	99.65	99.87	2.18	1.16	1.34	1.34	2.16	2.14	2.16	92
中期 (3-7)	289	97.66	97.93	4.10	1.10	1.69	1.67	4.00	3.96	4.00	109
長期 (7-)	186	96.69	97.13	11.78	2.14	2.55	2.50	10.22	10.09	10.18	131
長期 (7-11)	73	95.84	96.17	8.42	1.62	2.22	2.18	7.83	7.75	7.83	127
超長期 (11-)	113	97.23	97.75	13.94	2.48	2.76	2.70	11.73	11.57	11.66	133
AAA~BB 格	995	98.52	98.80	4.53	1.33	1.66	1.65	4.16	4.12	4.16	104
短期 (1-3)	521	99.65	99.87	2.18	1.16	1.34	1.34	2.16	2.14	2.16	92
中期 (3-7)	289	97.66	97.93	4.10	1.10	1.69	1.67	4.00	3.96	4.00	109
長期 (7-)	186	96.69	97.13	11.78	2.14	2.55	2.50	10.22	10.09	10.18	131
長期 (7-11)	73	95.84	96.17	8.42	1.62	2.22	2.18	7.83	7.75	7.83	127
超長期 (11-)	113	97.23	97.75	13.94	2.48	2.76	2.70	11.73	11.57	11.66	133
AAA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA 格	255	99.10	99.18	3.39	1.04	1.29	1.28	3.28	3.26	3.28	76
短期 (1-3)	160	99.61	99.67	2.26	0.96	1.16	1.15	2.23	2.22	2.23	73
中期 (3-7)	73	98.90	99.01	4.17	1.12	1.40	1.39	4.08	4.05	4.08	81
長期 (7-)	22	96.10	96.24	9.05	1.36	1.89	1.86	8.38	8.30	8.36	90
長期 (7-11)	18	96.15	96.31	7.85	1.21	1.78	1.75	7.49	7.42	7.48	89
超長期 (11-)	4	95.85	95.92	14.17	1.99	2.38	2.34	12.22	12.08	12.16	94
A 格	739	98.33	98.67	4.92	1.43	1.79	1.77	4.47	4.42	4.46	114
短期 (1-3)	361	99.67	99.96	2.15	1.25	1.42	1.42	2.12	2.11	2.12	101
中期 (3-7)	215	97.27	97.59	4.07	1.10	1.79	1.76	3.96	3.93	3.96	119
長期 (7-)	163	96.77	97.25	12.15	2.25	2.64	2.59	10.47	10.33	10.42	136
長期 (7-11)	55	95.73	96.13	8.61	1.75	2.37	2.32	7.95	7.86	7.94	140
超長期 (11-)	109	97.28	97.82	13.93	2.50	2.77	2.72	11.71	11.55	11.65	134
BBB 格	1	92.90	93.28	5.14	1.05	2.62	2.53	4.99	4.93	4.99	189
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	1	92.90	93.28	5.14	1.05	2.62	2.53	4.99	4.93	4.99	189
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	2,655	99.02	99.19	3.62	0.95	1.22	1.21	3.49	3.46	3.48	68
短期 (1-3)	1,352	99.47	99.62	2.17	0.84	1.07	1.07	2.15	2.13	2.15	65
中期 (3-7)	1,131	98.82	99.01	4.28	0.99	1.29	1.28	4.19	4.16	4.18	69
長期 (7-)	172	96.78	97.08	10.65	1.54	1.93	1.90	9.59	9.50	9.56	81
長期 (7-11)	120	97.49	97.73	8.81	1.31	1.66	1.65	8.31	8.24	8.30	70
超長期 (11-)	52	95.13	95.59	14.90	2.08	2.57	2.51	12.63	12.47	12.55	107

出所:NFRC

- 格付は、JCR の格付をもとに NFRC で分類

円建外債 Moody's 格付別・ポートフォリオ指標 (2024年7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	1,185	99.16	99.34	3.24	0.78	1.05	1.05	3.17	3.16	3.17	55
短期 (1-3)	575	99.48	99.60	1.91	0.64	0.91	0.90	1.90	1.89	1.90	52
中期 (3-7)	554	99.00	99.23	4.10	0.90	1.16	1.15	4.02	3.99	4.02	57
長期 (7-)	56	97.40	97.66	8.49	1.07	1.46	1.44	8.10	8.05	8.10	52
長期 (7-11)	56	97.40	97.66	8.49	1.07	1.46	1.44	8.10	8.05	8.10	52
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AAA~A 格	2,106	99.39	99.59	3.53	0.97	1.17	1.17	3.41	3.38	3.40	64
短期 (1-3)	1,148	99.65	99.82	2.10	0.87	1.03	1.03	2.08	2.07	2.08	62
中期 (3-7)	790	98.89	99.10	4.09	0.94	1.22	1.22	4.01	3.99	4.01	64
長期 (7-)	168	99.95	100.35	10.68	1.79	1.89	1.90	9.57	9.48	9.54	79
長期 (7-11)	96	96.90	97.12	8.49	1.10	1.55	1.53	8.09	8.03	8.09	61
超長期 (11-)	72	104.06	104.69	13.64	2.72	2.32	2.36	11.42	11.28	11.36	101
AAA~BBB 格	3,289	98.91	99.11	3.98	1.04	1.31	1.30	3.77	3.74	3.77	74
短期 (1-3)	1,586	99.59	99.75	2.14	0.89	1.08	1.07	2.12	2.11	2.12	66
中期 (3-7)	1,354	98.65	98.85	4.24	1.01	1.35	1.34	4.15	4.12	4.15	75
長期 (7-)	350	96.82	97.20	11.32	1.87	2.25	2.21	9.98	9.86	9.94	106
長期 (7-11)	185	97.05	97.31	8.71	1.44	1.86	1.83	8.17	8.10	8.16	89
超長期 (11-)	165	96.57	97.07	14.24	2.36	2.70	2.64	12.01	11.85	11.94	125
AAA~BB 格	3,289	98.91	99.11	3.98	1.04	1.31	1.30	3.77	3.74	3.77	74
短期 (1-3)	1,586	99.59	99.75	2.14	0.89	1.08	1.07	2.12	2.11	2.12	66
中期 (3-7)	1,354	98.65	98.85	4.24	1.01	1.35	1.34	4.15	4.12	4.15	75
長期 (7-)	350	96.82	97.20	11.32	1.87	2.25	2.21	9.98	9.86	9.94	106
長期 (7-11)	185	97.05	97.31	8.71	1.44	1.86	1.83	8.17	8.10	8.16	89
超長期 (11-)	165	96.57	97.07	14.24	2.36	2.70	2.64	12.01	11.85	11.94	125
AAA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA 格	1,185	99.16	99.34	3.24	0.78	1.05	1.05	3.17	3.16	3.17	55
短期 (1-3)	575	99.48	99.60	1.91	0.64	0.91	0.90	1.90	1.89	1.90	52
中期 (3-7)	554	99.00	99.23	4.10	0.90	1.16	1.15	4.02	3.99	4.02	57
長期 (7-)	56	97.40	97.66	8.49	1.07	1.46	1.44	8.10	8.05	8.10	52
長期 (7-11)	56	97.40	97.66	8.49	1.07	1.46	1.44	8.10	8.05	8.10	52
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
A 格	921	99.69	99.91	3.91	1.21	1.32	1.32	3.70	3.67	3.69	76
短期 (1-3)	573	99.82	100.03	2.30	1.10	1.15	1.15	2.27	2.26	2.27	71
中期 (3-7)	236	98.65	98.78	4.08	1.04	1.37	1.36	4.00	3.97	4.00	78
長期 (7-)	112	101.23	101.69	11.78	2.15	2.10	2.11	10.28	10.17	10.24	92
長期 (7-11)	40	96.20	96.36	8.48	1.13	1.68	1.65	8.08	8.01	8.07	73
超長期 (11-)	72	104.06	104.69	13.64	2.72	2.32	2.36	11.42	11.28	11.36	101
BBB 格	1,183	98.06	98.26	4.78	1.17	1.57	1.55	4.44	4.40	4.43	92
短期 (1-3)	438	99.45	99.59	2.25	0.93	1.21	1.20	2.22	2.21	2.22	78
中期 (3-7)	564	98.32	98.52	4.46	1.11	1.53	1.52	4.34	4.31	4.34	91
長期 (7-)	182	93.92	94.28	11.91	1.94	2.61	2.53	10.38	10.24	10.33	133
長期 (7-11)	88	97.21	97.52	8.95	1.80	2.19	2.16	8.25	8.16	8.24	120
超長期 (11-)	93	90.81	91.21	14.70	2.07	3.03	2.90	12.53	12.35	12.45	146
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	260	98.21	98.51	2.65	1.26	1.83	1.81	2.58	2.56	2.58	137
短期 (1-3)	197	98.88	99.14	2.06	1.31	1.77	1.76	2.03	2.01	2.03	137
中期 (3-7)	55	96.61	96.97	4.09	1.09	1.98	1.95	3.98	3.94	3.98	137
長期 (7-)	8	92.70	93.20	7.57	1.15	2.28	2.20	7.22	7.14	7.22	137
長期 (7-11)	8	92.70	93.20	7.57	1.15	2.28	2.20	7.22	7.14	7.22	137
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

出所:NFRC

- 格付は、Moody's の格付をもとに NFRC で分類

円建外債 Moody's 格付別・ポートフォリオ指標 (2024年7月末、8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	1,287	99.20	99.37	3.23	0.79	1.04	1.04	3.17	3.15	3.17	54
短期 (1-3)	665	99.50	99.61	2.04	0.66	0.91	0.91	2.03	2.02	2.03	51
中期 (3-7)	566	99.02	99.24	4.11	0.91	1.16	1.15	4.03	4.01	4.03	57
長期 (7-)	56	97.40	97.66	8.49	1.07	1.46	1.44	8.10	8.05	8.10	52
長期 (7-11)	56	97.40	97.66	8.49	1.07	1.46	1.44	8.10	8.05	8.10	52
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AAA~A 格	2,208	99.40	99.60	3.52	0.97	1.16	1.16	3.39	3.37	3.39	63
短期 (1-3)	1,238	99.65	99.81	2.16	0.87	1.02	1.02	2.14	2.13	2.14	61
中期 (3-7)	801	98.91	99.11	4.10	0.95	1.22	1.21	4.02	4.00	4.02	63
長期 (7-)	168	99.95	100.35	10.68	1.79	1.89	1.90	9.57	9.48	9.54	79
長期 (7-11)	96	96.90	97.12	8.49	1.10	1.55	1.53	8.09	8.03	8.09	61
超長期 (11-)	72	104.06	104.69	13.64	2.72	2.32	2.36	11.42	11.28	11.36	101
AAA~BBB 格	3,391	98.93	99.13	3.96	1.04	1.30	1.29	3.75	3.72	3.75	73
短期 (1-3)	1,676	99.59	99.75	2.18	0.88	1.07	1.07	2.16	2.15	2.16	65
中期 (3-7)	1,365	98.66	98.86	4.25	1.01	1.35	1.34	4.15	4.13	4.15	75
長期 (7-)	350	96.82	97.20	11.32	1.87	2.25	2.21	9.98	9.86	9.94	106
長期 (7-11)	185	97.05	97.31	8.71	1.44	1.86	1.83	8.17	8.10	8.16	89
超長期 (11-)	165	96.57	97.07	14.24	2.36	2.70	2.64	12.01	11.85	11.94	125
AAA~BB 格	3,391	98.93	99.13	3.96	1.04	1.30	1.29	3.75	3.72	3.75	73
短期 (1-3)	1,676	99.59	99.75	2.18	0.88	1.07	1.07	2.16	2.15	2.16	65
中期 (3-7)	1,365	98.66	98.86	4.25	1.01	1.35	1.34	4.15	4.13	4.15	75
長期 (7-)	350	96.82	97.20	11.32	1.87	2.25	2.21	9.98	9.86	9.94	106
長期 (7-11)	185	97.05	97.31	8.71	1.44	1.86	1.83	8.17	8.10	8.16	89
超長期 (11-)	165	96.57	97.07	14.24	2.36	2.70	2.64	12.01	11.85	11.94	125
AAA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA 格	1,287	99.20	99.37	3.23	0.79	1.04	1.04	3.17	3.15	3.17	54
短期 (1-3)	665	99.50	99.61	2.04	0.66	0.91	0.91	2.03	2.02	2.03	51
中期 (3-7)	566	99.02	99.24	4.11	0.91	1.16	1.15	4.03	4.01	4.03	57
長期 (7-)	56	97.40	97.66	8.49	1.07	1.46	1.44	8.10	8.05	8.10	52
長期 (7-11)	56	97.40	97.66	8.49	1.07	1.46	1.44	8.10	8.05	8.10	52
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
A 格	921	99.69	99.91	3.91	1.21	1.32	1.32	3.70	3.67	3.69	76
短期 (1-3)	573	99.82	100.03	2.30	1.10	1.15	1.15	2.27	2.26	2.27	71
中期 (3-7)	236	98.65	98.78	4.08	1.04	1.37	1.36	4.00	3.97	4.00	78
長期 (7-)	112	101.23	101.69	11.78	2.15	2.10	2.11	10.28	10.17	10.24	92
長期 (7-11)	40	96.20	96.36	8.48	1.13	1.68	1.65	8.08	8.01	8.07	73
超長期 (11-)	72	104.06	104.69	13.64	2.72	2.32	2.36	11.42	11.28	11.36	101
BBB 格	1,183	98.06	98.26	4.78	1.17	1.57	1.55	4.44	4.40	4.43	92
短期 (1-3)	438	99.45	99.59	2.25	0.93	1.21	1.20	2.22	2.21	2.22	78
中期 (3-7)	564	98.32	98.52	4.46	1.11	1.53	1.52	4.34	4.31	4.34	91
長期 (7-)	182	93.92	94.28	11.91	1.94	2.61	2.53	10.38	10.24	10.33	133
長期 (7-11)	88	97.21	97.52	8.95	1.80	2.19	2.16	8.25	8.16	8.24	120
超長期 (11-)	93	90.81	91.21	14.70	2.07	3.03	2.90	12.53	12.35	12.45	146
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	260	98.21	98.51	2.65	1.26	1.83	1.81	2.58	2.56	2.58	137
短期 (1-3)	197	98.88	99.14	2.06	1.31	1.77	1.76	2.03	2.01	2.03	137
中期 (3-7)	55	96.61	96.97	4.09	1.09	1.98	1.95	3.98	3.94	3.98	137
長期 (7-)	8	92.70	93.20	7.57	1.15	2.28	2.20	7.22	7.14	7.22	137
長期 (7-11)	8	92.70	93.20	7.57	1.15	2.28	2.20	7.22	7.14	7.22	137
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

出所:NFRC

- 格付は、Moody's の格付をもとに NFRC で分類

円建外債 S&P 格付別・ポートフォリオ指標 (2024年7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	98.96	99.11	3.37	0.73	1.03	1.02	3.30	3.29	3.30	51
短期 (1-3)	122	99.51	99.63	2.05	0.69	0.93	0.93	2.03	2.02	2.03	52
中期 (3-7)	98	98.54	98.67	4.33	0.74	1.11	1.10	4.26	4.24	4.26	51
長期 (7-)	14	97.19	97.57	8.29	0.94	1.36	1.34	7.96	7.91	7.96	44
長期 (7-11)	14	97.19	97.57	8.29	0.94	1.36	1.34	7.96	7.91	7.96	44
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AAA~A 格	2,015	99.39	99.58	3.53	0.95	1.16	1.16	3.41	3.38	3.40	63
短期 (1-3)	1,090	99.62	99.78	2.14	0.84	1.02	1.02	2.12	2.11	2.12	61
中期 (3-7)	775	98.91	99.12	4.08	0.94	1.21	1.21	4.00	3.98	4.00	63
長期 (7-)	150	100.19	100.55	10.77	1.78	1.85	1.86	9.64	9.55	9.61	74
長期 (7-11)	88	97.07	97.29	8.49	1.11	1.54	1.52	8.09	8.03	8.09	60
超長期 (11-)	62	104.65	105.22	14.04	2.73	2.27	2.32	11.70	11.56	11.63	94
AAA~BBB 格	3,474	98.86	99.07	3.92	1.05	1.34	1.33	3.72	3.69	3.71	77
短期 (1-3)	1,723	99.51	99.69	2.15	0.91	1.13	1.13	2.13	2.11	2.13	71
中期 (3-7)	1,396	98.58	98.79	4.24	1.02	1.37	1.36	4.14	4.12	4.14	77
長期 (7-)	355	96.76	97.13	11.26	1.86	2.26	2.22	9.93	9.82	9.90	107
長期 (7-11)	190	96.92	97.19	8.68	1.44	1.88	1.85	8.14	8.07	8.13	91
超長期 (11-)	165	96.57	97.07	14.24	2.36	2.70	2.64	12.01	11.85	11.94	125
AAA~BB 格	3,474	98.86	99.07	3.92	1.05	1.34	1.33	3.72	3.69	3.71	77
短期 (1-3)	1,723	99.51	99.69	2.15	0.91	1.13	1.13	2.13	2.11	2.13	71
中期 (3-7)	1,396	98.58	98.79	4.24	1.02	1.37	1.36	4.14	4.12	4.14	77
長期 (7-)	355	96.76	97.13	11.26	1.86	2.26	2.22	9.93	9.82	9.90	107
長期 (7-11)	190	96.92	97.19	8.68	1.44	1.88	1.85	8.14	8.07	8.13	91
超長期 (11-)	165	96.57	97.07	14.24	2.36	2.70	2.64	12.01	11.85	11.94	125
AAA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA 格	233	98.96	99.11	3.37	0.73	1.03	1.02	3.30	3.29	3.30	51
短期 (1-3)	122	99.51	99.63	2.05	0.69	0.93	0.93	2.03	2.02	2.03	52
中期 (3-7)	98	98.54	98.67	4.33	0.74	1.11	1.10	4.26	4.24	4.26	51
長期 (7-)	14	97.19	97.57	8.29	0.94	1.36	1.34	7.96	7.91	7.96	44
長期 (7-11)	14	97.19	97.57	8.29	0.94	1.36	1.34	7.96	7.91	7.96	44
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
A 格	1,782	99.44	99.64	3.55	0.98	1.17	1.17	3.42	3.40	3.42	64
短期 (1-3)	968	99.63	99.80	2.15	0.86	1.03	1.03	2.13	2.12	2.13	62
中期 (3-7)	678	98.96	99.18	4.05	0.97	1.23	1.22	3.97	3.94	3.97	65
長期 (7-)	136	100.49	100.85	11.02	1.86	1.90	1.91	9.81	9.71	9.77	77
長期 (7-11)	75	97.05	97.24	8.52	1.14	1.57	1.55	8.12	8.05	8.11	62
超長期 (11-)	62	104.65	105.22	14.04	2.73	2.27	2.32	11.70	11.56	11.63	94
BBB 格	1,458	98.13	98.35	4.46	1.19	1.59	1.57	4.15	4.11	4.15	98
短期 (1-3)	632	99.34	99.53	2.16	1.03	1.31	1.31	2.13	2.12	2.13	90
中期 (3-7)	621	98.18	98.38	4.44	1.12	1.57	1.56	4.32	4.29	4.32	96
長期 (7-)	205	94.25	94.64	11.62	1.93	2.57	2.49	10.16	10.03	10.12	132
長期 (7-11)	102	96.79	97.11	8.84	1.72	2.17	2.14	8.18	8.10	8.18	119
超長期 (11-)	103	91.74	92.20	14.36	2.13	2.99	2.87	12.22	12.05	12.15	146
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	75	98.95	99.15	2.30	1.41	1.79	1.78	2.25	2.23	2.25	137
短期 (1-3)	61	99.47	99.67	1.77	1.53	1.84	1.83	1.74	1.73	1.74	147
中期 (3-7)	13	97.55	97.80	3.98	0.97	1.58	1.57	3.90	3.87	3.90	100
長期 (7-)	2	92.55	92.80	7.52	0.51	1.62	1.57	7.36	7.30	7.35	74
長期 (7-11)	2	92.55	92.80	7.52	0.51	1.62	1.57	7.36	7.30	7.35	74
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

出所:NFRC

- 格付は、S&P の格付をもとに NFRC で分類

円建外債 S&P 格付別・ポートフォリオ指標 (2024年7月末、8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	293	99.08	99.21	3.27	0.74	1.02	1.01	3.21	3.20	3.21	50
短期 (1-3)	182	99.52	99.62	2.33	0.73	0.94	0.94	2.31	2.30	2.31	51
中期 (3-7)	98	98.54	98.67	4.33	0.74	1.11	1.10	4.26	4.24	4.26	51
長期 (7-)	14	97.19	97.57	8.29	0.94	1.36	1.34	7.96	7.91	7.96	44
長期 (7-11)	14	97.19	97.57	8.29	0.94	1.36	1.34	7.96	7.91	7.96	44
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AAA~A 格	2,117	99.40	99.59	3.51	0.94	1.15	1.15	3.39	3.37	3.39	62
短期 (1-3)	1,180	99.62	99.77	2.20	0.84	1.02	1.02	2.18	2.17	2.18	60
中期 (3-7)	787	98.92	99.13	4.09	0.94	1.21	1.21	4.01	3.99	4.01	63
長期 (7-)	150	100.19	100.55	10.77	1.78	1.85	1.86	9.64	9.55	9.61	74
長期 (7-11)	88	97.07	97.29	8.49	1.11	1.54	1.52	8.09	8.03	8.09	60
超長期 (11-)	62	104.65	105.22	14.04	2.73	2.27	2.32	11.70	11.56	11.63	94
AAA~BBB 格	3,575	98.88	99.08	3.90	1.05	1.33	1.32	3.70	3.67	3.70	76
短期 (1-3)	1,813	99.52	99.69	2.19	0.91	1.12	1.12	2.16	2.15	2.16	70
中期 (3-7)	1,407	98.59	98.80	4.24	1.02	1.37	1.36	4.15	4.12	4.15	77
長期 (7-)	355	96.76	97.13	11.26	1.86	2.26	2.22	9.93	9.82	9.90	107
長期 (7-11)	190	96.92	97.19	8.68	1.44	1.88	1.85	8.14	8.07	8.13	91
超長期 (11-)	165	96.57	97.07	14.24	2.36	2.70	2.64	12.01	11.85	11.94	125
AAA~BB 格	3,575	98.88	99.08	3.90	1.05	1.33	1.32	3.70	3.67	3.70	76
短期 (1-3)	1,813	99.52	99.69	2.19	0.91	1.12	1.12	2.16	2.15	2.16	70
中期 (3-7)	1,407	98.59	98.80	4.24	1.02	1.37	1.36	4.15	4.12	4.15	77
長期 (7-)	355	96.76	97.13	11.26	1.86	2.26	2.22	9.93	9.82	9.90	107
長期 (7-11)	190	96.92	97.19	8.68	1.44	1.88	1.85	8.14	8.07	8.13	91
超長期 (11-)	165	96.57	97.07	14.24	2.36	2.70	2.64	12.01	11.85	11.94	125
AAA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA 格	293	99.08	99.21	3.27	0.74	1.02	1.01	3.21	3.20	3.21	50
短期 (1-3)	182	99.52	99.62	2.33	0.73	0.94	0.94	2.31	2.30	2.31	51
中期 (3-7)	98	98.54	98.67	4.33	0.74	1.11	1.10	4.26	4.24	4.26	51
長期 (7-)	14	97.19	97.57	8.29	0.94	1.36	1.34	7.96	7.91	7.96	44
長期 (7-11)	14	97.19	97.57	8.29	0.94	1.36	1.34	7.96	7.91	7.96	44
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
A 格	1,824	99.45	99.65	3.55	0.98	1.17	1.17	3.42	3.40	3.42	64
短期 (1-3)	998	99.64	99.80	2.18	0.86	1.03	1.03	2.15	2.14	2.15	61
中期 (3-7)	689	98.98	99.19	4.06	0.97	1.23	1.22	3.98	3.95	3.98	64
長期 (7-)	136	100.49	100.85	11.02	1.86	1.90	1.91	9.81	9.71	9.77	77
長期 (7-11)	75	97.05	97.24	8.52	1.14	1.57	1.55	8.12	8.05	8.11	62
超長期 (11-)	62	104.65	105.22	14.04	2.73	2.27	2.32	11.70	11.56	11.63	94
BBB 格	1,458	98.13	98.35	4.46	1.19	1.59	1.57	4.15	4.11	4.15	98
短期 (1-3)	632	99.34	99.53	2.16	1.03	1.31	1.31	2.13	2.12	2.13	90
中期 (3-7)	621	98.18	98.38	4.44	1.12	1.57	1.56	4.32	4.29	4.32	96
長期 (7-)	205	94.25	94.64	11.62	1.93	2.57	2.49	10.16	10.03	10.12	132
長期 (7-11)	102	96.79	97.11	8.84	1.72	2.17	2.14	8.18	8.10	8.18	119
超長期 (11-)	103	91.74	92.20	14.36	2.13	2.99	2.87	12.22	12.05	12.15	146
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	75	98.95	99.15	2.30	1.41	1.79	1.78	2.25	2.23	2.25	137
短期 (1-3)	61	99.47	99.67	1.77	1.53	1.84	1.83	1.74	1.73	1.74	147
中期 (3-7)	13	97.55	97.80	3.98	0.97	1.58	1.57	3.90	3.87	3.90	100
長期 (7-)	2	92.55	92.80	7.52	0.51	1.62	1.57	7.36	7.30	7.35	74
長期 (7-11)	2	92.55	92.80	7.52	0.51	1.62	1.57	7.36	7.30	7.35	74
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

出所:NFRC

- 格付は、S&P の格付をもとに NFRC で分類

NOMURA-BPI/Extended 総合・ポートフォリオ指標の推移

	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7月末
銘柄数	14,003	14,825	15,436	15,639	16,113	16,204
額面(10億円)	972,326	1,018,210	1,056,757	1,085,263	1,124,834	1,138,128
時価単価(円)	108.39	106.48	104.19	101.51	98.40	95.54
利含単価(円)	108.52	106.59	104.30	101.61	98.50	95.74
残存年数(年)	9.84	9.89	10.01	10.16	10.21	10.18
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	1.05
複利(%)	0.08	0.14	0.27	0.43	0.72	1.02
Dur(年)	9.47	9.36	9.31	9.18	8.93	8.66
M-Dur	9.46	9.34	9.29	9.15	8.88	8.60
E-Dur	9.45	9.33	9.29	9.15	8.89	8.62
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6月の月末営業日から2024年7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7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7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6月の月末営業日から2024年7月の月末営業日までの投資収益率(年率換算,%)
- 2024年6月の月末営業日において、7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7月ポートフォリオの、右ページには8月ポートフォリオの、2024年7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7月末(暦上)における残存年数(至最終償還日)で区分。ただし8月ポートフォリオでは、2024年8月末(暦上)における残存年数(至最終償還日)で区分。
- NOMURA-BPIは、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社の商標または登録商標です。

NOMURA-BPI/Extended のデータ提供について

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

Quick-IS

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

REUTERS

NMSBPI メニュー

Bloomberg

NBPI(GO) メニュー

時事通信社

BPIXG/12400

NFRC Web ページ

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

ディスクレイマー

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

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

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

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

「インデックス・ライセンスについて」

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

本資料は、お客様への情報提供を目的として、NFRC が作成したものです。

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

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

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

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

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

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

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