

#### 月間投資収益率 (2024年9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 362.589	3.32	2.50	0.81	-2.23	-2.17

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(%)

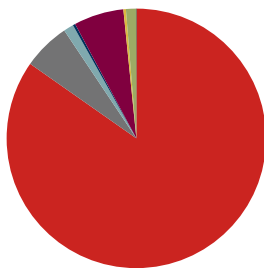
#### ポートフォリオ指標 (2024年9月末)

	翌月ポート (2024年10月)	当月ポート (2024年9月)	差
額面[兆円]	1146.48	1138.20	8.29
デュレーション[年]	8.81	8.78	0.02
修正デュレーション	8.75	8.72	0.02
時価単価[円]	96.83	96.80	0.03
利含単価[円]	96.94	96.92	0.03
残存年数[年]	10.27	10.24	0.03
利率[%]	0.81	0.81	0.00
単利[%]	0.92	0.92	0.00
複利[%]	0.90	0.89	0.00
Tスプレッド[bp]	4	4	0

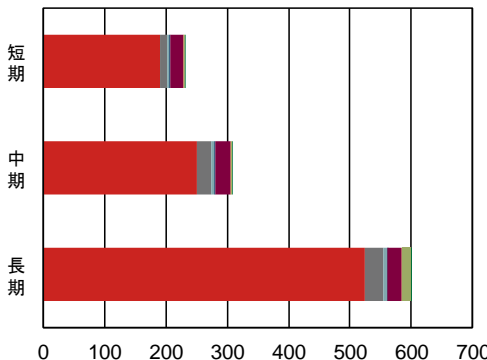
出所: NFRC

(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9月末)



#### 残存別額面構成 (2024年9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	84.7%	5.9%	1.2%	0.3%	6.2%	0.3%	1.2%	0.1%
全体	964.49	66.95	14.22	3.44	70.84	3.58	14.02	0.66
短期	189.67	12.79	3.31	2.00	21.18	1.84	-	0.19
中期	249.79	24.57	4.31	1.27	26.05	1.38	-	0.29
長期	525.03	29.59	6.61	0.17	23.61	0.36	14.02	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9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	362.589	3.32	2.50	0.81	-2.23	-2.17
国債	372.840	3.50	2.66	0.84	-2.44	-2.38
地方債	389.729	2.35	1.74	0.61	-0.94	-1.00
政保債	364.301	2.84	2.09	0.75	-1.86	-1.62
金融債	273.331	0.80	0.50	0.30	-0.07	-0.37
事業債	384.980	2.20	1.44	0.76	-1.12	-0.81
円建外債	394.456	1.37	0.32	1.05	1.45	1.41
MBS	124.344	2.80	2.15	0.65	-1.56	-1.58
ABS	113.867	2.60	1.86	0.74	-0.01	-0.36

出所:NFRC

投資収益率は年率換算(%)

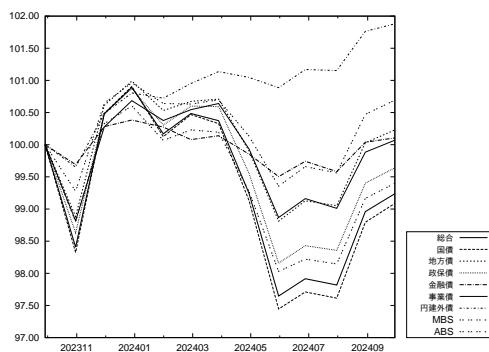
銘柄別・累積投資収益指数の推移

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
2023/09/29	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
2024/07/31	357.399	367.297	385.149	359.607	271.899	380.900	391.643	122.774	112.589
2024/08/30	361.570	371.736	388.953	363.424	273.145	384.262	393.998	124.049	113.617
2024/09/02	361.139	371.269	388.609	363.034	273.090	383.959	393.904	123.924	113.548
2024/09/03	360.915	371.050	388.255	362.733	272.934	383.702	393.746	123.791	113.458
2024/09/04	361.820	372.021	389.065	363.542	273.112	384.371	394.189	124.067	113.643
2024/09/05	362.202	372.440	389.344	363.881	273.142	384.583	394.245	124.170	113.700
2024/09/06	362.853	373.150	389.830	364.458	273.187	385.025	394.441	124.339	113.800
2024/09/09	361.921	372.152	388.994	363.616	273.000	384.335	394.001	124.056	113.616
2024/09/10	361.719	371.923	388.927	363.438	273.008	384.220	393.967	124.029	113.610
2024/09/11	362.630	372.892	389.796	364.285	273.222	384.921	394.269	124.328	113.816
2024/09/12	362.402	372.658	389.513	364.061	273.137	384.707	394.099	124.234	113.744
2024/09/13	363.106	373.429	390.003	364.693	273.209	385.166	394.142	124.406	113.841
2024/09/17	363.645	374.018	390.375	365.134	273.312	385.555	394.430	124.531	113.933
2024/09/18	363.600	373.963	390.377	365.085	273.378	385.550	394.457	124.527	113.951
2024/09/19	362.474	372.719	389.676	364.130	273.271	384.841	394.325	124.302	113.822
2024/09/20	362.095	372.305	389.396	363.849	273.200	384.581	394.291	124.221	113.760
2024/09/24	363.406	373.690	390.697	365.091	273.632	385.683	394.894	124.624	114.080
2024/09/25	363.603	373.929	390.616	365.242	273.586	385.742	394.850	124.626	114.063
2024/09/26	362.918	373.165	390.227	364.645	273.594	385.352	394.900	124.486	114.002
2024/09/27	363.252	373.496	390.753	365.003	273.805	385.739	394.518	124.652	114.145
2024/09/30	362.589	372.840	389.729	364.301	273.331	384.980	394.456	124.344	113.867

出所:NFRC

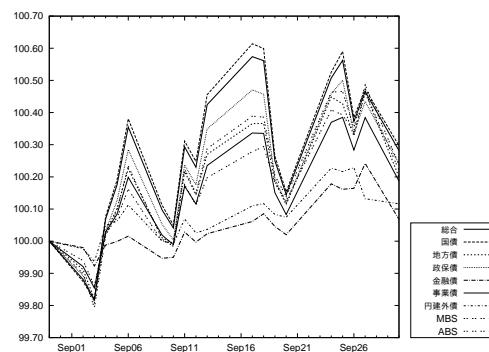
1983年12月末=100。MBSセクターは2003年3月末=100。ABSセクターは2008年3月末=100

指数の推移(月次) 2023年9月末=100に補正。



出所:NFRC

指数の推移(日次) 2024年8月末=100に補正。



出所:NFRC

総合 残存別・投資収益率 (2024年9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	362.589	3.32	2.50	0.81	-2.23	-2.17
短期 (1-3)	234.378	0.24	-0.15	0.39	-0.23	-0.40
中期 (3-7)	337.099	0.90	0.26	0.64	-0.39	-0.83
長期 (7-)	532.566	5.92	4.84	1.09	-4.05	-3.61
長期 (7-11)	194.325	4.54	3.56	0.98	-0.36	-0.71
超長期 (11-)	234.958	6.76	5.61	1.16	-6.22	-5.30
(11-15)	225.316	6.70	5.73	0.97	-2.40	-2.01
(15-)	240.358	6.79	5.57	1.22	-7.59	-6.47

出所:NFRC

投資収益率は年率換算 (%)

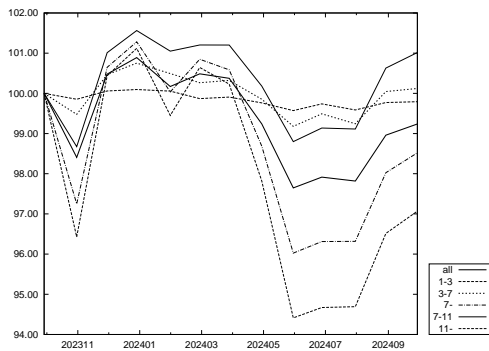
総合 残存別・投資収益指数の推移

総合 年/月/日	全体	短期 (1-3)	中期 (3-7)	長期 (7-)	長期*			
					長期* (7-11)	超長期* (11-)	(11-15)*	(15-)*
2023/09/29	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
2024/07/31	357.399	233.895	334.143	520.662	190.664	229.206	220.056	234.377
2024/08/30	361.570	234.330	336.843	529.900	193.579	233.616	224.041	238.981
2024/09/02	361.139	234.314	336.669	528.823	193.352	233.020	223.570	238.332
2024/09/03	360.915	234.228	336.360	528.526	193.081	233.008	223.320	238.411
2024/09/04	361.820	234.277	336.815	530.693	193.698	234.090	224.293	239.544
2024/09/05	362.202	234.275	336.917	531.705	193.921	234.643	224.655	240.174
2024/09/06	362.853	234.255	337.098	533.445	194.276	235.615	225.291	241.282
2024/09/09	361.921	234.191	336.638	531.219	193.673	234.481	224.319	240.078
2024/09/10	361.719	234.199	336.642	530.626	193.668	234.065	224.213	239.539
2024/09/11	362.630	234.266	337.168	532.729	194.323	235.074	225.181	240.572
2024/09/12	362.402	234.245	336.928	532.300	194.125	234.916	224.872	240.470
2024/09/13	363.106	234.269	337.084	534.169	194.436	236.011	225.477	241.761
2024/09/17	363.645	234.303	337.303	535.503	194.689	236.770	225.864	242.669
2024/09/18	363.600	234.352	337.393	535.247	194.712	236.571	225.793	242.420
2024/09/19	362.474	234.313	337.124	532.274	194.330	234.748	224.988	240.191
2024/09/20	362.095	234.296	336.913	531.380	194.101	234.282	224.879	239.586
2024/09/24	363.406	234.516	337.756	534.220	195.000	235.635	226.128	240.988
2024/09/25	363.603	234.502	337.629	534.912	194.926	236.179	226.345	241.662
2024/09/26	362.918	234.547	337.569	532.947	194.668	234.977	225.704	240.236
2024/09/27	363.252	234.648	337.998	533.443	195.093	235.018	226.126	240.131
2024/09/30	362.589	234.378	337.099	532.566	194.325	234.958	225.316	240.358

出所:NFRC

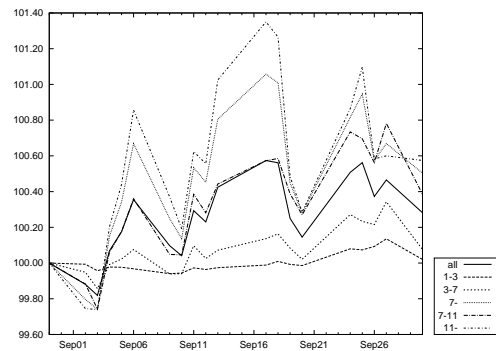
\* は 1995年12月末=100。それ以外は、1983年12月末=100。

指数の推移 (月次) 2023年9月末=100に補正。



出所:NFRC

指数の推移 (日次) 2024年8月末=100に補正。



出所:NFRC

国債 残存別・投資収益率 (2024年9月末)

	累積投資 収益指数	前月末からの投資収益率			過去からの投資収益率	
		トータル	キャピタル	インカム	前年度末	前年末
国債	372.840	3.50	2.66	0.84	-2.44	-2.38
短期 (1-3)	220.946	0.20	-0.18	0.38	-0.28	-0.46
中期 (3-7)	335.557	0.92	0.27	0.64	-0.45	-0.92
長期 (7-)	542.274	6.10	4.99	1.11	-4.28	-3.86
長期 (7-11)	192.631	4.61	3.62	0.99	-0.41	-0.81
超長期 (11-)	233.479	7.00	5.81	1.19	-6.54	-5.62
(11-15)	223.103	6.73	5.75	0.98	-2.47	-2.13
(15-)	239.305	7.09	5.83	1.26	-8.01	-6.87

出所:NFRC

投資収益率は年率換算 (%)

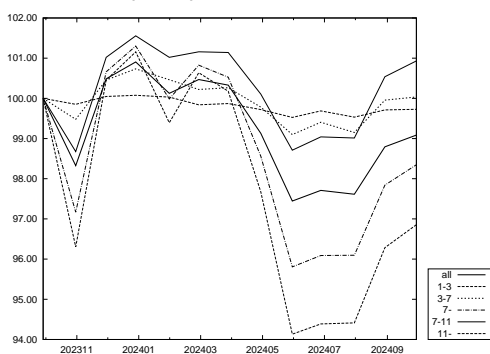
国債 残存別・投資収益指数の推移

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-)*
2023/09/29	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
2024/07/31	367.297	220.511	332.596	529.860	188.969	227.590	217.871	233.119
2024/08/30	371.736	220.909	335.296	539.477	191.879	232.100	221.835	237.873
2024/09/02	371.269	220.892	335.120	538.350	191.654	231.488	221.365	237.200
2024/09/03	371.050	220.812	334.813	538.076	191.388	231.493	221.117	237.303
2024/09/04	372.021	220.858	335.271	540.332	192.002	232.599	222.086	238.471
2024/09/05	372.440	220.856	335.375	541.405	192.225	233.176	222.445	239.137
2024/09/06	373.150	220.835	335.556	543.235	192.576	234.179	223.079	240.291
2024/09/09	372.152	220.775	335.093	540.919	191.976	233.021	222.110	239.051
2024/09/10	371.923	220.782	335.098	540.277	191.972	232.583	222.004	238.480
2024/09/11	372.892	220.846	335.627	542.454	192.625	233.608	222.974	239.535
2024/09/12	372.658	220.826	335.385	542.027	192.427	233.457	222.667	239.442
2024/09/13	373.429	220.848	335.542	544.004	192.736	234.593	223.270	240.794
2024/09/17	374.018	220.879	335.760	545.420	192.986	235.384	223.653	241.750
2024/09/18	373.963	220.925	335.852	545.149	193.013	235.180	223.584	241.491
2024/09/19	372.719	220.888	335.580	541.976	192.632	233.274	222.780	239.144
2024/09/20	372.305	220.872	335.367	541.023	192.402	232.785	222.672	238.504
2024/09/24	373.690	221.077	336.211	543.954	193.295	234.154	223.912	239.934
2024/09/25	373.929	221.065	336.087	544.727	193.230	234.732	224.133	240.655
2024/09/26	373.165	221.106	336.027	542.631	192.972	233.478	223.490	239.154
2024/09/27	373.496	221.202	336.460	543.094	193.394	233.491	223.908	239.010
2024/09/30	372.840	220.946	335.557	542.274	192.631	233.479	223.103	239.305

出所:NFRC

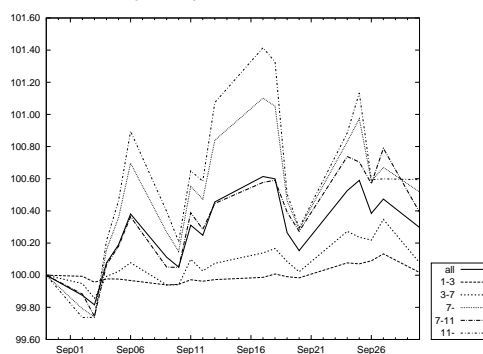
\* は 1995年12月末=100。それ以外は、1983年12月末=100。

指数の推移 (月次) 2023年9月末=100に補正。



出所:NFRC

指数の推移 (日次) 2024年8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9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	362.473	3.32	2.51	0.82	-2.24	-2.17
短期(1-3)	234.378	0.24	-0.15	0.39	-0.23	-0.40
中期(3-7)	337.099	0.90	0.26	0.64	-0.39	-0.83
長期(7-)	534.475	6.00	4.90	1.10	-4.11	-3.66
長期(7-11)	194.321	4.54	3.56	0.98	-0.36	-0.71
超長期(11-)	236.708	6.92	5.74	1.17	-6.41	-5.44
(11-15)	225.304	6.70	5.73	0.97	-2.40	-2.01
(15-)	242.375	7.00	5.75	1.25	-7.92	-6.73

出所:NFRC

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

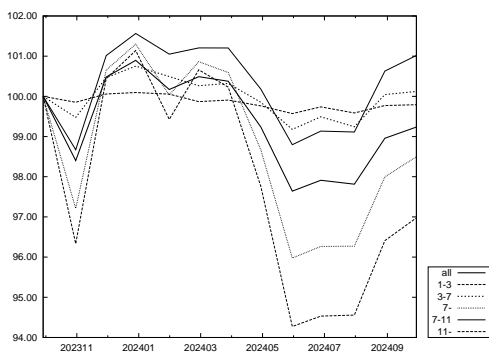
「除くMBS」残存別・投資収益指数の推移

除くMBS 年/月/日	全体	短期 (1-3)	中期 (3-7)	長期 (7-)	長期*			
					(7-11)	超長期* (11-)	(11-15)*	(15-)*
2023/09/29	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
2024/07/31	357.277	233.895	334.143	522.402	190.657	230.804	220.046	236.185
2024/08/30	361.453	234.330	336.843	531.765	193.574	235.325	224.030	240.942
2024/09/02	361.021	234.314	336.669	530.671	193.347	234.710	223.559	240.266
2024/09/03	360.798	234.228	336.360	530.379	193.076	234.707	223.309	240.364
2024/09/04	361.705	234.277	336.815	532.578	193.693	235.820	224.282	241.539
2024/09/05	362.087	234.275	336.917	533.608	193.916	236.391	224.644	242.198
2024/09/06	362.741	234.255	337.098	535.379	194.272	237.396	225.280	243.358
2024/09/09	361.808	234.191	336.638	533.121	193.668	236.230	224.308	242.107
2024/09/10	361.604	234.199	336.642	532.513	193.663	235.796	224.202	241.537
2024/09/11	362.515	234.266	337.168	534.645	194.319	236.831	225.170	242.604
2024/09/12	362.287	234.245	336.928	534.213	194.120	236.672	224.861	242.505
2024/09/13	362.993	234.269	337.084	536.117	194.432	237.805	225.466	243.860
2024/09/17	363.535	234.303	337.303	537.475	194.685	238.591	225.853	244.811
2024/09/18	363.489	234.352	337.393	537.212	194.709	238.383	225.781	244.547
2024/09/19	362.358	234.313	337.124	534.180	194.326	236.491	224.977	242.202
2024/09/20	361.977	234.296	336.913	533.269	194.097	236.009	224.868	241.567
2024/09/24	363.290	234.516	337.756	536.146	194.997	237.395	226.117	243.014
2024/09/25	363.489	234.502	337.629	536.858	194.922	237.965	226.333	243.731
2024/09/26	362.801	234.547	337.569	534.852	194.664	236.717	225.692	242.230
2024/09/27	363.133	234.648	337.998	535.345	195.089	236.748	226.115	242.100
2024/09/30	362.473	234.378	337.099	534.475	194.321	236.708	225.304	242.375

出所:NFRC

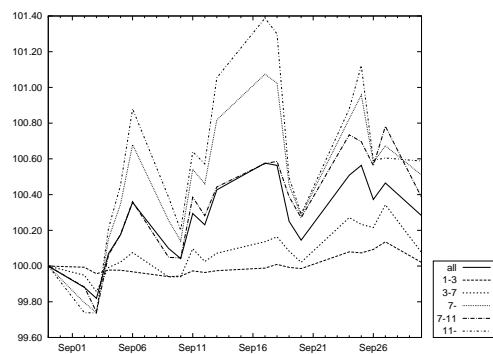
\* は1995年12月末=100。それ以外は、1983年12月末=100。

指数の推移(月次) 2023年9月末=100に補正。



出所:NFRC

指数の推移(日次) 2024年8月末=100に補正。



出所:NFRC

「除くABS」残存別・投資収益率(2024年9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	362.614	3.32	2.50	0.81	-2.23	-2.17
短期(1-3)	234.337	0.24	-0.15	0.39	-0.23	-0.40
中期(3-7)	337.095	0.90	0.26	0.64	-0.40	-0.83
長期(7-)	532.564	5.92	4.84	1.09	-4.05	-3.61
長期(7-11)	194.318	4.54	3.56	0.98	-0.36	-0.71
超長期(11-)	234.955	6.76	5.61	1.16	-6.22	-5.30
(11-15)	225.307	6.70	5.73	0.97	-2.40	-2.01
(15-)	240.360	6.79	5.57	1.22	-7.59	-6.47

出所:NFRC

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

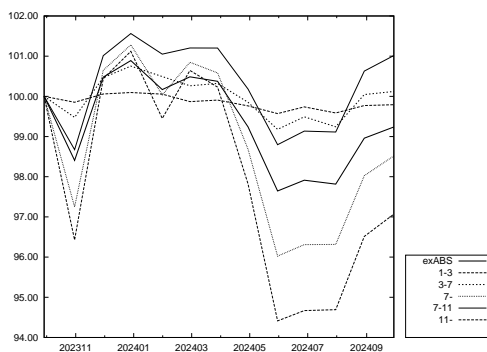
「除くABS」残存別 投資収益指数の推移

除くABS 年/月/日	全体	短期 (1-3)	中期 (3-7)	長期 (7-)	長期*			
					長期* (7-11)	超長期* (11-)	(11-15)*	(15-)*
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
2024/07/31	357.423	233.855	334.140	520.660	190.657	229.203	220.048	234.379
2024/08/30	361.595	234.290	336.839	529.898	193.573	233.613	224.032	238.982
2024/09/02	361.163	234.273	336.665	528.821	193.346	233.018	223.561	238.334
2024/09/03	360.939	234.188	336.356	528.523	193.074	233.005	223.312	238.412
2024/09/04	361.845	234.237	336.810	530.691	193.691	234.088	224.285	239.546
2024/09/05	362.226	234.235	336.913	531.703	193.915	234.641	224.646	240.176
2024/09/06	362.879	234.214	337.093	533.443	194.269	235.613	225.283	241.284
2024/09/09	361.946	234.151	336.633	531.217	193.666	234.479	224.311	240.079
2024/09/10	361.744	234.158	336.638	530.624	193.661	234.062	224.205	239.541
2024/09/11	362.655	234.226	337.164	532.727	194.317	235.072	225.172	240.574
2024/09/12	362.427	234.205	336.924	532.298	194.118	234.913	224.863	240.472
2024/09/13	363.131	234.229	337.080	534.167	194.429	236.009	225.468	241.763
2024/09/17	363.671	234.262	337.298	535.501	194.682	236.768	225.856	242.671
2024/09/18	363.625	234.311	337.389	535.245	194.706	236.569	225.784	242.422
2024/09/19	362.499	234.272	337.119	532.272	194.324	234.745	224.980	240.193
2024/09/20	362.119	234.256	336.909	531.378	194.095	234.280	224.871	239.587
2024/09/24	363.431	234.476	337.752	534.218	194.994	235.632	226.119	240.990
2024/09/25	363.629	234.462	337.624	534.910	194.919	236.177	226.336	241.664
2024/09/26	362.943	234.507	337.565	532.945	194.661	234.975	225.695	240.238
2024/09/27	363.277	234.607	337.993	533.441	195.086	235.016	226.117	240.132
2024/09/30	362.614	234.337	337.095	532.564	194.318	234.955	225.307	240.360

出所:NFRC

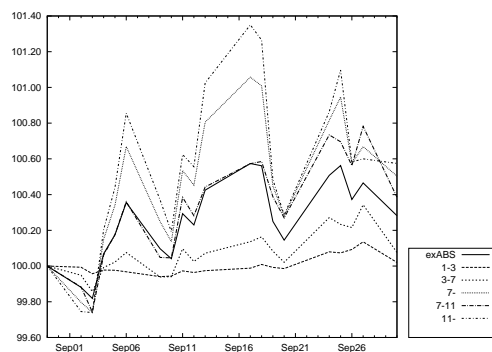
\*は1995年12月末=100。それ以外は、1983年12月末=100。

指数の推移(月次) 2023年9月末=100に補正。



出所:NFRC

指数の推移(日次) 2024年8月末=100に補正。



出所:NFRC



「除く国債」残存別・投資収益率(2024年9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	170.757	2.31	1.62	0.69	-1.07	-0.96
短期(1-3)	134.308	0.43	0.02	0.41	0.03	-0.12
中期(3-7)	167.261	0.81	0.20	0.60	-0.14	-0.43
長期(7-)	233.245	4.67	3.74	0.93	-2.45	-1.86
長期(7-11)	200.452	4.04	3.12	0.93	-0.05	-0.05
超長期(11-)	236.885	5.07	4.14	0.93	-3.94	-2.98

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(%)

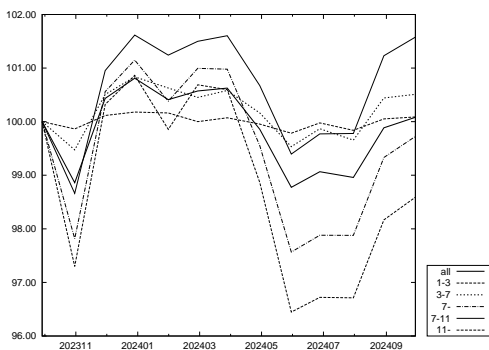
「除く国債」残存別・投資収益指数の推移

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-)
2023/09/29	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
2024/07/31	168.841	133.972	165.837	228.926	196.902	232.375
2024/08/30	170.422	134.258	167.147	232.324	199.766	235.869
2024/09/02	170.278	134.251	167.069	231.948	199.532	235.418
2024/09/03	170.142	134.202	166.913	231.728	199.236	235.277
2024/09/04	170.468	134.231	167.127	232.528	199.850	236.148
2024/09/05	170.580	134.230	167.174	232.841	200.073	236.501
2024/09/06	170.785	134.221	167.260	233.427	200.441	237.201
2024/09/09	170.448	134.185	167.043	232.605	199.834	236.288
2024/09/10	170.406	134.190	167.045	232.460	199.828	236.050
2024/09/11	170.752	134.228	167.294	233.272	200.483	236.907
2024/09/12	170.643	134.217	167.181	233.056	200.281	236.701
2024/09/13	170.854	134.232	167.255	233.648	200.600	237.449
2024/09/17	171.022	134.254	167.361	234.059	200.860	237.938
2024/09/18	171.021	134.282	167.404	233.976	200.868	237.793
2024/09/19	170.709	134.260	167.277	233.119	200.485	236.649
2024/09/20	170.594	134.253	167.181	232.856	200.267	236.376
2024/09/24	171.118	134.383	167.589	233.979	201.186	237.552
2024/09/25	171.119	134.375	167.517	234.077	201.045	237.825
2024/09/26	170.945	134.402	167.491	233.505	200.796	237.057
2024/09/27	171.136	134.456	167.689	233.852	201.228	237.305
2024/09/30	170.757	134.308	167.261	233.245	200.452	236.885

出所:NFRC

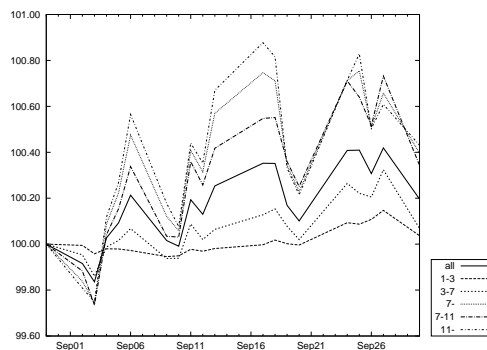
\* は1995年12月末=100。それ以外は、1993年12月末=100。

指数の推移(月次) 2023年9月末=100に補正。



出所:NFRC

指数の推移(日次) 2024年8月末=100に補正。



出所:NFRC

## 銘柄 残存別・月間投資収益率(2024年9月末)

	全体	短期 (1-3)	中期 (3-7)	長期 (7-)	月間投資収益率	
					(7-11)	(11-)
総合	3.32	0.24	0.90	5.92	4.54	6.76
国債	3.50	0.20	0.92	6.10	4.61	7.00
30年国債	6.56	-	0.93	6.65	4.63	6.86
20年国債	4.65	0.13	1.05	6.57	4.62	7.82
10年国債	1.96	0.19	1.04	4.59	4.59	-
5年国債	0.31	0.19	0.46	-	-	-
中期国債	0.31	0.31	-	-	-	-
地方債	2.35	0.30	0.65	4.76	3.73	5.92
東京都債	2.21	0.29	0.82	5.03	3.80	6.85
五大都市債	2.76	0.28	0.67	5.42	3.81	6.28
その他地方債	2.36	0.30	0.72	4.75	3.82	5.89
政保債	2.84	0.14	0.34	6.07	3.28	7.41
公営企業債券	0.08	0.14	0.02	-	-	-
その他政保債	3.18	0.14	0.41	6.07	3.28	7.41
金融債	0.80	0.43	0.86	4.80	4.80	-
特定金融債	-	-	-	-	-	-
事業債	2.20	0.55	1.00	5.28	4.69	5.81
円建外債	1.37	0.58	1.24	5.94	4.67	7.57
MBS	2.80	-	-	2.80	0.51	2.83
ABS	2.60	0.84	1.69	6.04	4.96	7.55

出所:NFRC

## 「除く(銘柄)」残存別・月間投資収益率(2024年9月末)

	全体	短期 (1-3)	中期 (3-7)	長期 (7-)	月間投資収益率	
					(7-11)	(11-)
除く国債	2.31	0.43	0.81	4.67	4.04	5.07
除く30年国債	2.72	0.24	0.90	5.62	4.53	6.69
除く20年国債	2.83	0.26	0.85	5.58	4.48	6.22
除く10年国債	3.79	0.26	0.80	6.18	4.49	6.76
除く5年国債	3.67	0.26	0.99	5.92	4.54	6.76
除く中期国債	3.41	0.23	0.90	5.92	4.54	6.76
除く地方債	3.38	0.24	0.92	5.99	4.60	6.80
除く東京都債	3.32	0.24	0.90	5.93	4.54	6.76
除く五大都市債	3.32	0.24	0.90	5.93	4.54	6.77
除くその他地方債	3.36	0.24	0.91	5.97	4.57	6.79
除く政保債	3.32	0.24	0.90	5.92	4.55	6.76
除く公営企業債券	3.32	0.24	0.90	5.92	4.54	6.76
除くその他政保債	3.32	0.24	0.90	5.92	4.55	6.76
除く金融債	3.32	0.24	0.90	5.92	4.54	6.76
除く特定金融債	3.32	0.24	0.90	5.92	4.54	6.76
除く事業債	3.39	0.21	0.89	5.95	4.53	6.80
除く円建外債	3.32	0.24	0.90	5.92	4.54	6.76
除くMBS	3.32	0.24	0.90	6.00	4.54	6.92
除くABS	3.32	0.24	0.90	5.92	4.54	6.76
除くMBS・ABS	3.32	0.24	0.90	6.00	4.54	6.92

出所:NFRC

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

## 事業債 業種別・月間投資収益率(2024年9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	2.20	0.55	1.00	5.28	4.69	5.81
水産・農林業	0.91	-	0.91	-	-	-
鉱業	2.19	0.67	2.31	3.66	3.66	-
建設業	1.37	0.44	0.93	6.00	4.85	7.61
食料品	1.80	0.52	0.94	5.77	4.81	7.51
繊維製品	1.64	0.47	0.91	6.73	5.15	8.17
パルプ・紙	1.92	0.67	1.43	6.89	5.03	8.07
化学	2.21	0.68	1.10	6.30	4.85	8.32
医薬品	2.56	0.44	0.74	4.64	3.86	6.86
石油・石炭製品	3.22	0.44	1.83	5.53	5.00	7.77
ゴム製品	1.05	0.52	1.00	4.85	4.85	-
ガラス・土石製品	2.17	0.62	1.00	6.00	4.99	8.48
鉄鋼	1.32	0.43	0.85	6.31	5.29	11.31
非鉄金属	1.50	0.59	1.30	4.87	4.87	-
金属製品	1.00	0.59	0.97	5.01	5.01	-
機械	1.65	0.67	1.30	4.86	4.86	-
電気機器	1.29	0.54	0.93	4.76	4.76	-
輸送用機器	1.70	0.57	1.21	5.84	4.88	7.24
精密機器	1.59	0.52	1.40	4.78	4.78	-
その他製品	2.53	0.69	1.20	7.96	-	7.96
電気・ガス業	3.31	0.54	1.41	6.44	5.17	7.75
陸運業	3.90	0.51	1.24	6.27	5.04	6.91
海運業	2.28	0.64	1.64	5.82	5.82	-
空運業	4.35	0.70	1.13	7.00	5.80	8.20
倉庫・運輸関連業	2.71	0.82	1.59	6.80	5.25	8.28
情報・通信業	2.09	1.05	1.72	5.88	5.41	7.21
卸売業	2.71	0.68	1.19	6.00	5.15	7.99
小売業	0.57	0.52	0.30	1.49	-0.10	8.13
銀行業	1.12	0.82	1.22	5.21	5.21	-
証券・商品先物取引業	1.36	1.30	1.40	8.98	8.98	-
保険業	1.25	0.47	0.72	5.10	5.10	-
その他金融業	1.27	0.59	1.10	5.26	4.94	7.90
不動産業	2.91	0.61	1.26	6.17	4.92	7.88
サービス業	5.69	1.31	1.27	20.29	17.06	32.38
財投機関債	1.63	0.27	0.35	3.66	3.43	3.77

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9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	2.16	0.55	1.01	5.30	4.69	5.84
AAA～A格	2.17	0.54	1.00	5.30	4.69	5.84
AAA～AA格	2.03	0.43	0.87	4.84	4.28	5.28
AAA格	1.03	0.35	0.65	3.90	3.49	4.62
AA格	2.32	0.46	0.94	4.95	4.42	5.33
A格	2.51	0.81	1.31	6.81	5.72	8.40
BBB格	1.59	0.92	1.52	4.85	4.55	5.13
事業債全体	2.20	0.55	1.00	5.28	4.69	5.81
AAA～A格	2.21	0.54	1.00	5.28	4.69	5.81
AAA～AA格	2.07	0.44	0.86	4.85	4.28	5.28
AAA格	1.03	0.35	0.65	3.90	3.49	4.62
AA格	2.38	0.48	0.94	4.96	4.43	5.33
A格	2.57	0.80	1.31	6.78	5.72	8.36
BBB格	1.49	0.96	1.43	7.60	5.54	8.77
円建外債全体	1.37	0.58	1.24	5.94	4.67	7.57
AAA～A格	1.32	0.55	1.17	6.51	4.77	8.86
AAA～AA格	0.69	0.16	1.03	3.52	3.47	4.35
AAA格	-	-	-	-	-	-
AA格	0.69	0.16	1.03	3.52	3.47	4.35
A格	1.87	0.89	1.32	7.54	5.70	9.02
BBB格	1.71	0.85	1.61	3.93	4.33	3.47

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9月末)

	全体	短期 (1-3)	中期 (3-7)	長期 (7-)	月間投資収益率	
					(7-11)	(11-)
<b>事業債</b>						
AAA~AA格	2.07	0.44	0.86	4.85	4.28	5.28
AAA~A格	2.21	0.54	1.00	5.28	4.69	5.81
AAA~BBB格	2.20	0.55	1.00	5.28	4.69	5.81
AAA~BB格	2.20	0.55	1.00	5.28	4.69	5.81
AAA格	1.03	0.35	0.65	3.90	3.49	4.62
AA格	2.38	0.48	0.94	4.96	4.43	5.33
A格	2.57	0.80	1.31	6.78	5.72	8.36
BBB格	1.49	0.96	1.43	7.60	5.54	8.77
BB格	-	-	-	-	-	-
B格以下	-	-	-	-	-	-
格付なし	-	-	-	-	-	-
<b>円建外債</b>						
AAA~AA格	0.69	0.16	1.03	3.52	3.47	4.35
AAA~A格	1.32	0.55	1.17	6.51	4.77	8.86
AAA~BBB格	1.37	0.58	1.24	5.94	4.67	7.57
AAA~BB格	1.37	0.58	1.24	5.94	4.67	7.57
AAA格	-	-	-	-	-	-
AA格	0.69	0.16	1.03	3.52	3.47	4.35
A格	1.87	0.89	1.32	7.54	5.70	9.02
BBB格	1.71	0.85	1.61	3.93	4.33	3.47
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9月末)

	全体	短期 (1-3)	中期 (3-7)	長期 (7-)	月間投資収益率	
					(7-11)	(11-)
<b>事業債</b>						
AAA~AA格	1.82	0.51	0.88	5.21	4.26	6.11
AAA~A格	2.19	0.54	0.98	5.24	4.68	5.74
AAA~BBB格	2.20	0.55	0.99	5.28	4.69	5.81
AAA~BB格	2.20	0.55	1.00	5.28	4.69	5.81
AAA格	-	-	-	-	-	-
AA格	1.82	0.51	0.88	5.21	4.26	6.11
A格	2.27	0.55	1.00	5.25	4.74	5.69
BBB格	2.42	0.77	1.23	6.59	5.16	8.20
BB格	2.48	-	1.77	9.10	-	9.10
B格以下	-	-	-	-	-	-
格付なし	-	-	-	-	-	-
<b>円建外債</b>						
AAA~AA格	0.93	0.74	1.04	3.26	3.26	-
AAA~A格	0.84	0.32	1.06	3.86	3.52	4.31
AAA~BBB格	1.37	0.58	1.24	5.94	4.67	7.57
AAA~BB格	1.37	0.58	1.24	5.94	4.67	7.57
AAA格	-	-	-	-	-	-
AA格	0.93	0.74	1.04	3.26	3.26	-
A格	0.83	0.24	1.06	3.92	3.57	4.31
BBB格	2.15	1.09	1.46	7.55	5.60	10.00
BB格	-	-	-	-	-	-
B格以下	-	-	-	-	-	-
格付なし	-	-	-	-	-	-

出所:NFRFC

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

## 事業債 円建外債 R&amp;I 格付別・月間投資収益率(2024年9月末)

	全体	短期 (1-3)	中期 (3-7)	長期 (7-)	月間投資収益率	
					(7-11)	(11-)
<b>事業債</b>						
AAA~AA 格	2.00	0.39	0.74	4.60	4.16	4.90
AAA~A 格	2.17	0.50	0.96	5.12	4.51	5.64
AAA~BBB 格	2.17	0.51	0.97	5.12	4.51	5.65
AAA~BB 格	2.17	0.51	0.97	5.12	4.51	5.65
AAA 格	1.13	0.47	0.93	5.33	4.77	6.77
AA 格	2.02	0.38	0.74	4.59	4.15	4.90
A 格	2.49	0.70	1.30	6.29	5.07	7.90
BBB 格	1.80	1.15	1.64	7.60	6.51	8.77
BB 格	-	-	-	-	-	-
B 格以下	-	-	-	-	-	-
格付なし	2.52	0.89	1.25	7.99	6.90	9.94
<b>円建外債</b>						
AAA~AA 格	1.03	1.03	-	-	-	-
AAA~A 格	1.15	0.97	1.15	3.59	3.59	-
AAA~BBB 格	1.21	0.97	1.15	4.15	3.59	5.70
AAA~BB 格	1.21	0.97	1.15	4.15	3.59	5.70
AAA 格	-	-	-	-	-	-
AA 格	1.03	1.03	-	-	-	-
A 格	1.15	0.97	1.15	3.59	3.59	-
BBB 格	5.70	-	-	5.70	-	5.70
BB 格	-	-	-	-	-	-
B 格以下	-	-	-	-	-	-
格付なし	1.41	0.47	1.26	6.15	4.85	7.70

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9月末)

	全体	短期 (1-3)	中期 (3-7)	長期 (7-)	月間投資収益率	
					(7-11)	(11-)
<b>事業債</b>						
AAA~AA 格	1.82	0.48	0.94	5.34	4.29	6.83
AAA~A 格	2.11	0.56	1.08	5.91	4.87	7.37
AAA~BBB 格	2.11	0.56	1.08	5.91	4.87	7.37
AAA~BB 格	2.11	0.56	1.08	5.91	4.87	7.37
AAA 格	1.05	0.34	0.65	3.90	3.49	4.62
AA 格	2.27	0.58	1.13	5.82	4.59	7.44
A 格	2.85	0.80	1.43	7.10	6.11	8.51
BBB 格	1.74	1.02	1.34	7.60	5.54	8.77
BB 格	-	-	-	-	-	-
B 格以下	-	-	-	-	-	-
格付なし	2.34	0.52	0.83	4.71	4.43	4.88
<b>円建外債</b>						
AAA~AA 格	1.21	0.87	1.25	3.62	3.45	4.35
AAA~A 格	2.36	0.78	1.50	7.84	6.02	8.97
AAA~BBB 格	2.36	0.78	1.51	7.84	6.02	8.97
AAA~BB 格	2.36	0.78	1.51	7.84	6.02	8.97
AAA 格	-	-	-	-	-	-
AA 格	1.21	0.87	1.25	3.62	3.45	4.35
A 格	2.78	0.74	1.61	8.39	6.86	9.14
BBB 格	2.67	-	2.67	-	-	-
BB 格	-	-	-	-	-	-
B 格以下	-	-	-	-	-	-
格付なし	1.01	0.51	1.18	3.85	3.93	3.59

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9月末)

	全体	短期 (1-3)	中期 (3-7)	長期 (7-)	月間投資収益率	
					(7-11)	(11-)
<b>事業債</b>						
AAA~AA格	-	-	-	-	-	-
AAA~A格	2.02	0.37	0.66	4.51	4.19	4.72
AAA~BBB格	2.07	0.38	0.73	4.64	4.26	4.90
AAA~BB格	2.07	0.38	0.73	4.64	4.26	4.90
AAA格	-	-	-	-	-	-
AA格	-	-	-	-	-	-
A格	2.02	0.37	0.66	4.51	4.19	4.72
BBB格	2.69	0.44	1.24	6.63	5.08	8.24
BB格	-	-	-	-	-	-
B格以下	-	-	-	-	-	-
格付なし	2.28	0.64	1.14	5.78	4.95	6.70
<b>円建外債</b>						
AAA~AA格	0.62	0.04	1.01	3.43	3.43	-
AAA~A格	0.87	0.30	1.08	3.95	3.73	4.31
AAA~BBB格	1.34	0.47	1.22	5.98	4.71	7.57
AAA~BB格	1.34	0.47	1.22	5.98	4.71	7.57
AAA格	-	-	-	-	-	-
AA格	0.62	0.04	1.01	3.43	3.43	-
A格	1.22	0.60	1.23	4.20	4.06	4.31
BBB格	2.25	0.95	1.43	7.95	5.88	10.00
BB格	-	-	-	-	-	-
B格以下	-	-	-	-	-	-
格付なし	1.70	1.58	1.93	3.84	3.84	-

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&amp;P 格付別・月間投資収益率(2024年9月末)

	全体	短期 (1-3)	中期 (3-7)	長期 (7-)	月間投資収益率	
					(7-11)	(11-)
<b>事業債</b>						
AAA~AA格	5.30	0.37	1.58	6.36	4.91	7.22
AAA~A格	2.34	0.32	0.81	5.09	4.19	5.88
AAA~BBB格	2.33	0.33	0.82	5.10	4.20	5.89
AAA~BB格	2.33	0.33	0.86	5.12	4.20	5.92
AAA格	-	-	-	-	-	-
AA格	5.30	0.37	1.58	6.36	4.91	7.22
A格	2.19	0.32	0.80	4.96	4.13	5.71
BBB格	1.81	0.38	1.21	7.06	5.21	11.31
BB格	2.48	-	1.77	9.10	-	9.10
B格以下	-	-	-	-	-	-
格付なし	2.16	0.60	1.04	5.35	4.89	5.77
<b>円建外債</b>						
AAA~AA格	0.92	0.69	1.01	3.26	3.26	-
AAA~A格	0.83	0.28	1.07	3.87	3.53	4.31
AAA~BBB格	1.36	0.55	1.24	5.95	4.69	7.57
AAA~BB格	1.36	0.55	1.24	5.95	4.69	7.57
AAA格	-	-	-	-	-	-
AA格	0.92	0.69	1.01	3.26	3.26	-
A格	0.82	0.21	1.08	3.93	3.58	4.31
BBB格	2.18	1.08	1.46	7.55	5.60	10.00
BB格	-	-	-	-	-	-
B格以下	-	-	-	-	-	-
格付なし	1.60	1.58	1.44	3.17	3.17	-

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9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	1,138,196	96.80	96.92	10.24	0.81	0.92	0.89	8.78	8.72	8.74	4
短期(1-3)	230,968	100.01	100.08	1.99	0.40	0.39	0.39	1.98	1.97	1.98	6
中期(3-7)	307,657	100.69	100.80	4.85	0.66	0.52	0.52	4.77	4.76	4.77	5
長期(7-)	599,572	93.57	93.70	16.19	1.05	1.36	1.31	13.79	13.69	13.70	4
長期(7-11)	206,862	102.15	102.32	8.75	1.02	0.77	0.78	8.37	8.34	8.37	3
超長期(11-)	392,710	89.04	89.16	20.11	1.06	1.71	1.62	17.07	16.92	16.93	4
(11-15)	95,733	96.87	96.99	13.00	0.97	1.24	1.22	12.19	12.11	12.16	4
(15-)	296,977	86.52	86.64	22.40	1.09	1.88	1.77	18.83	18.66	18.65	4
国債	964,488	96.76	96.88	10.76	0.83	0.92	0.89	9.18	9.12	9.13	1
短期(1-3)	189,668	100.10	100.16	1.98	0.39	0.34	0.34	1.97	1.97	1.97	1
中期(3-7)	249,785	100.99	101.09	4.87	0.67	0.47	0.48	4.79	4.78	4.79	0
長期(7-)	525,035	93.55	93.69	16.74	1.07	1.37	1.31	14.22	14.11	14.11	1
長期(7-11)	179,102	102.54	102.70	8.77	1.03	0.74	0.75	8.39	8.36	8.39	0
超長期(11-)	345,933	88.90	89.02	20.86	1.09	1.74	1.64	17.69	17.54	17.53	1
(11-15)	83,771	97.39	97.50	13.08	0.99	1.21	1.20	12.25	12.17	12.23	1
(15-)	262,162	86.19	86.31	23.34	1.12	1.93	1.79	19.66	19.48	19.45	1
地方債	66,950	97.75	97.85	7.34	0.61	0.78	0.80	6.80	6.76	6.77	11
短期(1-3)	12,792	99.87	99.92	2.01	0.37	0.45	0.45	2.00	2.00	2.00	11
中期(3-7)	24,571	99.48	99.57	4.93	0.50	0.58	0.58	4.86	4.85	4.86	11
長期(7-)	29,587	95.40	95.52	11.66	0.81	1.11	1.14	10.64	10.57	10.59	12
政保債	14,221	96.70	96.89	9.28	0.73	0.90	0.86	8.02	7.97	7.99	7
短期(1-3)	3,306	99.55	99.59	1.99	0.18	0.40	0.40	1.99	1.98	1.99	7
中期(3-7)	4,307	100.67	100.83	4.45	0.62	0.52	0.52	4.39	4.38	4.39	6
長期(7-)	6,608	92.69	92.97	16.07	1.07	1.43	1.36	13.82	13.72	13.75	8
金融債	3,441	98.92	98.98	3.13	0.30	0.66	0.66	3.09	3.08	3.09	26
短期(1-3)	2,002	99.17	99.20	2.00	0.17	0.58	0.58	2.00	1.99	2.00	25
中期(3-7)	1,271	98.76	98.87	4.24	0.45	0.73	0.73	4.19	4.17	4.19	28
長期(7-)	168	97.11	97.23	8.27	0.71	1.12	1.11	8.02	7.98	8.02	41
事業債	70,842	96.45	96.62	7.41	0.74	1.07	1.04	6.36	6.32	6.33	39
短期(1-3)	21,177	99.56	99.66	2.00	0.46	0.69	0.69	1.99	1.98	1.99	35
中期(3-7)	26,053	99.17	99.32	4.70	0.69	0.86	0.86	4.61	4.59	4.61	39
長期(7-)	23,612	90.66	90.90	15.26	1.05	1.70	1.60	12.77	12.66	12.67	43
長期(7-11)	10,229	98.64	98.89	8.65	1.03	1.22	1.21	8.26	8.21	8.25	47
超長期(11-)	13,383	84.57	84.80	20.32	1.07	2.13	1.96	16.80	16.63	16.61	39
円建外債	3,576	99.40	99.70	3.75	1.05	1.23	1.22	3.58	3.55	3.57	78
短期(1-3)	1,838	99.67	99.93	2.07	0.92	1.08	1.08	2.05	2.03	2.05	74
中期(3-7)	1,381	99.15	99.43	4.11	1.01	1.23	1.23	4.02	3.99	4.02	78
長期(7-)	357	99.04	99.59	11.07	1.85	1.99	1.98	9.80	9.70	9.77	103
長期(7-11)	203	98.64	98.99	8.62	1.49	1.70	1.69	8.07	8.00	8.06	96
超長期(11-)	155	99.56	100.36	14.27	2.34	2.37	2.36	12.03	11.89	11.96	113
MBS	14,018	95.44	95.47	7.27	0.63	0.82	1.20	6.80	6.76	7.07	22
ABS	662	96.22	96.39	5.84	0.72	1.26	1.23	5.43	5.39	5.43	67
短期(1-3)	186	99.35	99.52	2.02	0.65	0.97	0.96	2.01	2.00	2.01	63
中期(3-7)	289	97.51	97.65	5.04	0.66	1.15	1.14	4.94	4.91	4.94	66
長期(7-)	186	91.09	91.31	10.91	0.87	1.76	1.66	9.98	9.89	9.96	74

出所:NFRG



## 「除く」銘柄 残存別・ポートフォリオ指標 (2024年9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	1,124,178	96.82	96.93	10.28	0.81	0.92	0.89	8.81	8.75	8.76	4
短期 (1-3)	230,968	100.01	100.08	1.99	0.40	0.39	0.39	1.98	1.97	1.98	6
中期 (3-7)	307,657	100.69	100.80	4.85	0.66	0.52	0.52	4.77	4.76	4.77	5
長期 (7-)	585,554	93.52	93.66	16.40	1.06	1.37	1.31	13.96	13.86	13.87	3
長期 (7-11)	206,680	102.16	102.33	8.76	1.02	0.77	0.78	8.38	8.35	8.37	3
超長期 (11-)	378,874	88.81	88.93	20.58	1.08	1.74	1.64	17.47	17.32	17.31	3
(11-15)	95,733	96.87	96.99	13.00	0.97	1.24	1.22	12.19	12.11	12.16	4
(15-)	283,141	86.08	86.21	23.14	1.11	1.93	1.80	19.48	19.30	19.27	3
除く ABS	1,137,535	96.80	96.92	10.25	0.81	0.92	0.89	8.78	8.73	8.74	4
短期 (1-3)	230,782	100.01	100.08	1.99	0.40	0.39	0.39	1.98	1.97	1.98	6
中期 (3-7)	307,368	100.69	100.80	4.85	0.66	0.52	0.52	4.77	4.76	4.77	5
長期 (7-)	599,386	93.57	93.70	16.19	1.05	1.36	1.31	13.79	13.69	13.71	4
長期 (7-11)	206,759	102.16	102.33	8.75	1.02	0.77	0.78	8.37	8.34	8.37	3
超長期 (11-)	392,626	89.04	89.16	20.11	1.06	1.71	1.62	17.07	16.92	16.93	4
(11-15)	95,671	96.88	96.99	13.00	0.97	1.24	1.22	12.19	12.11	12.16	4
(15-)	296,955	86.52	86.64	22.40	1.09	1.88	1.77	18.83	18.66	18.65	4
除く MBS・ABS	1,123,517	96.82	96.93	10.28	0.81	0.92	0.89	8.81	8.75	8.76	4
短期 (1-3)	230,782	100.01	100.08	1.99	0.40	0.39	0.39	1.98	1.97	1.98	6
中期 (3-7)	307,368	100.69	100.80	4.85	0.66	0.52	0.52	4.77	4.76	4.77	5
長期 (7-)	585,367	93.52	93.66	16.41	1.06	1.37	1.31	13.97	13.86	13.87	3
長期 (7-11)	206,577	102.16	102.33	8.76	1.02	0.77	0.78	8.38	8.35	8.37	3
超長期 (11-)	378,790	88.81	88.94	20.58	1.08	1.74	1.64	17.47	17.32	17.31	3
(11-15)	95,671	96.88	96.99	13.00	0.97	1.24	1.22	12.19	12.11	12.16	4
(15-)	283,119	86.09	86.21	23.14	1.11	1.93	1.80	19.48	19.30	19.27	3
除く 国債	173,709	97.00	97.13	7.36	0.68	0.92	0.94	6.57	6.53	6.57	25
短期 (1-3)	41,300	99.64	99.72	2.01	0.42	0.60	0.60	2.00	1.99	2.00	27
中期 (3-7)	57,872	99.40	99.52	4.75	0.61	0.72	0.72	4.68	4.66	4.68	25
長期 (7-)	74,537	93.68	93.84	12.35	0.88	1.27	1.32	10.83	10.75	10.82	24
長期 (7-11)	27,760	99.70	99.88	8.59	0.93	0.99	0.99	8.25	8.21	8.24	25
超長期 (11-)	46,777	90.10	90.25	14.58	0.85	1.46	1.54	12.52	12.42	12.51	23

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9月末、10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	1,146,483	96.83	96.94	10.27	0.81	0.92	0.90	8.81	8.75	8.76	4
短期 (1-3)	230,762	100.02	100.08	2.01	0.40	0.39	0.39	2.00	2.00	2.00	6
中期 (3-7)	311,595	100.67	100.78	4.86	0.65	0.52	0.52	4.79	4.77	4.79	5
長期 (7-)	604,126	93.63	93.77	16.21	1.05	1.36	1.31	13.81	13.70	13.72	4
長期 (7-11)	208,975	102.17	102.34	8.78	1.03	0.78	0.78	8.39	8.36	8.39	3
超長期 (11-)	395,152	89.11	89.23	20.14	1.07	1.71	1.63	17.09	16.94	16.95	4
(11-15)	95,806	96.86	96.97	13.00	0.97	1.24	1.22	12.19	12.11	12.17	4
(15-)	299,346	86.63	86.76	22.43	1.10	1.88	1.77	18.84	18.67	18.66	4
国債	972,942	96.80	96.91	10.78	0.84	0.92	0.89	9.19	9.13	9.14	1
短期 (1-3)	189,459	100.10	100.16	2.00	0.40	0.35	0.35	1.99	1.99	1.99	1
中期 (3-7)	253,407	100.97	101.08	4.87	0.66	0.47	0.48	4.79	4.78	4.79	0
長期 (7-)	530,076	93.62	93.76	16.74	1.08	1.37	1.31	14.22	14.11	14.11	1
長期 (7-11)	181,701	102.53	102.70	8.79	1.04	0.74	0.75	8.40	8.37	8.40	0
超長期 (11-)	348,374	88.97	89.09	20.89	1.10	1.74	1.64	17.71	17.56	17.55	1
(11-15)	83,771	97.39	97.50	13.08	0.99	1.21	1.20	12.25	12.17	12.23	1
(15-)	264,603	86.31	86.43	23.36	1.13	1.93	1.80	19.66	19.48	19.45	1
地方債	66,953	97.75	97.85	7.40	0.61	0.79	0.80	6.85	6.81	6.83	11
短期 (1-3)	12,769	99.84	99.90	2.08	0.37	0.45	0.45	2.07	2.07	2.07	11
中期 (3-7)	24,747	99.45	99.54	5.00	0.50	0.59	0.59	4.93	4.92	4.93	11
長期 (7-)	29,437	95.41	95.53	11.72	0.82	1.12	1.15	10.69	10.63	10.64	12
政保債	14,198	96.70	96.89	9.37	0.74	0.90	0.87	8.11	8.06	8.08	7
短期 (1-3)	3,371	99.56	99.60	2.09	0.20	0.41	0.41	2.09	2.08	2.09	7
中期 (3-7)	4,172	100.74	100.91	4.56	0.64	0.52	0.53	4.49	4.48	4.49	6
長期 (7-)	6,655	92.71	92.99	16.07	1.07	1.43	1.36	13.83	13.73	13.77	8
金融債	3,426	98.93	99.00	3.20	0.31	0.67	0.67	3.16	3.15	3.16	27
短期 (1-3)	1,990	99.14	99.18	2.07	0.17	0.59	0.59	2.07	2.06	2.07	25
中期 (3-7)	1,267	98.83	98.94	4.31	0.47	0.74	0.73	4.26	4.24	4.26	28
長期 (7-)	168	97.11	97.23	8.27	0.71	1.12	1.11	8.02	7.98	8.02	41
事業債	70,684	96.45	96.61	7.46	0.75	1.08	1.04	6.41	6.37	6.38	39
短期 (1-3)	21,132	99.56	99.67	2.05	0.47	0.70	0.69	2.04	2.04	2.04	35
中期 (3-7)	26,334	99.09	99.24	4.78	0.69	0.87	0.86	4.69	4.67	4.69	39
長期 (7-)	23,218	90.61	90.84	15.43	1.07	1.72	1.62	12.90	12.79	12.80	43
長期 (7-11)	9,848	98.78	99.03	8.76	1.06	1.23	1.22	8.35	8.30	8.34	47
超長期 (11-)	13,370	84.59	84.81	20.35	1.07	2.13	1.96	16.82	16.65	16.63	39
円建外債	3,596	99.41	99.70	3.89	1.09	1.26	1.26	3.70	3.67	3.69	80
短期 (1-3)	1,867	99.64	99.89	2.22	0.96	1.11	1.11	2.19	2.18	2.19	76
中期 (3-7)	1,370	99.14	99.42	4.22	1.05	1.26	1.25	4.12	4.10	4.12	80
長期 (7-)	359	99.20	99.75	11.28	1.92	2.04	2.03	9.93	9.83	9.90	106
長期 (7-11)	199	98.93	99.29	8.76	1.58	1.75	1.74	8.17	8.09	8.16	99
超長期 (11-)	160	99.53	100.32	14.44	2.35	2.39	2.38	12.12	11.98	12.05	113
MBS	14,034	95.44	95.48	7.31	0.63	0.82	1.20	6.84	6.79	7.11	22
ABS	651	96.16	96.34	5.97	0.73	1.27	1.24	5.56	5.52	5.55	67
短期 (1-3)	174	99.29	99.46	2.15	0.67	0.99	0.99	2.13	2.12	2.13	64
中期 (3-7)	297	97.45	97.59	5.12	0.66	1.15	1.14	5.02	4.99	5.02	65
長期 (7-)	180	91.03	91.25	11.08	0.90	1.77	1.68	10.11	10.02	10.09	75

出所:NFRIC

## 「除く」銘柄 残存別・ポートフォリオ指標 (2024年9月末、10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	1,132,449	96.84	96.96	10.31	0.82	0.92	0.89	8.83	8.77	8.78	4
短期 (1-3)	230,762	100.02	100.08	2.01	0.40	0.39	0.39	2.00	2.00	2.00	6
中期 (3-7)	311,595	100.67	100.78	4.86	0.65	0.52	0.52	4.79	4.77	4.79	5
長期 (7-)	590,092	93.58	93.73	16.42	1.06	1.37	1.31	13.98	13.87	13.88	3
長期 (7-11)	208,793	102.18	102.35	8.78	1.03	0.78	0.78	8.40	8.37	8.40	3
超長期 (11-)	381,299	88.88	89.01	20.61	1.08	1.74	1.64	17.49	17.34	17.33	3
(11-15)	95,806	96.86	96.97	13.00	0.97	1.24	1.22	12.19	12.11	12.17	4
(15-)	285,493	86.20	86.33	23.16	1.12	1.93	1.80	19.49	19.31	19.27	3
除く ABS	1,145,832	96.83	96.94	10.27	0.81	0.92	0.90	8.81	8.75	8.76	4
短期 (1-3)	230,588	100.02	100.09	2.01	0.40	0.39	0.39	2.00	2.00	2.00	6
中期 (3-7)	311,297	100.67	100.78	4.86	0.65	0.52	0.52	4.79	4.77	4.79	5
長期 (7-)	603,946	93.63	93.77	16.21	1.05	1.36	1.31	13.81	13.70	13.72	4
長期 (7-11)	208,873	102.18	102.35	8.78	1.03	0.77	0.78	8.39	8.36	8.39	3
超長期 (11-)	395,073	89.11	89.23	20.15	1.07	1.71	1.63	17.09	16.95	16.95	4
(11-15)	95,748	96.86	96.97	13.00	0.97	1.24	1.22	12.19	12.11	12.17	4
(15-)	299,325	86.63	86.76	22.43	1.10	1.88	1.77	18.84	18.67	18.66	4
除く MBS・ABS	1,131,798	96.84	96.96	10.31	0.82	0.92	0.89	8.83	8.77	8.78	4
短期 (1-3)	230,588	100.02	100.09	2.01	0.40	0.39	0.39	2.00	2.00	2.00	6
中期 (3-7)	311,297	100.67	100.78	4.86	0.65	0.52	0.52	4.79	4.77	4.79	5
長期 (7-)	589,912	93.59	93.73	16.42	1.06	1.37	1.31	13.98	13.87	13.88	3
長期 (7-11)	208,691	102.18	102.35	8.78	1.03	0.78	0.78	8.40	8.37	8.40	3
超長期 (11-)	381,221	88.88	89.01	20.61	1.08	1.74	1.64	17.49	17.34	17.33	3
(11-15)	95,748	96.86	96.97	13.00	0.97	1.24	1.22	12.19	12.11	12.17	4
(15-)	285,472	86.20	86.34	23.16	1.12	1.93	1.80	19.49	19.31	19.27	3
除く 国債	173,541	97.00	97.13	7.42	0.68	0.93	0.94	6.63	6.59	6.63	25
短期 (1-3)	41,303	99.63	99.72	2.07	0.43	0.61	0.61	2.06	2.06	2.06	27
中期 (3-7)	58,188	99.35	99.47	4.84	0.61	0.73	0.73	4.76	4.74	4.76	25
長期 (7-)	74,051	93.68	93.84	12.43	0.89	1.28	1.32	10.89	10.81	10.88	23
長期 (7-11)	27,273	99.79	99.98	8.69	0.96	0.99	0.99	8.33	8.28	8.32	25
超長期 (11-)	46,777	90.12	90.26	14.61	0.85	1.46	1.54	12.54	12.44	12.54	23

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9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	70,842	96.45	96.62	7.41	0.74	1.07	1.04	6.36	6.32	6.33	39
短期 (1-3)	21,177	99.56	99.66	2.00	0.46	0.69	0.69	1.99	1.98	1.99	35
中期 (3-7)	26,053	99.17	99.32	4.70	0.69	0.86	0.86	4.61	4.59	4.61	39
長期 (7-)	23,612	90.66	90.90	15.26	1.05	1.70	1.60	12.77	12.66	12.67	43
長期 (7-11)	10,229	98.64	98.89	8.65	1.03	1.22	1.21	8.26	8.21	8.25	47
超長期 (11-)	13,383	84.57	84.80	20.32	1.07	2.13	1.96	16.80	16.63	16.61	39
水産・農林業	33	99.70	99.95	4.09	0.86	0.94	0.94	4.01	3.99	4.01	50
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	33	99.70	99.95	4.09	0.86	0.94	0.94	4.01	3.99	4.01	50
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
鉱業	30	96.99	97.03	4.98	0.21	0.81	0.80	4.90	4.88	4.90	33
短期 (1-3)	10	99.27	99.27	1.46	0.08	0.59	0.58	1.46	1.45	1.46	29
中期 (3-7)	10	96.34	96.35	6.45	0.30	0.90	0.89	6.39	6.37	6.39	35
長期 (7-)	10	95.35	95.46	7.04	0.25	0.96	0.93	6.97	6.94	6.97	36
長期 (7-11)	10	95.35	95.46	7.04	0.25	0.96	0.93	6.97	6.94	6.97	36
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
建設業	1,177	98.09	98.20	4.39	0.46	0.84	0.83	4.23	4.21	4.23	36
短期 (1-3)	391	99.18	99.24	2.08	0.28	0.68	0.68	2.07	2.06	2.07	33
中期 (3-7)	636	98.58	98.69	4.31	0.51	0.82	0.82	4.25	4.23	4.25	36
長期 (7-)	150	93.19	93.40	10.75	0.75	1.41	1.35	10.12	10.05	10.11	42
長期 (7-11)	84	97.30	97.51	8.28	0.78	1.15	1.13	8.01	7.97	8.01	43
超長期 (11-)	66	87.96	88.17	13.89	0.71	1.77	1.66	13.09	12.98	13.07	41
食料品	1,439	98.15	98.27	4.81	0.49	0.86	0.85	4.59	4.56	4.58	34
短期 (1-3)	607	99.27	99.32	1.99	0.28	0.65	0.65	1.98	1.97	1.98	31
中期 (3-7)	512	98.47	98.58	4.49	0.46	0.82	0.81	4.44	4.42	4.44	35
長期 (7-)	320	95.51	95.76	10.66	0.91	1.34	1.30	9.96	9.89	9.94	38
長期 (7-11)	200	98.58	98.87	8.60	0.90	1.10	1.09	8.26	8.22	8.26	36
超長期 (11-)	120	90.40	90.57	14.08	0.92	1.78	1.69	13.04	12.93	13.01	43
繊維製品	225	98.09	98.22	4.85	0.53	0.89	0.88	4.64	4.61	4.64	37
短期 (1-3)	80	99.16	99.22	2.59	0.33	0.67	0.67	2.58	2.57	2.58	29
中期 (3-7)	109	98.76	98.88	4.24	0.52	0.83	0.83	4.19	4.17	4.19	38
長期 (7-)	36	93.68	93.98	11.73	1.03	1.59	1.53	10.90	10.82	10.89	50
長期 (7-11)	16	100.21	100.67	9.15	1.29	1.27	1.27	8.62	8.57	8.62	48
超長期 (11-)	20	88.45	88.62	13.79	0.83	1.89	1.78	12.98	12.86	12.95	52
パルプ・紙	344	96.98	97.10	4.86	0.45	1.01	0.99	4.59	4.56	4.58	48
短期 (1-3)	144	99.05	99.15	1.88	0.32	0.81	0.81	1.87	1.86	1.87	48
中期 (3-7)	145	97.22	97.32	4.92	0.43	0.96	0.95	4.85	4.82	4.85	47
長期 (7-)	55	90.93	91.16	12.47	0.86	1.70	1.62	11.56	11.47	11.54	52
長期 (7-11)	20	96.89	97.14	8.21	0.83	1.29	1.27	7.91	7.86	7.91	58
超長期 (11-)	35	87.52	87.74	14.90	0.88	1.96	1.83	13.87	13.75	13.84	48
化学	2,333	96.55	96.69	5.57	0.52	1.02	0.99	5.19	5.16	5.19	44
短期 (1-3)	717	99.23	99.31	2.12	0.32	0.69	0.69	2.11	2.11	2.11	35
中期 (3-7)	1,018	98.25	98.38	4.63	0.50	0.88	0.87	4.57	4.55	4.57	40
長期 (7-)	598	90.43	90.65	11.29	0.79	1.71	1.61	10.38	10.29	10.36	65
長期 (7-11)	325	96.66	96.85	8.06	0.76	1.25	1.23	7.81	7.76	7.81	55
超長期 (11-)	273	83.02	83.26	15.14	0.83	2.34	2.13	13.93	13.78	13.89	78
医薬品	728	96.52	96.63	6.02	0.50	0.99	0.97	5.66	5.62	5.65	40
短期 (1-3)	178	99.46	99.51	1.78	0.30	0.60	0.60	1.77	1.77	1.77	28
中期 (3-7)	185	99.16	99.23	4.07	0.56	0.78	0.77	4.03	4.01	4.03	33
長期 (7-)	365	93.75	93.92	9.07	0.56	1.31	1.26	8.53	8.48	8.52	51
長期 (7-11)	265	95.43	95.61	7.09	0.43	1.13	1.10	6.97	6.93	6.97	52
超長期 (11-)	100	89.29	89.46	14.32	0.91	1.82	1.71	12.96	12.84	12.91	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9月末、10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	70,684	96.45	96.61	7.46	0.75	1.08	1.04	6.41	6.37	6.38	39
短期 (1-3)	21,132	99.56	99.67	2.05	0.47	0.70	0.69	2.04	2.04	2.04	35
中期 (3-7)	26,334	99.09	99.24	4.78	0.69	0.87	0.86	4.69	4.67	4.69	39
長期 (7-)	23,218	90.61	90.84	15.43	1.07	1.72	1.62	12.90	12.79	12.80	43
長期 (7-11)	9,848	98.78	99.03	8.76	1.06	1.23	1.22	8.35	8.30	8.34	47
超長期 (11-)	13,370	84.59	84.81	20.35	1.07	2.13	1.96	16.82	16.65	16.63	39
水産・農林業	33	99.70	99.95	4.09	0.86	0.94	0.94	4.01	3.99	4.01	50
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	33	99.70	99.95	4.09	0.86	0.94	0.94	4.01	3.99	4.01	50
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
鉱業	30	96.99	97.03	4.98	0.21	0.81	0.80	4.90	4.88	4.90	33
短期 (1-3)	10	99.27	99.27	1.46	0.08	0.59	0.58	1.46	1.45	1.46	29
中期 (3-7)	20	95.84	95.91	6.75	0.28	0.93	0.91	6.68	6.65	6.68	35
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
建設業	1,142	98.04	98.15	4.49	0.47	0.85	0.84	4.33	4.31	4.33	36
短期 (1-3)	456	99.22	99.30	2.37	0.33	0.69	0.69	2.36	2.36	2.36	32
中期 (3-7)	536	98.39	98.51	4.54	0.50	0.85	0.84	4.48	4.46	4.48	38
長期 (7-)	150	93.19	93.40	10.75	0.75	1.41	1.35	10.12	10.05	10.11	42
長期 (7-11)	84	97.30	97.51	8.28	0.78	1.15	1.13	8.01	7.97	8.01	43
超長期 (11-)	66	87.96	88.17	13.89	0.71	1.77	1.66	13.09	12.98	13.07	41
食料品	1,429	98.14	98.26	4.83	0.49	0.86	0.85	4.61	4.59	4.61	34
短期 (1-3)	597	99.26	99.32	2.00	0.29	0.65	0.65	1.99	1.99	1.99	32
中期 (3-7)	512	98.47	98.58	4.49	0.46	0.82	0.81	4.44	4.42	4.44	35
長期 (7-)	320	95.51	95.76	10.66	0.91	1.34	1.30	9.96	9.89	9.94	38
長期 (7-11)	200	98.58	98.87	8.60	0.90	1.10	1.09	8.26	8.22	8.26	36
超長期 (11-)	120	90.40	90.57	14.08	0.92	1.78	1.69	13.04	12.93	13.01	43
繊維製品	225	98.09	98.22	4.85	0.53	0.89	0.88	4.64	4.61	4.64	37
短期 (1-3)	80	99.16	99.22	2.59	0.33	0.67	0.67	2.58	2.57	2.58	29
中期 (3-7)	109	98.76	98.88	4.24	0.52	0.83	0.83	4.19	4.17	4.19	38
長期 (7-)	36	93.68	93.98	11.73	1.03	1.59	1.53	10.90	10.82	10.89	50
長期 (7-11)	16	100.21	100.67	9.15	1.29	1.27	1.27	8.62	8.57	8.62	48
超長期 (11-)	20	88.45	88.62	13.79	0.83	1.89	1.78	12.98	12.86	12.95	52
パルプ・紙	329	96.85	96.96	5.03	0.44	1.02	1.00	4.75	4.72	4.75	48
短期 (1-3)	129	98.96	99.04	1.97	0.28	0.82	0.81	1.97	1.96	1.97	48
中期 (3-7)	145	97.22	97.32	4.92	0.43	0.96	0.95	4.85	4.82	4.85	47
長期 (7-)	55	90.93	91.16	12.47	0.86	1.70	1.62	11.56	11.47	11.54	52
長期 (7-11)	20	96.89	97.14	8.21	0.83	1.29	1.27	7.91	7.86	7.91	58
超長期 (11-)	35	87.52	87.74	14.90	0.88	1.96	1.83	13.87	13.75	13.84	48
化学	2,413	96.67	96.81	5.52	0.53	1.01	0.98	5.15	5.12	5.15	44
短期 (1-3)	752	99.27	99.35	2.16	0.34	0.69	0.69	2.15	2.14	2.15	34
中期 (3-7)	1,093	98.23	98.36	4.72	0.51	0.88	0.88	4.65	4.63	4.65	41
長期 (7-)	568	90.25	90.47	11.52	0.82	1.73	1.63	10.57	10.47	10.55	65
長期 (7-11)	295	96.94	97.14	8.17	0.81	1.25	1.24	7.90	7.85	7.89	55
超長期 (11-)	273	83.02	83.26	15.14	0.83	2.34	2.13	13.93	13.78	13.89	78
医薬品	728	96.52	96.63	6.02	0.50	0.99	0.97	5.66	5.62	5.65	40
短期 (1-3)	178	99.46	99.51	1.78	0.30	0.60	0.60	1.77	1.77	1.77	28
中期 (3-7)	435	96.94	97.08	5.78	0.47	0.97	0.96	5.67	5.64	5.67	43
長期 (7-)	115	90.37	90.52	13.48	0.91	1.74	1.65	12.21	12.11	12.17	49
長期 (7-11)	15	97.51	97.56	7.94	0.93	1.28	1.26	7.66	7.62	7.66	60
超長期 (11-)	100	89.29	89.46	14.32	0.91	1.82	1.71	12.96	12.84	12.91	48

出所:NFRC

- 東証 33 業種分類を参考に NFRC で分類

## 事業債 業種別・ポートフォリオ指標 (2/4) (2024年9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	265	96.73	96.87	6.62	0.60	1.10	1.08	6.28	6.24	6.27	48
短期 (1-3)	50	99.12	99.17	2.24	0.30	0.72	0.71	2.23	2.23	2.23	36
中期 (3-7)	95	96.90	96.97	5.52	0.39	0.96	0.94	5.44	5.42	5.44	44
長期 (7-)	120	95.59	95.84	9.31	0.90	1.38	1.35	8.69	8.63	8.68	57
長期 (7-11)	95	97.38	97.62	7.72	0.84	1.21	1.19	7.47	7.42	7.46	56
超長期 (11-)	25	88.78	89.07	15.35	1.13	2.11	1.99	13.81	13.67	13.75	64
ゴム製品	330	98.45	98.57	3.78	0.39	0.80	0.79	3.72	3.70	3.72	36
短期 (1-3)	158	99.19	99.28	2.20	0.30	0.68	0.68	2.19	2.18	2.19	33
中期 (3-7)	147	97.94	98.08	4.76	0.41	0.86	0.85	4.70	4.68	4.70	38
長期 (7-)	25	96.85	96.98	8.00	0.76	1.20	1.19	7.75	7.71	7.75	52
長期 (7-11)	25	96.85	96.98	8.00	0.76	1.20	1.19	7.75	7.71	7.75	52
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
ガラス・土石製品	282	97.02	97.14	5.18	0.49	0.96	0.94	4.87	4.84	4.86	42
短期 (1-3)	98	99.36	99.44	1.76	0.26	0.62	0.62	1.75	1.75	1.75	31
中期 (3-7)	107	98.06	98.18	4.38	0.46	0.90	0.90	4.33	4.31	4.33	44
長期 (7-)	77	92.63	92.79	10.61	0.81	1.50	1.43	9.87	9.79	9.86	53
長期 (7-11)	52	97.26	97.45	8.46	0.82	1.18	1.17	8.17	8.13	8.17	45
超長期 (11-)	25	82.94	83.04	15.09	0.80	2.29	2.09	14.04	13.89	14.00	73
鉄鋼	458	98.56	98.68	4.18	0.53	0.89	0.88	4.07	4.05	4.06	42
短期 (1-3)	160	99.15	99.21	2.06	0.28	0.70	0.70	2.06	2.05	2.06	36
中期 (3-7)	245	98.56	98.69	4.39	0.57	0.90	0.89	4.33	4.31	4.33	43
長期 (7-)	53	96.82	97.06	9.62	1.09	1.40	1.38	9.03	8.97	9.02	55
長期 (7-11)	43	98.97	99.20	8.67	1.12	1.26	1.25	8.26	8.21	8.26	51
超長期 (11-)	10	87.58	87.86	13.70	0.95	2.12	1.99	12.77	12.64	12.74	74
非鉄金属	380	98.47	98.60	4.27	0.47	0.87	0.86	4.19	4.17	4.19	40
短期 (1-3)	140	99.02	99.06	2.16	0.27	0.75	0.74	2.16	2.15	2.16	39
中期 (3-7)	190	98.26	98.42	4.64	0.53	0.90	0.90	4.57	4.55	4.57	43
長期 (7-)	50	97.79	97.96	8.78	0.81	1.09	1.07	8.48	8.43	8.48	32
長期 (7-11)	50	97.79	97.96	8.78	0.81	1.09	1.07	8.48	8.43	8.48	32
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
金属製品	186	98.88	98.99	3.87	0.54	0.86	0.85	3.81	3.80	3.81	42
短期 (1-3)	75	99.07	99.12	2.39	0.36	0.77	0.77	2.38	2.37	2.38	41
中期 (3-7)	102	98.94	99.11	4.61	0.66	0.89	0.89	4.53	4.51	4.53	42
長期 (7-)	9	96.45	96.51	7.91	0.70	1.20	1.18	7.70	7.65	7.69	52
長期 (7-11)	9	96.45	96.51	7.91	0.70	1.20	1.18	7.70	7.65	7.69	52
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
機械	1,347	98.46	98.57	4.38	0.46	0.85	0.84	4.29	4.27	4.29	38
短期 (1-3)	515	99.18	99.24	2.13	0.29	0.69	0.69	2.12	2.11	2.12	35
中期 (3-7)	605	98.09	98.20	4.81	0.47	0.87	0.87	4.74	4.72	4.74	39
長期 (7-)	227	97.84	98.04	8.38	0.82	1.13	1.12	8.09	8.04	8.09	41
長期 (7-11)	227	97.84	98.04	8.38	0.82	1.13	1.12	8.09	8.04	8.09	41
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
電気機器	2,070	98.81	98.90	4.18	0.52	0.84	0.83	4.09	4.07	4.09	38
短期 (1-3)	755	99.34	99.39	2.02	0.34	0.67	0.67	2.01	2.01	2.01	33
中期 (3-7)	1,040	98.48	98.58	4.55	0.52	0.86	0.85	4.49	4.47	4.49	39
長期 (7-)	275	98.61	98.76	8.66	1.02	1.22	1.21	8.29	8.24	8.29	47
長期 (7-11)	275	98.61	98.76	8.66	1.02	1.22	1.21	8.29	8.24	8.29	47
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
輸送用機器	1,150	97.79	97.88	4.43	0.43	0.89	0.88	4.25	4.23	4.25	40
短期 (1-3)	544	99.10	99.15	1.98	0.26	0.73	0.72	1.97	1.97	1.97	39
中期 (3-7)	397	98.14	98.23	4.66	0.48	0.87	0.86	4.59	4.57	4.59	39
長期 (7-)	209	93.70	93.90	10.36	0.76	1.39	1.34	9.81	9.75	9.81	44
長期 (7-11)	119	97.79	98.05	8.48	0.82	1.13	1.12	8.18	8.13	8.17	40
超長期 (11-)	90	88.28	88.41	12.85	0.67	1.78	1.68	12.22	12.11	12.20	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 (2/4) (2024年9月末、10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	265	96.73	96.87	6.62	0.60	1.10	1.08	6.28	6.24	6.27	48
短期 (1-3)	50	99.12	99.17	2.24	0.30	0.72	0.71	2.23	2.23	2.23	36
中期 (3-7)	95	96.90	96.97	5.52	0.39	0.96	0.94	5.44	5.42	5.44	44
長期 (7-)	120	95.59	95.84	9.31	0.90	1.38	1.35	8.69	8.63	8.68	57
長期 (7-11)	95	97.38	97.62	7.72	0.84	1.21	1.19	7.47	7.42	7.46	56
超長期 (11-)	25	88.78	89.07	15.35	1.13	2.11	1.99	13.81	13.67	13.75	64
ゴム製品	330	98.45	98.57	3.78	0.39	0.80	0.79	3.72	3.70	3.72	36
短期 (1-3)	158	99.19	99.28	2.20	0.30	0.68	0.68	2.19	2.18	2.19	33
中期 (3-7)	147	97.94	98.08	4.76	0.41	0.86	0.85	4.70	4.68	4.70	38
長期 (7-)	25	96.85	96.98	8.00	0.76	1.20	1.19	7.75	7.71	7.75	52
長期 (7-11)	25	96.85	96.98	8.00	0.76	1.20	1.19	7.75	7.71	7.75	52
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
ガラス・土石製品	262	96.81	96.93	5.50	0.51	1.00	0.98	5.17	5.14	5.16	43
短期 (1-3)	78	99.26	99.33	1.95	0.26	0.66	0.66	1.94	1.94	1.94	33
中期 (3-7)	107	98.06	98.18	4.38	0.46	0.90	0.90	4.33	4.31	4.33	44
長期 (7-)	77	92.63	92.79	10.61	0.81	1.50	1.43	9.87	9.79	9.86	53
長期 (7-11)	52	97.26	97.45	8.46	0.82	1.18	1.17	8.17	8.13	8.17	45
超長期 (11-)	25	82.94	83.04	15.09	0.80	2.29	2.09	14.04	13.89	14.00	73
鉄鋼	458	98.56	98.68	4.18	0.53	0.89	0.88	4.07	4.05	4.06	42
短期 (1-3)	160	99.15	99.21	2.06	0.28	0.70	0.70	2.06	2.05	2.06	36
中期 (3-7)	245	98.56	98.69	4.39	0.57	0.90	0.89	4.33	4.31	4.33	43
長期 (7-)	53	96.82	97.06	9.62	1.09	1.40	1.38	9.03	8.97	9.02	55
長期 (7-11)	43	98.97	99.20	8.67	1.12	1.26	1.25	8.26	8.21	8.26	51
超長期 (11-)	10	87.58	87.86	13.70	0.95	2.12	1.99	12.77	12.64	12.74	74
非鉄金属	380	98.47	98.60	4.27	0.47	0.87	0.86	4.19	4.17	4.19	40
短期 (1-3)	155	98.99	99.05	2.25	0.28	0.75	0.74	2.24	2.23	2.24	39
中期 (3-7)	175	98.22	98.38	4.78	0.55	0.92	0.91	4.70	4.68	4.70	44
長期 (7-)	50	97.79	97.96	8.78	0.81	1.09	1.07	8.48	8.43	8.48	32
長期 (7-11)	50	97.79	97.96	8.78	0.81	1.09	1.07	8.48	8.43	8.48	32
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
金属製品	186	98.88	98.99	3.87	0.54	0.86	0.85	3.81	3.80	3.81	42
短期 (1-3)	75	99.07	99.12	2.39	0.36	0.77	0.77	2.38	2.37	2.38	41
中期 (3-7)	102	98.94	99.11	4.61	0.66	0.89	0.89	4.53	4.51	4.53	42
長期 (7-)	9	96.45	96.51	7.91	0.70	1.20	1.18	7.70	7.65	7.69	52
長期 (7-11)	9	96.45	96.51	7.91	0.70	1.20	1.18	7.70	7.65	7.69	52
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
機械	1,322	98.44	98.55	4.45	0.47	0.85	0.84	4.35	4.34	4.35	38
短期 (1-3)	505	99.14	99.21	2.21	0.30	0.70	0.70	2.20	2.19	2.20	35
中期 (3-7)	590	98.07	98.18	4.85	0.48	0.88	0.87	4.78	4.76	4.78	39
長期 (7-)	227	97.84	98.04	8.38	0.82	1.13	1.12	8.09	8.04	8.09	41
長期 (7-11)	227	97.84	98.04	8.38	0.82	1.13	1.12	8.09	8.04	8.09	41
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
電気機器	2,070	98.81	98.90	4.18	0.52	0.84	0.83	4.09	4.07	4.09	38
短期 (1-3)	755	99.34	99.39	2.02	0.34	0.67	0.67	2.01	2.01	2.01	33
中期 (3-7)	1,040	98.48	98.58	4.55	0.52	0.86	0.85	4.49	4.47	4.49	39
長期 (7-)	275	98.61	98.76	8.66	1.02	1.22	1.21	8.29	8.24	8.29	47
長期 (7-11)	275	98.61	98.76	8.66	1.02	1.22	1.21	8.29	8.24	8.29	47
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
輸送用機器	1,150	97.79	97.88	4.43	0.43	0.89	0.88	4.25	4.23	4.25	40
短期 (1-3)	544	99.10	99.15	1.98	0.26	0.73	0.72	1.97	1.97	1.97	39
中期 (3-7)	397	98.14	98.23	4.66	0.48	0.87	0.86	4.59	4.57	4.59	39
長期 (7-)	209	93.70	93.90	10.36	0.76	1.39	1.34	9.81	9.75	9.81	44
長期 (7-11)	119	97.79	98.05	8.48	0.82	1.13	1.12	8.18	8.13	8.17	40
超長期 (11-)	90	88.28	88.41	12.85	0.67	1.78	1.68	12.22	12.11	12.20	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 (3/4) (2024年9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	98.53	98.76	4.44	0.58	0.91	0.90	4.33	4.31	4.33	44
短期 (1-3)	80	99.55	99.71	2.15	0.39	0.64	0.64	2.14	2.13	2.14	29
中期 (3-7)	125	98.21	98.41	4.88	0.60	0.96	0.95	4.80	4.77	4.80	48
長期 (7-)	35	97.39	97.82	8.13	0.97	1.34	1.32	7.79	7.73	7.78	64
長期 (7-11)	35	97.39	97.82	8.13	0.97	1.34	1.32	7.79	7.73	7.78	64
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
その他製品	195	95.74	95.84	6.79	0.53	1.05	1.02	6.37	6.33	6.37	39
短期 (1-3)	30	99.00	99.11	2.02	0.41	0.91	0.90	2.01	2.00	2.01	56
中期 (3-7)	120	98.41	98.52	5.18	0.52	0.84	0.83	5.11	5.09	5.11	34
長期 (7-)	45	86.47	86.51	14.27	0.63	1.80	1.68	13.54	13.42	13.52	38
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	45	86.47	86.51	14.27	0.63	1.80	1.68	13.54	13.42	13.52	38
電気・ガス業	12,390	95.50	95.73	8.08	0.81	1.23	1.19	7.10	7.05	7.08	49
短期 (1-3)	2,702	99.56	99.69	2.08	0.46	0.67	0.67	2.07	2.06	2.07	33
中期 (3-7)	4,260	98.69	98.89	4.94	0.74	0.98	0.97	4.84	4.82	4.84	49
長期 (7-)	5,429	90.96	91.27	13.52	1.04	1.75	1.66	11.76	11.66	11.71	57
長期 (7-11)	2,571	97.65	97.99	8.74	1.04	1.35	1.34	8.32	8.27	8.32	59
超長期 (11-)	2,858	84.95	85.23	17.82	1.03	2.17	2.00	15.32	15.17	15.22	55
陸運業	6,085	91.32	91.43	13.23	1.01	1.40	1.30	10.15	10.06	10.03	36
短期 (1-3)	747	100.57	100.66	1.95	0.84	0.62	0.62	1.93	1.93	1.93	29
中期 (3-7)	1,733	100.93	101.03	5.04	1.05	0.81	0.81	4.91	4.89	4.91	33
長期 (7-)	3,605	84.78	84.89	19.52	1.03	1.94	1.75	15.17	15.02	14.96	38
長期 (7-11)	1,044	100.33	100.46	8.91	1.16	1.12	1.12	8.46	8.42	8.46	36
超長期 (11-)	2,561	78.44	78.55	23.84	0.98	2.36	2.08	18.67	18.47	18.35	40
海運業	163	99.53	99.75	5.09	0.92	0.98	0.98	4.92	4.90	4.92	47
短期 (1-3)	20	101.20	101.58	1.78	1.46	0.74	0.74	1.75	1.75	1.75	41
中期 (3-7)	113	99.54	99.69	4.54	0.76	0.93	0.93	4.46	4.44	4.46	46
長期 (7-)	30	98.38	98.77	9.33	1.14	1.34	1.33	8.84	8.78	8.84	52
長期 (7-11)	30	98.38	98.77	9.33	1.14	1.34	1.33	8.84	8.78	8.84	52
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
空運業	315	94.77	95.06	8.05	0.98	1.59	1.54	7.28	7.22	7.27	79
短期 (1-3)	90	99.40	99.52	1.87	0.65	0.98	0.98	1.86	1.85	1.86	65
中期 (3-7)	40	96.36	96.46	4.60	0.36	1.18	1.16	4.56	4.53	4.56	69
長期 (7-)	185	92.18	92.59	11.80	1.28	2.00	1.91	10.73	10.63	10.71	88
長期 (7-11)	85	100.16	100.69	9.42	1.53	1.52	1.52	8.76	8.70	8.76	70
超長期 (11-)	100	85.40	85.71	13.82	1.07	2.49	2.30	12.70	12.55	12.67	106
倉庫・運輸関連業	154	95.91	95.98	6.51	0.57	1.18	1.15	6.20	6.16	6.19	55
短期 (1-3)	12	99.88	100.01	1.14	0.42	0.54	0.54	1.14	1.14	1.14	29
中期 (3-7)	105	96.80	96.86	5.21	0.46	1.10	1.08	5.13	5.10	5.13	60
長期 (7-)	37	92.04	92.12	12.04	0.93	1.63	1.55	11.23	11.14	11.22	49
長期 (7-11)	17	99.12	99.17	9.26	1.18	1.29	1.28	8.79	8.74	8.79	48
超長期 (11-)	20	86.20	86.31	14.33	0.72	1.95	1.81	13.54	13.42	13.52	51
情報・通信業	2,524	97.71	97.92	4.56	0.91	1.34	1.32	4.27	4.23	4.26	84
短期 (1-3)	963	99.42	99.59	1.96	0.71	1.04	1.04	1.95	1.94	1.95	71
中期 (3-7)	1,153	98.17	98.40	4.67	0.89	1.30	1.29	4.55	4.52	4.55	82
長期 (7-)	408	92.33	92.63	10.38	1.40	2.26	2.15	9.29	9.19	9.27	127
長期 (7-11)	290	96.21	96.46	8.74	1.27	1.81	1.77	8.26	8.19	8.26	102
超長期 (11-)	118	82.76	83.17	14.40	1.73	3.55	3.24	12.24	12.04	12.17	200
卸売業	1,297	98.39	98.59	6.31	0.90	1.04	1.03	5.96	5.93	5.96	44
短期 (1-3)	203	100.32	100.60	2.00	0.93	0.77	0.77	1.98	1.97	1.98	43
中期 (3-7)	647	99.75	99.94	4.81	0.84	0.91	0.91	4.71	4.69	4.71	43
長期 (7-)	447	95.53	95.72	10.44	0.97	1.38	1.34	9.76	9.69	9.75	44
長期 (7-11)	302	99.10	99.32	8.70	1.05	1.16	1.15	8.31	8.27	8.31	41
超長期 (11-)	145	88.11	88.25	14.06	0.82	1.89	1.77	13.15	13.04	13.12	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9月末、10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	98.53	98.76	4.44	0.58	0.91	0.90	4.33	4.31	4.33	44
短期 (1-3)	80	99.55	99.71	2.15	0.39	0.64	0.64	2.14	2.13	2.14	29
中期 (3-7)	125	98.21	98.41	4.88	0.60	0.96	0.95	4.80	4.77	4.80	48
長期 (7-)	35	97.39	97.82	8.13	0.97	1.34	1.32	7.79	7.73	7.78	64
長期 (7-11)	35	97.39	97.82	8.13	0.97	1.34	1.32	7.79	7.73	7.78	64
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
その他製品	195	95.74	95.84	6.79	0.53	1.05	1.02	6.37	6.33	6.37	39
短期 (1-3)	30	99.00	99.11	2.02	0.41	0.91	0.90	2.01	2.00	2.01	56
中期 (3-7)	120	98.41	98.52	5.18	0.52	0.84	0.83	5.11	5.09	5.11	34
長期 (7-)	45	86.47	86.51	14.27	0.63	1.80	1.68	13.54	13.42	13.52	38
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	45	86.47	86.51	14.27	0.63	1.80	1.68	13.54	13.42	13.52	38
電気・ガス業	12,269	95.45	95.68	8.16	0.81	1.24	1.20	7.18	7.12	7.16	49
短期 (1-3)	2,686	99.55	99.69	2.18	0.48	0.69	0.69	2.17	2.16	2.17	34
中期 (3-7)	4,221	98.59	98.78	5.04	0.73	0.98	0.98	4.93	4.91	4.93	50
長期 (7-)	5,362	90.93	91.24	13.61	1.05	1.76	1.67	11.83	11.73	11.78	57
長期 (7-11)	2,525	97.70	98.04	8.82	1.06	1.36	1.35	8.39	8.33	8.39	59
超長期 (11-)	2,838	84.91	85.19	17.87	1.04	2.18	2.01	15.36	15.20	15.25	55
陸運業	6,080	91.31	91.42	13.28	1.02	1.41	1.31	10.19	10.10	10.07	36
短期 (1-3)	732	100.56	100.65	1.99	0.84	0.63	0.63	1.98	1.97	1.98	30
中期 (3-7)	1,728	100.94	101.04	5.05	1.06	0.81	0.81	4.92	4.90	4.92	33
長期 (7-)	3,620	84.85	84.96	19.49	1.03	1.93	1.75	15.16	15.01	14.94	38
長期 (7-11)	1,054	100.34	100.48	8.91	1.16	1.12	1.12	8.47	8.42	8.47	36
超長期 (11-)	2,566	78.48	78.59	23.83	0.98	2.36	2.08	18.67	18.46	18.34	40
海運業	169	99.53	99.75	5.08	0.92	0.98	0.98	4.92	4.89	4.92	47
短期 (1-3)	20	101.20	101.58	1.78	1.46	0.74	0.74	1.75	1.75	1.75	41
中期 (3-7)	119	99.55	99.69	4.56	0.77	0.93	0.93	4.48	4.46	4.48	46
長期 (7-)	30	98.38	98.77	9.33	1.14	1.34	1.33	8.84	8.78	8.84	52
長期 (7-11)	30	98.38	98.77	9.33	1.14	1.34	1.33	8.84	8.78	8.84	52
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
空運業	315	94.77	95.06	8.05	0.98	1.59	1.54	7.28	7.22	7.27	79
短期 (1-3)	90	99.40	99.52	1.87	0.65	0.98	0.98	1.86	1.85	1.86	65
中期 (3-7)	40	96.36	96.46	4.60	0.36	1.18	1.16	4.56	4.53	4.56	69
長期 (7-)	185	92.18	92.59	11.80	1.28	2.00	1.91	10.73	10.63	10.71	88
長期 (7-11)	85	100.16	100.69	9.42	1.53	1.52	1.52	8.76	8.70	8.76	70
超長期 (11-)	100	85.40	85.71	13.82	1.07	2.49	2.30	12.70	12.55	12.67	106
倉庫・運輸関連業	159	96.05	96.13	6.46	0.61	1.18	1.15	6.15	6.11	6.14	56
短期 (1-3)	17	100.05	100.17	2.21	0.82	0.79	0.79	2.19	2.18	2.19	44
中期 (3-7)	105	96.80	96.86	5.21	0.46	1.10	1.08	5.13	5.10	5.13	60
長期 (7-)	37	92.04	92.12	12.04	0.93	1.63	1.55	11.23	11.14	11.22	49
長期 (7-11)	17	99.12	99.17	9.26	1.18	1.29	1.28	8.79	8.74	8.79	48
超長期 (11-)	20	86.20	86.31	14.33	0.72	1.95	1.81	13.54	13.42	13.52	51
情報・通信業	2,474	97.67	97.88	4.63	0.92	1.36	1.34	4.33	4.30	4.33	86
短期 (1-3)	963	99.39	99.56	2.07	0.72	1.05	1.05	2.05	2.04	2.05	71
中期 (3-7)	1,123	98.05	98.28	4.78	0.91	1.33	1.31	4.66	4.63	4.66	84
長期 (7-)	388	92.26	92.56	10.55	1.45	2.30	2.18	9.42	9.31	9.40	129
長期 (7-11)	270	96.40	96.65	8.87	1.33	1.83	1.79	8.36	8.29	8.36	103
超長期 (11-)	118	82.76	83.17	14.40	1.73	3.55	3.24	12.24	12.04	12.17	200
卸売業	1,297	98.39	98.59	6.31	0.90	1.04	1.03	5.96	5.93	5.96	44
短期 (1-3)	203	100.32	100.60	2.00	0.93	0.77	0.77	1.98	1.97	1.98	43
中期 (3-7)	647	99.75	99.94	4.81	0.84	0.91	0.91	4.71	4.69	4.71	43
長期 (7-)	447	95.53	95.72	10.44	0.97	1.38	1.34	9.76	9.69	9.75	44
長期 (7-11)	302	99.10	99.32	8.70	1.05	1.16	1.15	8.31	8.27	8.31	41
超長期 (11-)	145	88.11	88.25	14.06	0.82	1.89	1.77	13.15	13.04	13.12	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 (4/4) (2024年9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	1,274	98.92	99.10	3.98	0.61	0.88	0.87	3.84	3.82	3.84	42
短期 (1-3)	530	99.46	99.56	1.71	0.36	0.65	0.65	1.70	1.69	1.70	34
中期 (3-7)	553	99.15	99.34	4.22	0.68	0.90	0.90	4.15	4.13	4.15	45
長期 (7-)	191	96.75	97.11	9.61	1.10	1.46	1.44	9.02	8.96	9.01	61
長期 (7-11)	151	98.55	98.94	8.53	1.15	1.38	1.38	8.10	8.05	8.10	65
超長期 (11-)	40	89.95	90.20	13.68	0.88	1.80	1.71	12.83	12.72	12.80	46
銀行業	1,437	100.46	100.80	3.43	1.24	1.02	1.02	3.33	3.32	3.33	61
短期 (1-3)	732	100.84	101.24	1.92	1.41	0.95	0.95	1.89	1.88	1.89	62
中期 (3-7)	667	100.09	100.36	4.75	1.05	1.08	1.08	4.63	4.60	4.63	61
長期 (7-)	38	99.69	99.97	9.15	1.16	1.22	1.22	8.67	8.62	8.67	43
長期 (7-11)	38	99.69	99.97	9.15	1.16	1.22	1.22	8.67	8.62	8.67	43
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
証券・商品先物取引業	949	99.36	99.57	2.36	0.86	1.11	1.10	2.33	2.31	2.33	75
短期 (1-3)	735	99.46	99.66	1.89	0.84	1.08	1.08	1.87	1.86	1.87	75
中期 (3-7)	210	99.13	99.34	3.88	0.94	1.17	1.17	3.81	3.79	3.81	73
長期 (7-)	5	95.11	95.17	7.93	0.90	1.60	1.56	7.65	7.60	7.65	90
長期 (7-11)	5	95.11	95.17	7.93	0.90	1.60	1.56	7.65	7.60	7.65	90
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
保険業	330	98.50	98.67	3.49	0.38	0.83	0.83	3.42	3.40	3.42	40
短期 (1-3)	160	98.89	98.96	2.16	0.20	0.73	0.72	2.16	2.15	2.16	37
中期 (3-7)	120	98.86	99.06	3.35	0.46	0.81	0.80	3.32	3.31	3.32	39
長期 (7-)	50	96.41	96.76	8.04	0.75	1.24	1.22	7.78	7.74	7.78	55
長期 (7-11)	50	96.41	96.76	8.04	0.75	1.24	1.22	7.78	7.74	7.78	55
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
その他金融業	6,585	98.73	98.86	3.86	0.50	0.84	0.83	3.76	3.74	3.76	40
短期 (1-3)	2,920	99.31	99.39	1.88	0.34	0.72	0.72	1.88	1.87	1.88	39
中期 (3-7)	3,025	98.62	98.76	4.62	0.56	0.85	0.85	4.55	4.53	4.55	38
長期 (7-)	641	96.66	96.84	9.26	0.96	1.35	1.31	8.77	8.71	8.77	52
長期 (7-11)	563	98.08	98.23	8.59	0.96	1.24	1.22	8.25	8.20	8.25	49
超長期 (11-)	78	86.43	86.79	14.11	0.96	2.20	2.05	13.01	12.87	12.98	78
不動産業	2,652	95.88	96.05	7.57	0.74	1.16	1.12	6.61	6.56	6.58	46
短期 (1-3)	555	99.43	99.53	2.26	0.49	0.76	0.76	2.25	2.24	2.25	40
中期 (3-7)	1,076	98.48	98.64	4.74	0.63	0.93	0.92	4.66	4.64	4.66	45
長期 (7-)	1,021	91.21	91.44	13.45	1.01	1.65	1.56	11.40	11.30	11.33	51
長期 (7-11)	548	98.47	98.73	8.57	1.02	1.21	1.20	8.19	8.15	8.19	47
超長期 (11-)	473	82.80	82.98	19.10	1.00	2.26	2.05	15.81	15.65	15.65	57
サービス業	754	91.82	92.00	5.09	0.65	2.09	1.94	4.64	4.58	4.63	144
短期 (1-3)	262	97.80	97.89	2.09	0.37	1.43	1.41	2.08	2.06	2.08	107
中期 (3-7)	282	97.20	97.33	4.84	0.55	1.16	1.13	4.77	4.75	4.77	66
長期 (7-)	210	77.14	77.50	9.18	1.14	4.72	4.13	8.44	8.27	8.43	335
長期 (7-11)	160	79.77	80.10	8.06	1.04	4.43	3.95	7.62	7.47	7.62	327
超長期 (11-)	50	68.73	69.18	12.75	1.45	5.79	4.80	11.48	11.22	11.45	365
財投機関債	20,722	96.32	96.48	9.38	0.81	1.00	0.96	7.80	7.74	7.74	19
短期 (1-3)	5,815	99.78	99.84	2.00	0.39	0.51	0.51	2.00	1.99	2.00	17
中期 (3-7)	6,249	100.35	100.48	4.63	0.73	0.64	0.64	4.55	4.53	4.55	18
長期 (7-)	8,658	91.08	91.33	17.76	1.14	1.64	1.55	14.64	14.51	14.50	21
長期 (7-11)	2,526	101.40	101.64	8.81	1.10	0.93	0.94	8.39	8.35	8.38	19
超長期 (11-)	6,132	86.83	87.08	21.45	1.16	1.99	1.85	17.64	17.47	17.44	22

出所:NFRC

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

## 事業債 業種別・ポートフォリオ指標 (4/4) (2024年9月末、10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	1,279	98.93	99.10	3.98	0.61	0.88	0.88	3.84	3.82	3.84	43
短期 (1-3)	535	99.47	99.57	1.72	0.37	0.66	0.66	1.71	1.70	1.71	35
中期 (3-7)	583	98.91	99.09	4.36	0.66	0.92	0.92	4.29	4.27	4.29	46
長期 (7-)	161	97.19	97.58	10.09	1.23	1.50	1.48	9.40	9.33	9.39	60
長期 (7-11)	121	99.59	100.03	8.90	1.34	1.41	1.41	8.37	8.31	8.37	65
超長期 (11-)	40	89.95	90.20	13.68	0.88	1.80	1.71	12.83	12.72	12.80	46
銀行業	1,407	100.46	100.79	3.48	1.23	1.02	1.02	3.38	3.36	3.38	61
短期 (1-3)	702	100.85	101.24	1.95	1.41	0.95	0.95	1.93	1.92	1.93	62
中期 (3-7)	667	100.09	100.36	4.75	1.05	1.08	1.08	4.63	4.60	4.63	61
長期 (7-)	38	99.69	99.97	9.15	1.16	1.22	1.22	8.67	8.62	8.67	43
長期 (7-11)	38	99.69	99.97	9.15	1.16	1.22	1.22	8.67	8.62	8.67	43
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
証券、商品先物取引業	949	99.36	99.57	2.36	0.86	1.11	1.10	2.33	2.31	2.33	75
短期 (1-3)	735	99.46	99.66	1.89	0.84	1.08	1.08	1.87	1.86	1.87	75
中期 (3-7)	210	99.13	99.34	3.88	0.94	1.17	1.17	3.81	3.79	3.81	73
長期 (7-)	5	95.11	95.17	7.93	0.90	1.60	1.56	7.65	7.60	7.65	90
長期 (7-11)	5	95.11	95.17	7.93	0.90	1.60	1.56	7.65	7.60	7.65	90
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
保険業	330	98.50	98.67	3.49	0.38	0.83	0.83	3.42	3.40	3.42	40
短期 (1-3)	210	98.89	99.00	2.37	0.26	0.74	0.74	2.36	2.35	2.36	37
中期 (3-7)	70	98.83	99.04	3.57	0.48	0.82	0.81	3.54	3.53	3.54	39
長期 (7-)	50	96.41	96.76	8.04	0.75	1.24	1.22	7.78	7.74	7.78	55
長期 (7-11)	50	96.41	96.76	8.04	0.75	1.24	1.22	7.78	7.74	7.78	55
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
その他金融業	6,468	98.72	98.84	3.92	0.50	0.85	0.84	3.82	3.80	3.82	40
短期 (1-3)	2,832	99.29	99.37	1.94	0.34	0.73	0.73	1.93	1.92	1.93	39
中期 (3-7)	2,995	98.62	98.76	4.64	0.56	0.85	0.85	4.57	4.55	4.57	38
長期 (7-)	641	96.66	96.84	9.26	0.96	1.35	1.31	8.77	8.71	8.77	52
長期 (7-11)	563	98.08	98.23	8.59	0.96	1.24	1.22	8.25	8.20	8.25	49
超長期 (11-)	78	86.43	86.79	14.11	0.96	2.20	2.05	13.01	12.87	12.98	78
不動産業	2,658	95.89	96.06	7.58	0.75	1.16	1.12	6.62	6.57	6.59	47
短期 (1-3)	570	99.69	99.84	2.32	0.58	0.76	0.76	2.30	2.29	2.30	40
中期 (3-7)	1,077	98.30	98.45	4.80	0.59	0.94	0.94	4.72	4.70	4.72	46
長期 (7-)	1,011	91.18	91.40	13.51	1.01	1.66	1.56	11.44	11.34	11.37	51
長期 (7-11)	538	98.54	98.80	8.60	1.03	1.21	1.20	8.22	8.17	8.21	47
超長期 (11-)	473	82.80	82.98	19.10	1.00	2.26	2.05	15.81	15.65	15.65	57
サービス業	854	92.80	92.97	5.61	0.72	1.97	1.84	5.19	5.14	5.19	130
短期 (1-3)	242	97.64	97.73	2.17	0.38	1.51	1.48	2.16	2.15	2.16	113
中期 (3-7)	342	97.70	97.82	5.08	0.60	1.10	1.08	5.01	4.98	5.01	60
長期 (7-)	270	82.27	82.57	9.34	1.16	3.77	3.35	8.68	8.54	8.67	255
長期 (7-11)	220	85.34	85.61	8.57	1.10	3.40	3.08	8.17	8.05	8.16	234
超長期 (11-)	50	68.73	69.18	12.75	1.45	5.79	4.80	11.48	11.22	11.45	365
財投機関債	20,790	96.33	96.49	9.41	0.81	1.00	0.97	7.83	7.77	7.77	19
短期 (1-3)	5,804	99.81	99.88	2.04	0.41	0.51	0.51	2.03	2.03	2.03	17
中期 (3-7)	6,381	100.29	100.42	4.70	0.72	0.64	0.65	4.61	4.60	4.61	18
長期 (7-)	8,605	91.04	91.29	17.88	1.15	1.65	1.56	14.73	14.60	14.59	21
長期 (7-11)	2,471	101.40	101.64	8.90	1.11	0.94	0.95	8.47	8.43	8.46	19
超長期 (11-)	6,134	86.87	87.12	21.49	1.16	1.99	1.85	17.67	17.50	17.47	22

出所:NFRC

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

## 事業債 円建外債 格付別・ポートフォリオ指標(2024年9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	74,418	96.59	96.76	7.24	0.76	1.08	1.05	6.22	6.18	6.19	41
短期 (1-3)	23,015	99.56	99.68	2.00	0.50	0.72	0.72	1.99	1.99	1.99	38
中期 (3-7)	27,434	99.17	99.33	4.67	0.71	0.88	0.87	4.58	4.56	4.58	41
長期 (7-)	23,970	90.79	91.03	15.20	1.07	1.71	1.61	12.72	12.61	12.63	44
長期 (7-11)	10,432	98.64	98.89	8.65	1.04	1.23	1.22	8.26	8.20	8.25	48
超長期 (11-)	13,538	84.74	84.98	20.25	1.09	2.14	1.96	16.73	16.56	16.55	40
AAA~A 格	73,409	96.56	96.73	7.28	0.75	1.08	1.05	6.25	6.21	6.22	40
短期 (1-3)	22,556	99.57	99.68	2.00	0.49	0.71	0.71	1.99	1.99	1.99	38
中期 (3-7)	26,994	99.18	99.33	4.66	0.70	0.87	0.87	4.58	4.56	4.58	40
長期 (7-)	23,859	90.77	91.01	15.21	1.06	1.71	1.61	12.73	12.62	12.63	44
長期 (7-11)	10,380	98.63	98.88	8.64	1.04	1.23	1.22	8.25	8.20	8.25	48
超長期 (11-)	13,479	84.72	84.95	20.27	1.08	2.13	1.96	16.75	16.58	16.56	40
AAA~AA 格	52,836	96.28	96.44	7.97	0.74	1.02	0.99	6.70	6.66	6.66	31
短期 (1-3)	15,659	99.66	99.76	1.99	0.44	0.62	0.62	1.98	1.97	1.98	29
中期 (3-7)	18,702	99.49	99.63	4.67	0.68	0.78	0.78	4.59	4.57	4.59	31
長期 (7-)	18,474	90.17	90.38	16.39	1.04	1.66	1.56	13.49	13.37	13.37	32
長期 (7-11)	7,327	99.34	99.56	8.65	0.99	1.09	1.08	8.28	8.23	8.27	34
超長期 (11-)	11,147	84.14	84.35	21.47	1.07	2.11	1.93	17.53	17.35	17.32	31
AAA 格	11,588	97.57	97.66	5.45	0.43	0.74	0.73	4.73	4.70	4.70	22
短期 (1-3)	4,650	99.37	99.41	1.95	0.20	0.53	0.53	1.94	1.94	1.94	20
中期 (3-7)	5,003	98.95	99.04	4.61	0.47	0.68	0.68	4.55	4.53	4.55	21
長期 (7-)	1,935	89.72	89.92	16.05	0.92	1.49	1.38	12.62	12.52	12.48	27
長期 (7-11)	1,123	98.77	98.96	8.55	0.83	1.00	1.00	8.25	8.20	8.24	27
超長期 (11-)	812	77.20	77.41	26.42	1.03	2.36	2.06	20.36	20.14	19.98	27
AA 格	41,247	95.92	96.09	8.68	0.82	1.10	1.06	7.27	7.21	7.22	34
短期 (1-3)	11,010	99.79	99.91	2.00	0.54	0.66	0.66	1.99	1.98	1.99	32
中期 (3-7)	13,698	99.69	99.85	4.69	0.76	0.82	0.82	4.60	4.58	4.60	35
長期 (7-)	16,539	90.22	90.44	16.43	1.05	1.68	1.58	13.59	13.47	13.47	33
長期 (7-11)	6,204	99.45	99.67	8.66	1.02	1.10	1.10	8.28	8.24	8.28	36
超長期 (11-)	10,335	84.68	84.89	21.09	1.08	2.09	1.92	17.33	17.15	17.12	31
A 格	20,573	97.29	97.50	5.49	0.80	1.22	1.20	5.11	5.08	5.11	65
短期 (1-3)	6,897	99.34	99.49	2.05	0.60	0.93	0.92	2.03	2.02	2.03	59
中期 (3-7)	8,292	98.47	98.65	4.66	0.75	1.08	1.07	4.57	4.54	4.57	60
長期 (7-)	5,384	92.84	93.17	11.18	1.14	1.86	1.78	10.22	10.13	10.20	82
長期 (7-11)	3,052	96.93	97.26	8.64	1.15	1.58	1.55	8.20	8.13	8.19	81
超長期 (11-)	2,332	87.49	87.82	14.51	1.12	2.26	2.12	13.15	13.02	13.11	83
BBB 格	1,009	98.72	98.99	4.32	0.95	1.23	1.23	4.06	4.04	4.06	75
短期 (1-3)	458	99.50	99.71	1.95	0.78	1.06	1.05	1.94	1.93	1.94	72
中期 (3-7)	440	98.85	99.12	4.74	0.98	1.22	1.22	4.61	4.58	4.61	75
長期 (7-)	111	94.98	95.47	12.43	1.57	2.06	2.01	10.99	10.88	10.95	94
長期 (7-11)	52	99.05	99.56	8.96	1.56	1.70	1.69	8.34	8.27	8.33	93
超長期 (11-)	59	91.38	91.86	15.50	1.58	2.41	2.31	13.54	13.39	13.46	95

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9月末、10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	74,279	96.59	96.76	7.29	0.76	1.08	1.05	6.28	6.23	6.25	41
短期 (1-3)	22,999	99.57	99.69	2.07	0.51	0.73	0.73	2.06	2.05	2.06	39
中期 (3-7)	27,704	99.09	99.25	4.75	0.70	0.89	0.88	4.67	4.64	4.67	41
長期 (7-)	23,576	90.74	90.98	15.37	1.08	1.72	1.62	12.85	12.74	12.75	44
長期 (7-11)	10,047	98.78	99.04	8.76	1.07	1.24	1.23	8.35	8.29	8.34	48
超長期 (11-)	13,530	84.76	85.00	20.28	1.09	2.14	1.96	16.75	16.58	16.57	40
AAA~A 格	73,297	96.56	96.73	7.33	0.76	1.08	1.05	6.31	6.26	6.28	41
短期 (1-3)	22,556	99.57	99.69	2.07	0.51	0.72	0.72	2.06	2.05	2.06	38
中期 (3-7)	27,276	99.10	99.25	4.75	0.70	0.88	0.88	4.67	4.65	4.67	40
長期 (7-)	23,465	90.72	90.96	15.38	1.08	1.72	1.62	12.86	12.75	12.76	44
長期 (7-11)	9,995	98.78	99.03	8.76	1.07	1.24	1.23	8.35	8.29	8.34	48
超長期 (11-)	13,471	84.74	84.97	20.30	1.09	2.14	1.96	16.77	16.60	16.58	40
AAA~AA 格	52,567	96.27	96.42	8.05	0.74	1.03	0.99	6.78	6.73	6.74	31
短期 (1-3)	15,528	99.67	99.77	2.06	0.45	0.63	0.62	2.04	2.04	2.04	28
中期 (3-7)	18,911	99.39	99.53	4.77	0.68	0.79	0.79	4.69	4.67	4.69	32
長期 (7-)	18,128	90.09	90.31	16.60	1.06	1.67	1.57	13.65	13.53	13.53	32
長期 (7-11)	6,994	99.55	99.77	8.79	1.03	1.09	1.09	8.40	8.35	8.39	34
超長期 (11-)	11,134	84.15	84.36	21.51	1.08	2.11	1.93	17.56	17.38	17.34	31
AAA 格	11,570	97.57	97.66	5.51	0.44	0.75	0.73	4.79	4.76	4.77	22
短期 (1-3)	4,560	99.36	99.40	2.00	0.20	0.53	0.53	2.00	1.99	2.00	20
中期 (3-7)	5,112	98.96	99.05	4.66	0.47	0.69	0.68	4.60	4.59	4.60	21
長期 (7-)	1,898	89.57	89.76	16.25	0.93	1.51	1.40	12.76	12.65	12.62	27
長期 (7-11)	1,096	98.75	98.94	8.66	0.85	1.02	1.01	8.34	8.30	8.34	27
超長期 (11-)	802	77.02	77.23	26.61	1.04	2.38	2.08	20.50	20.28	20.12	27
AA 格	40,997	95.90	96.07	8.77	0.83	1.11	1.07	7.35	7.29	7.30	33
短期 (1-3)	10,969	99.80	99.93	2.08	0.56	0.66	0.66	2.06	2.06	2.06	32
中期 (3-7)	13,798	99.55	99.70	4.82	0.75	0.83	0.83	4.72	4.70	4.72	35
長期 (7-)	16,230	90.15	90.37	16.65	1.07	1.69	1.59	13.76	13.63	13.63	33
長期 (7-11)	5,898	99.70	99.92	8.81	1.06	1.11	1.10	8.41	8.36	8.40	35
超長期 (11-)	10,332	84.71	84.92	21.12	1.08	2.09	1.92	17.35	17.17	17.15	31
A 格	20,730	97.31	97.52	5.51	0.81	1.23	1.20	5.13	5.09	5.12	65
短期 (1-3)	7,028	99.35	99.50	2.10	0.62	0.94	0.94	2.09	2.08	2.09	59
中期 (3-7)	8,365	98.44	98.62	4.71	0.75	1.08	1.07	4.61	4.59	4.61	60
長期 (7-)	5,337	92.84	93.17	11.23	1.15	1.87	1.79	10.26	10.17	10.24	82
長期 (7-11)	3,001	96.99	97.32	8.67	1.17	1.59	1.56	8.22	8.16	8.22	82
超長期 (11-)	2,336	87.51	87.84	14.53	1.13	2.26	2.12	13.16	13.02	13.12	83
BBB 格	982	98.73	99.01	4.34	0.97	1.24	1.23	4.08	4.05	4.08	76
短期 (1-3)	443	99.53	99.74	1.96	0.80	1.07	1.07	1.94	1.93	1.94	74
中期 (3-7)	428	98.89	99.16	4.72	0.99	1.22	1.21	4.59	4.56	4.59	75
長期 (7-)	111	94.98	95.47	12.43	1.57	2.06	2.01	10.99	10.88	10.95	94
長期 (7-11)	52	99.05	99.56	8.96	1.56	1.70	1.69	8.34	8.27	8.33	93
超長期 (11-)	59	91.38	91.86	15.50	1.58	2.41	2.31	13.54	13.39	13.46	95

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9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	51,383	96.19	96.34	8.11	0.73	1.02	0.99	6.81	6.76	6.77	30
短期(1-3)	14,891	99.66	99.76	1.99	0.43	0.61	0.61	1.98	1.97	1.98	27
中期(3-7)	18,089	99.49	99.63	4.69	0.68	0.77	0.77	4.61	4.59	4.61	30
長期(7-)	18,403	90.13	90.35	16.42	1.04	1.66	1.56	13.51	13.39	13.39	32
長期(7-11)	7,260	99.35	99.57	8.65	0.99	1.08	1.08	8.28	8.24	8.28	34
超長期(11-)	11,143	84.13	84.34	21.48	1.07	2.11	1.93	17.53	17.35	17.32	31
AAA~A格	70,303	96.44	96.60	7.44	0.74	1.07	1.04	6.38	6.34	6.35	39
短期(1-3)	20,897	99.56	99.66	2.00	0.46	0.68	0.68	1.99	1.98	1.99	35
中期(3-7)	25,824	99.18	99.33	4.70	0.69	0.86	0.85	4.61	4.59	4.61	38
長期(7-)	23,582	90.67	90.90	15.27	1.05	1.70	1.60	12.77	12.66	12.68	43
長期(7-11)	10,219	98.64	98.89	8.65	1.03	1.22	1.21	8.26	8.21	8.26	47
超長期(11-)	13,363	84.57	84.80	20.33	1.07	2.13	1.96	16.80	16.63	16.62	39
AAA~BBB格	70,842	96.45	96.62	7.41	0.74	1.07	1.04	6.36	6.32	6.33	39
短期(1-3)	21,177	99.56	99.66	2.00	0.46	0.69	0.69	1.99	1.98	1.99	35
中期(3-7)	26,053	99.17	99.32	4.70	0.69	0.86	0.86	4.61	4.59	4.61	39
長期(7-)	23,612	90.66	90.90	15.26	1.05	1.70	1.60	12.77	12.66	12.67	43
長期(7-11)	10,229	98.64	98.89	8.65	1.03	1.22	1.21	8.26	8.21	8.25	47
超長期(11-)	13,383	84.57	84.80	20.32	1.07	2.13	1.96	16.80	16.63	16.61	39
AAA~BB格	70,842	96.45	96.62	7.41	0.74	1.07	1.04	6.36	6.32	6.33	39
短期(1-3)	21,177	99.56	99.66	2.00	0.46	0.69	0.69	1.99	1.98	1.99	35
中期(3-7)	26,053	99.17	99.32	4.70	0.69	0.86	0.86	4.61	4.59	4.61	39
長期(7-)	23,612	90.66	90.90	15.26	1.05	1.70	1.60	12.77	12.66	12.67	43
長期(7-11)	10,229	98.64	98.89	8.65	1.03	1.22	1.21	8.26	8.21	8.25	47
超長期(11-)	13,383	84.57	84.80	20.32	1.07	2.13	1.96	16.80	16.63	16.61	39
AAA格	11,588	97.57	97.66	5.45	0.43	0.74	0.73	4.73	4.70	4.70	22
短期(1-3)	4,650	99.37	99.41	1.95	0.20	0.53	0.53	1.94	1.94	1.94	20
中期(3-7)	5,003	98.95	99.04	4.61	0.47	0.68	0.68	4.55	4.53	4.55	21
長期(7-)	1,935	89.72	89.92	16.05	0.92	1.49	1.38	12.62	12.52	12.48	27
長期(7-11)	1,123	98.77	98.96	8.55	0.83	1.00	1.00	8.25	8.20	8.24	27
超長期(11-)	812	77.20	77.41	26.42	1.03	2.36	2.06	20.36	20.14	19.98	27
AA格	39,795	95.78	95.95	8.88	0.82	1.10	1.06	7.43	7.37	7.38	33
短期(1-3)	10,241	99.80	99.91	2.01	0.53	0.64	0.64	1.99	1.99	1.99	30
中期(3-7)	13,086	99.69	99.85	4.72	0.76	0.81	0.81	4.63	4.61	4.63	34
長期(7-)	16,468	90.18	90.40	16.46	1.05	1.68	1.58	13.61	13.49	13.49	33
長期(7-11)	6,137	99.45	99.68	8.67	1.01	1.10	1.09	8.29	8.24	8.28	35
超長期(11-)	10,331	84.67	84.89	21.09	1.08	2.09	1.92	17.33	17.16	17.13	31
A格	18,920	97.12	97.32	5.63	0.77	1.20	1.18	5.24	5.20	5.24	62
短期(1-3)	6,006	99.30	99.43	2.03	0.53	0.88	0.88	2.02	2.01	2.02	54
中期(3-7)	7,735	98.47	98.65	4.71	0.73	1.05	1.04	4.62	4.59	4.62	57
長期(7-)	5,179	92.56	92.88	11.18	1.10	1.85	1.76	10.23	10.14	10.21	80
長期(7-11)	2,959	96.90	97.22	8.64	1.14	1.57	1.54	8.20	8.14	8.20	80
超長期(11-)	2,220	86.79	87.09	14.56	1.05	2.26	2.10	13.25	13.11	13.21	81
BBB格	539	98.13	98.28	3.61	0.72	1.16	1.15	3.46	3.44	3.46	72
短期(1-3)	280	99.28	99.43	1.91	0.69	1.08	1.07	1.89	1.88	1.89	75
中期(3-7)	229	98.01	98.15	4.56	0.73	1.16	1.15	4.47	4.44	4.47	69
長期(7-)	30	88.36	88.52	12.33	0.88	2.00	1.87	11.38	11.27	11.36	79
長期(7-11)	10	95.54	95.68	7.82	0.77	1.41	1.38	7.59	7.54	7.59	73
超長期(11-)	20	84.77	84.94	14.58	0.93	2.33	2.15	13.52	13.38	13.49	83
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9月末、10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	51,233	96.18	96.33	8.17	0.74	1.03	0.99	6.87	6.82	6.83	30
短期 (1-3)	14,813	99.67	99.77	2.05	0.44	0.61	0.61	2.04	2.03	2.04	27
中期 (3-7)	18,351	99.38	99.52	4.79	0.67	0.78	0.78	4.71	4.69	4.71	31
長期 (7-)	18,069	90.06	90.27	16.63	1.06	1.68	1.57	13.67	13.55	13.55	32
長期 (7-11)	6,939	99.54	99.77	8.79	1.02	1.09	1.09	8.40	8.35	8.40	33
超長期 (11-)	11,130	84.15	84.36	21.52	1.08	2.11	1.93	17.56	17.38	17.34	31
AAA~A 格	70,172	96.43	96.60	7.49	0.75	1.08	1.04	6.43	6.39	6.40	39
短期 (1-3)	20,867	99.57	99.67	2.06	0.47	0.69	0.69	2.05	2.04	2.05	35
中期 (3-7)	26,117	99.10	99.25	4.78	0.69	0.86	0.86	4.70	4.68	4.70	39
長期 (7-)	23,188	90.61	90.85	15.44	1.07	1.72	1.62	12.90	12.79	12.80	43
長期 (7-11)	9,838	98.78	99.04	8.76	1.06	1.23	1.22	8.35	8.30	8.35	47
超長期 (11-)	13,350	84.59	84.81	20.36	1.07	2.13	1.96	16.82	16.65	16.64	39
AAA~BBB 格	70,684	96.45	96.61	7.46	0.75	1.08	1.04	6.41	6.37	6.38	39
短期 (1-3)	21,132	99.56	99.67	2.05	0.47	0.70	0.69	2.04	2.04	2.04	35
中期 (3-7)	26,334	99.09	99.24	4.78	0.69	0.87	0.86	4.69	4.67	4.69	39
長期 (7-)	23,218	90.61	90.84	15.43	1.07	1.72	1.62	12.90	12.79	12.80	43
長期 (7-11)	9,848	98.78	99.03	8.76	1.06	1.23	1.22	8.35	8.30	8.34	47
超長期 (11-)	13,370	84.59	84.81	20.35	1.07	2.13	1.96	16.82	16.65	16.63	39
AAA~BB 格	70,684	96.45	96.61	7.46	0.75	1.08	1.04	6.41	6.37	6.38	39
短期 (1-3)	21,132	99.56	99.67	2.05	0.47	0.70	0.69	2.04	2.04	2.04	35
中期 (3-7)	26,334	99.09	99.24	4.78	0.69	0.87	0.86	4.69	4.67	4.69	39
長期 (7-)	23,218	90.61	90.84	15.43	1.07	1.72	1.62	12.90	12.79	12.80	43
長期 (7-11)	9,848	98.78	99.03	8.76	1.06	1.23	1.22	8.35	8.30	8.34	47
超長期 (11-)	13,370	84.59	84.81	20.35	1.07	2.13	1.96	16.82	16.65	16.63	39
AAA 格	11,570	97.57	97.66	5.51	0.44	0.75	0.73	4.79	4.76	4.77	22
短期 (1-3)	4,560	99.36	99.40	2.00	0.20	0.53	0.53	2.00	1.99	2.00	20
中期 (3-7)	5,112	98.96	99.05	4.66	0.47	0.69	0.68	4.60	4.59	4.60	21
長期 (7-)	1,898	89.57	89.76	16.25	0.93	1.51	1.40	12.76	12.65	12.62	27
長期 (7-11)	1,096	98.75	98.94	8.66	0.85	1.02	1.01	8.34	8.30	8.34	27
超長期 (11-)	802	77.02	77.23	26.61	1.04	2.38	2.08	20.50	20.28	20.12	27
AA 格	39,663	95.77	95.94	8.95	0.83	1.11	1.07	7.49	7.43	7.44	33
短期 (1-3)	10,254	99.81	99.93	2.07	0.55	0.65	0.65	2.06	2.05	2.06	30
中期 (3-7)	13,239	99.55	99.70	4.85	0.74	0.82	0.82	4.75	4.73	4.75	34
長期 (7-)	16,171	90.12	90.33	16.67	1.07	1.69	1.59	13.78	13.65	13.65	32
長期 (7-11)	5,843	99.69	99.92	8.82	1.06	1.10	1.10	8.41	8.36	8.41	35
超長期 (11-)	10,328	84.70	84.91	21.12	1.08	2.09	1.92	17.35	17.18	17.15	31
A 格	18,939	97.12	97.32	5.65	0.77	1.21	1.18	5.26	5.22	5.26	62
短期 (1-3)	6,054	99.30	99.43	2.08	0.54	0.88	0.88	2.06	2.05	2.06	54
中期 (3-7)	7,766	98.43	98.61	4.76	0.73	1.05	1.05	4.66	4.64	4.66	57
長期 (7-)	5,119	92.55	92.86	11.22	1.11	1.86	1.77	10.27	10.18	10.25	80
長期 (7-11)	2,899	96.95	97.29	8.67	1.16	1.58	1.54	8.23	8.17	8.22	80
超長期 (11-)	2,220	86.79	87.09	14.56	1.05	2.26	2.10	13.25	13.11	13.21	81
BBB 格	512	98.13	98.28	3.62	0.74	1.17	1.16	3.46	3.44	3.46	74
短期 (1-3)	265	99.31	99.47	1.90	0.73	1.10	1.10	1.89	1.88	1.89	77
中期 (3-7)	217	98.03	98.18	4.51	0.73	1.16	1.15	4.42	4.39	4.42	68
長期 (7-)	30	88.36	88.52	12.33	0.88	2.00	1.87	11.38	11.27	11.36	79
長期 (7-11)	10	95.54	95.68	7.82	0.77	1.41	1.38	7.59	7.54	7.59	73
超長期 (11-)	20	84.77	84.94	14.58	0.93	2.33	2.15	13.52	13.38	13.49	83
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9月末)

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
AAA~AA格	11,404	96.08	96.23	7.02	0.64	0.98	0.94	5.81	5.77	5.77	34
短期(1-3)	3,665	99.61	99.72	1.92	0.44	0.64	0.64	1.91	1.91	1.91	31
中期(3-7)	4,666	99.06	99.21	4.48	0.61	0.82	0.82	4.41	4.39	4.41	36
長期(7-)	3,074	87.35	87.54	16.95	0.91	1.71	1.57	13.50	13.38	13.35	36
長期(7-11)	1,320	98.38	98.63	8.64	0.89	1.11	1.11	8.30	8.25	8.29	37
超長期(11-)	1,753	79.04	79.19	23.22	0.93	2.26	2.01	18.39	18.19	18.10	35
AAA~A格	68,068	96.43	96.59	7.46	0.74	1.07	1.03	6.39	6.34	6.36	38
短期(1-3)	20,494	99.57	99.67	2.00	0.46	0.68	0.68	1.99	1.98	1.99	34
中期(3-7)	24,657	99.16	99.31	4.70	0.68	0.85	0.84	4.61	4.59	4.61	37
長期(7-)	22,917	90.67	90.91	15.31	1.05	1.70	1.60	12.80	12.68	12.69	43
長期(7-11)	9,901	98.67	98.92	8.65	1.03	1.22	1.21	8.26	8.21	8.25	47
超長期(11-)	13,016	84.59	84.81	20.38	1.07	2.13	1.95	16.82	16.65	16.63	39
AAA~BBB格	70,602	96.43	96.60	7.42	0.74	1.07	1.04	6.37	6.32	6.33	39
短期(1-3)	21,177	99.56	99.66	2.00	0.46	0.69	0.69	1.99	1.98	1.99	35
中期(3-7)	25,838	99.15	99.30	4.70	0.68	0.85	0.85	4.61	4.59	4.61	38
長期(7-)	23,587	90.66	90.90	15.26	1.05	1.70	1.60	12.77	12.66	12.67	43
長期(7-11)	10,229	98.64	98.89	8.65	1.03	1.22	1.21	8.26	8.21	8.25	47
超長期(11-)	13,358	84.56	84.78	20.33	1.07	2.13	1.95	16.80	16.63	16.62	39
AAA~BB格	70,842	96.45	96.62	7.41	0.74	1.07	1.04	6.36	6.32	6.33	39
短期(1-3)	21,177	99.56	99.66	2.00	0.46	0.69	0.69	1.99	1.98	1.99	35
中期(3-7)	26,053	99.17	99.32	4.70	0.69	0.86	0.86	4.61	4.59	4.61	39
長期(7-)	23,612	90.66	90.90	15.26	1.05	1.70	1.60	12.77	12.66	12.67	43
長期(7-11)	10,229	98.64	98.89	8.65	1.03	1.22	1.21	8.26	8.21	8.25	47
超長期(11-)	13,383	84.57	84.80	20.32	1.07	2.13	1.96	16.80	16.63	16.61	39
AAA格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA格	11,404	96.08	96.23	7.02	0.64	0.98	0.94	5.81	5.77	5.77	34
短期(1-3)	3,665	99.61	99.72	1.92	0.44	0.64	0.64	1.91	1.91	1.91	31
中期(3-7)	4,666	99.06	99.21	4.48	0.61	0.82	0.82	4.41	4.39	4.41	36
長期(7-)	3,074	87.35	87.54	16.95	0.91	1.71	1.57	13.50	13.38	13.35	36
長期(7-11)	1,320	98.38	98.63	8.64	0.89	1.11	1.11	8.30	8.25	8.29	37
超長期(11-)	1,753	79.04	79.19	23.22	0.93	2.26	2.01	18.39	18.19	18.10	35
A格	56,664	96.50	96.66	7.54	0.76	1.08	1.05	6.51	6.46	6.48	39
短期(1-3)	16,829	99.56	99.66	2.01	0.46	0.69	0.69	2.00	2.00	2.00	35
中期(3-7)	19,992	99.19	99.34	4.75	0.69	0.85	0.85	4.66	4.64	4.66	38
長期(7-)	19,843	91.19	91.43	15.05	1.07	1.70	1.60	12.69	12.58	12.60	44
長期(7-11)	8,581	98.72	98.97	8.65	1.05	1.23	1.22	8.25	8.20	8.25	48
超長期(11-)	11,262	85.45	85.68	19.93	1.09	2.11	1.94	16.60	16.43	16.42	39
BBB格	2,534	96.64	96.82	6.35	0.73	1.17	1.14	5.73	5.69	5.71	54
短期(1-3)	683	99.10	99.21	2.05	0.50	0.95	0.94	2.03	2.02	2.03	60
中期(3-7)	1,181	98.81	98.99	4.69	0.70	0.97	0.96	4.60	4.58	4.60	50
長期(7-)	671	90.31	90.56	13.66	0.99	1.78	1.68	12.01	11.90	11.96	56
長期(7-11)	328	97.52	97.80	8.67	1.00	1.35	1.33	8.30	8.24	8.29	59
超長期(11-)	343	83.40	83.63	18.44	0.99	2.27	2.08	16.17	16.00	16.06	54
BB格	240	101.16	101.59	5.66	2.26	1.87	1.87	5.13	5.08	5.12	133
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	215	101.98	102.36	4.50	2.25	1.76	1.77	4.29	4.25	4.28	131
長期(7-)	25	94.15	94.96	15.66	2.37	2.91	2.83	12.97	12.79	12.89	147
長期(7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期(11-)	25	94.15	94.96	15.66	2.37	2.91	2.83	12.97	12.79	12.89	147
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9月末、10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	11,636	96.03	96.18	7.17	0.65	0.99	0.96	5.96	5.92	5.93	34
短期(1-3)	3,731	99.57	99.68	2.03	0.44	0.65	0.65	2.02	2.02	2.02	31
中期(3-7)	4,636	99.03	99.18	4.59	0.61	0.83	0.83	4.52	4.50	4.52	36
長期(7-)	3,269	87.74	87.93	16.71	0.93	1.69	1.56	13.38	13.26	13.24	36
長期(7-11)	1,450	98.50	98.74	8.77	0.92	1.12	1.12	8.41	8.36	8.40	37
超長期(11-)	1,818	79.15	79.31	23.04	0.93	2.26	2.01	18.32	18.13	18.04	35
AAA~A格	67,924	96.42	96.58	7.51	0.74	1.07	1.04	6.44	6.40	6.41	38
短期(1-3)	20,464	99.58	99.68	2.06	0.47	0.69	0.69	2.04	2.04	2.04	35
中期(3-7)	24,938	99.08	99.22	4.79	0.67	0.85	0.85	4.70	4.68	4.70	38
長期(7-)	22,522	90.61	90.85	15.48	1.07	1.71	1.61	12.93	12.81	12.83	42
長期(7-11)	9,520	98.82	99.07	8.76	1.07	1.23	1.21	8.35	8.30	8.35	47
超長期(11-)	13,003	84.60	84.82	20.41	1.07	2.13	1.95	16.84	16.67	16.66	39
AAA~BBB格	70,444	96.43	96.59	7.47	0.74	1.07	1.04	6.42	6.37	6.38	39
短期(1-3)	21,132	99.56	99.67	2.05	0.47	0.70	0.69	2.04	2.04	2.04	35
中期(3-7)	26,119	99.07	99.21	4.78	0.67	0.86	0.85	4.70	4.68	4.70	38
長期(7-)	23,193	90.60	90.84	15.43	1.07	1.72	1.61	12.90	12.79	12.80	43
長期(7-11)	9,848	98.78	99.03	8.76	1.06	1.23	1.22	8.35	8.30	8.34	47
超長期(11-)	13,345	84.57	84.79	20.36	1.07	2.13	1.96	16.83	16.66	16.64	39
AAA~BB格	70,684	96.45	96.61	7.46	0.75	1.08	1.04	6.41	6.37	6.38	39
短期(1-3)	21,132	99.56	99.67	2.05	0.47	0.70	0.69	2.04	2.04	2.04	35
中期(3-7)	26,334	99.09	99.24	4.78	0.69	0.87	0.86	4.69	4.67	4.69	39
長期(7-)	23,218	90.61	90.84	15.43	1.07	1.72	1.62	12.90	12.79	12.80	43
長期(7-11)	9,848	98.78	99.03	8.76	1.06	1.23	1.22	8.35	8.30	8.34	47
超長期(11-)	13,370	84.59	84.81	20.35	1.07	2.13	1.96	16.82	16.65	16.63	39
AAA格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA格	11,636	96.03	96.18	7.17	0.65	0.99	0.96	5.96	5.92	5.93	34
短期(1-3)	3,731	99.57	99.68	2.03	0.44	0.65	0.65	2.02	2.02	2.02	31
中期(3-7)	4,636	99.03	99.18	4.59	0.61	0.83	0.83	4.52	4.50	4.52	36
長期(7-)	3,269	87.74	87.93	16.71	0.93	1.69	1.56	13.38	13.26	13.24	36
長期(7-11)	1,450	98.50	98.74	8.77	0.92	1.12	1.12	8.41	8.36	8.40	37
超長期(11-)	1,818	79.15	79.31	23.04	0.93	2.26	2.01	18.32	18.13	18.04	35
A格	56,289	96.50	96.67	7.58	0.76	1.09	1.05	6.54	6.49	6.51	39
短期(1-3)	16,733	99.58	99.68	2.06	0.48	0.70	0.70	2.05	2.04	2.05	35
中期(3-7)	20,302	99.09	99.23	4.83	0.68	0.86	0.85	4.74	4.72	4.74	38
長期(7-)	19,254	91.10	91.34	15.28	1.10	1.72	1.62	12.85	12.74	12.76	43
長期(7-11)	8,069	98.88	99.13	8.76	1.09	1.25	1.23	8.34	8.29	8.34	48
超長期(11-)	11,184	85.49	85.72	19.98	1.10	2.11	1.94	16.62	16.45	16.45	39
BBB格	2,519	96.63	96.81	6.37	0.73	1.17	1.14	5.75	5.71	5.73	54
短期(1-3)	668	99.11	99.22	2.05	0.52	0.96	0.95	2.04	2.03	2.04	61
中期(3-7)	1,181	98.81	98.99	4.69	0.70	0.97	0.96	4.60	4.58	4.60	50
長期(7-)	671	90.31	90.56	13.66	0.99	1.78	1.68	12.01	11.90	11.96	56
長期(7-11)	328	97.52	97.80	8.67	1.00	1.35	1.33	8.30	8.24	8.29	59
超長期(11-)	343	83.40	83.63	18.44	0.99	2.27	2.08	16.17	16.00	16.06	54
BB格	240	101.16	101.59	5.66	2.26	1.87	1.87	5.13	5.08	5.12	133
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	215	101.98	102.36	4.50	2.25	1.76	1.77	4.29	4.25	4.28	131
長期(7-)	25	94.15	94.96	15.66	2.37	2.91	2.83	12.97	12.79	12.89	147
長期(7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期(11-)	25	94.15	94.96	15.66	2.37	2.91	2.83	12.97	12.79	12.89	147
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&amp;I 格付別・ポートフォリオ指標 (2024年9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	41,052	96.09	96.24	8.63	0.77	1.02	0.98	7.14	7.09	7.09	27
短期 (1-3)	11,668	99.73	99.82	2.01	0.43	0.58	0.58	2.00	1.99	2.00	24
中期 (3-7)	13,897	99.86	100.00	4.67	0.72	0.74	0.74	4.59	4.57	4.59	27
長期 (7-)	15,487	89.96	90.17	17.18	1.08	1.67	1.56	13.97	13.84	13.83	29
長期 (7-11)	5,751	99.99	100.20	8.78	1.04	1.05	1.05	8.38	8.34	8.38	30
超長期 (11-)	9,736	84.04	84.25	22.14	1.10	2.11	1.93	17.89	17.71	17.66	28
AAA~A 格	64,216	96.37	96.53	7.67	0.75	1.06	1.03	6.54	6.49	6.50	36
短期 (1-3)	18,951	99.59	99.69	2.01	0.44	0.66	0.65	2.00	1.99	2.00	32
中期 (3-7)	23,013	99.31	99.45	4.71	0.70	0.84	0.83	4.62	4.60	4.62	36
長期 (7-)	22,252	90.59	90.82	15.54	1.05	1.69	1.59	12.95	12.84	12.85	40
長期 (7-11)	9,401	98.86	99.10	8.68	1.02	1.18	1.17	8.29	8.24	8.28	43
超長期 (11-)	12,851	84.54	84.76	20.57	1.08	2.13	1.95	16.94	16.77	16.75	38
AAA~BBB 格	64,786	96.38	96.54	7.63	0.75	1.06	1.03	6.51	6.47	6.48	37
短期 (1-3)	19,202	99.58	99.68	2.01	0.45	0.66	0.66	2.00	1.99	2.00	33
中期 (3-7)	23,291	99.29	99.44	4.70	0.70	0.84	0.84	4.62	4.60	4.62	37
長期 (7-)	22,293	90.58	90.81	15.54	1.05	1.69	1.59	12.95	12.83	12.84	41
長期 (7-11)	9,422	98.83	99.08	8.67	1.02	1.18	1.17	8.29	8.24	8.28	43
超長期 (11-)	12,871	84.54	84.76	20.56	1.08	2.13	1.95	16.94	16.76	16.75	38
AAA~BB 格	64,786	96.38	96.54	7.63	0.75	1.06	1.03	6.51	6.47	6.48	37
短期 (1-3)	19,202	99.58	99.68	2.01	0.45	0.66	0.66	2.00	1.99	2.00	33
中期 (3-7)	23,291	99.29	99.44	4.70	0.70	0.84	0.84	4.62	4.60	4.62	37
長期 (7-)	22,293	90.58	90.81	15.54	1.05	1.69	1.59	12.95	12.83	12.84	41
長期 (7-11)	9,422	98.83	99.08	8.67	1.02	1.18	1.17	8.29	8.24	8.28	43
超長期 (11-)	12,871	84.54	84.76	20.56	1.08	2.13	1.95	16.94	16.76	16.75	38
AAA 格	955	98.55	98.66	3.62	0.31	0.69	0.68	3.53	3.52	3.53	26
短期 (1-3)	505	99.26	99.33	1.93	0.19	0.58	0.58	1.93	1.92	1.93	25
中期 (3-7)	350	98.60	98.75	4.37	0.41	0.72	0.71	4.32	4.30	4.32	26
長期 (7-)	100	94.78	94.97	9.47	0.57	1.14	1.11	9.15	9.10	9.14	29
長期 (7-11)	70	97.11	97.32	8.38	0.62	1.00	0.99	8.16	8.12	8.16	28
超長期 (11-)	30	89.35	89.50	12.01	0.45	1.50	1.42	11.66	11.58	11.65	31
AA 格	40,097	96.03	96.18	8.75	0.79	1.03	0.99	7.23	7.17	7.18	27
短期 (1-3)	11,163	99.75	99.84	2.01	0.44	0.58	0.58	2.00	1.99	2.00	24
中期 (3-7)	13,547	99.89	100.03	4.68	0.73	0.74	0.74	4.59	4.58	4.59	27
長期 (7-)	15,387	89.93	90.14	17.23	1.08	1.68	1.57	14.00	13.88	13.86	29
長期 (7-11)	5,681	100.02	100.24	8.78	1.05	1.05	1.05	8.38	8.34	8.38	30
超長期 (11-)	9,706	84.02	84.23	22.18	1.10	2.11	1.93	17.91	17.73	17.68	28
A 格	23,165	96.87	97.05	5.95	0.70	1.12	1.10	5.49	5.45	5.48	53
短期 (1-3)	7,283	99.37	99.48	2.02	0.46	0.78	0.77	2.01	2.00	2.01	44
中期 (3-7)	9,116	98.46	98.63	4.76	0.67	0.98	0.98	4.68	4.65	4.68	51
長期 (7-)	6,765	92.03	92.31	11.79	0.99	1.73	1.65	10.68	10.59	10.66	66
長期 (7-11)	3,650	97.09	97.38	8.51	0.98	1.38	1.36	8.14	8.08	8.13	64
超長期 (11-)	3,115	86.10	86.37	15.64	1.01	2.19	2.04	14.05	13.90	13.99	68
BBB 格	570	97.50	97.69	3.84	0.82	1.40	1.37	3.67	3.64	3.66	94
短期 (1-3)	251	98.95	99.13	1.94	0.77	1.31	1.30	1.92	1.91	1.92	97
中期 (3-7)	277	97.93	98.11	4.50	0.84	1.30	1.29	4.41	4.38	4.41	83
長期 (7-)	41	85.73	85.93	10.95	0.93	2.77	2.54	10.28	10.16	10.26	158
長期 (7-11)	21	86.64	86.87	7.50	0.93	3.18	2.90	7.26	7.16	7.26	228
超長期 (11-)	20	84.77	84.94	14.58	0.93	2.33	2.15	13.52	13.38	13.49	83
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	6,056	97.22	97.41	5.04	0.70	1.17	1.14	4.75	4.72	4.75	63
短期 (1-3)	1,975	99.30	99.45	1.88	0.59	0.94	0.94	1.87	1.86	1.87	61
中期 (3-7)	2,763	98.18	98.35	4.62	0.61	1.01	1.00	4.54	4.52	4.54	54
長期 (7-)	1,319	92.08	92.38	10.64	1.04	1.90	1.78	9.87	9.78	9.85	86
長期 (7-11)	807	96.31	96.65	8.34	1.16	1.72	1.64	7.93	7.87	7.93	94
超長期 (11-)	512	85.43	85.66	14.28	0.85	2.21	2.02	13.31	13.18	13.28	73

出所:NFRC

- 格付は、R&I の格付をもとに NFRC で分類

## 事業債 R&amp;I 格付別・ポートフォリオ指標 (2024年9月末、10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	41,256	96.07	96.22	8.70	0.78	1.03	0.99	7.21	7.16	7.16	27
短期 (1-3)	11,630	99.75	99.84	2.07	0.45	0.59	0.59	2.06	2.05	2.06	24
中期 (3-7)	14,044	99.80	99.93	4.75	0.71	0.74	0.74	4.66	4.64	4.66	27
長期 (7-)	15,583	89.97	90.18	17.22	1.09	1.68	1.57	14.01	13.88	13.87	29
長期 (7-11)	5,764	100.03	100.25	8.86	1.06	1.06	1.06	8.45	8.40	8.45	30
超長期 (11-)	9,818	84.06	84.27	22.12	1.10	2.11	1.93	17.89	17.71	17.65	28
AAA~A 格	64,051	96.36	96.52	7.72	0.75	1.06	1.03	6.59	6.55	6.56	36
短期 (1-3)	18,866	99.60	99.70	2.07	0.46	0.66	0.66	2.06	2.05	2.06	32
中期 (3-7)	23,287	99.22	99.36	4.79	0.69	0.84	0.84	4.71	4.69	4.71	37
長期 (7-)	21,898	90.53	90.77	15.71	1.07	1.70	1.60	13.08	12.97	12.97	40
長期 (7-11)	9,060	99.01	99.25	8.79	1.05	1.18	1.18	8.38	8.33	8.38	43
超長期 (11-)	12,838	84.55	84.78	20.60	1.08	2.13	1.95	16.97	16.79	16.77	38
AAA~BBB 格	64,621	96.37	96.54	7.69	0.75	1.07	1.03	6.57	6.52	6.53	37
短期 (1-3)	19,117	99.59	99.70	2.07	0.46	0.67	0.67	2.06	2.05	2.06	33
中期 (3-7)	23,565	99.20	99.35	4.79	0.69	0.85	0.84	4.70	4.68	4.70	37
長期 (7-)	21,939	90.52	90.76	15.70	1.07	1.70	1.60	13.08	12.96	12.97	40
長期 (7-11)	9,081	98.98	99.22	8.79	1.05	1.19	1.18	8.38	8.33	8.38	43
超長期 (11-)	12,858	84.55	84.78	20.59	1.08	2.13	1.96	16.96	16.79	16.77	38
AAA~BB 格	64,621	96.37	96.54	7.69	0.75	1.07	1.03	6.57	6.52	6.53	37
短期 (1-3)	19,117	99.59	99.70	2.07	0.46	0.67	0.67	2.06	2.05	2.06	33
中期 (3-7)	23,565	99.20	99.35	4.79	0.69	0.85	0.84	4.70	4.68	4.70	37
長期 (7-)	21,939	90.52	90.76	15.70	1.07	1.70	1.60	13.08	12.96	12.97	40
長期 (7-11)	9,081	98.98	99.22	8.79	1.05	1.19	1.18	8.38	8.33	8.38	43
超長期 (11-)	12,858	84.55	84.78	20.59	1.08	2.13	1.96	16.96	16.79	16.77	38
AAA 格	885	98.46	98.58	3.82	0.32	0.71	0.70	3.73	3.72	3.73	26
短期 (1-3)	465	99.18	99.26	2.14	0.20	0.61	0.60	2.13	2.13	2.13	26
中期 (3-7)	320	98.55	98.70	4.49	0.42	0.72	0.72	4.44	4.42	4.44	26
長期 (7-)	100	94.78	94.97	9.47	0.57	1.14	1.11	9.15	9.10	9.14	29
長期 (7-11)	70	97.11	97.32	8.38	0.62	1.00	0.99	8.16	8.12	8.16	28
超長期 (11-)	30	89.35	89.50	12.01	0.45	1.50	1.42	11.66	11.58	11.65	31
AA 格	40,371	96.02	96.17	8.81	0.79	1.04	1.00	7.29	7.23	7.24	27
短期 (1-3)	11,165	99.77	99.87	2.07	0.46	0.58	0.58	2.06	2.05	2.06	24
中期 (3-7)	13,724	99.83	99.96	4.75	0.72	0.75	0.74	4.67	4.65	4.67	27
長期 (7-)	15,483	89.94	90.15	17.27	1.09	1.68	1.57	14.04	13.91	13.90	29
長期 (7-11)	5,694	100.07	100.29	8.87	1.07	1.06	1.06	8.45	8.41	8.45	30
超長期 (11-)	9,788	84.05	84.26	22.16	1.11	2.11	1.93	17.91	17.73	17.67	28
A 格	22,795	96.89	97.07	5.95	0.70	1.13	1.10	5.49	5.45	5.48	53
短期 (1-3)	7,236	99.37	99.48	2.07	0.47	0.78	0.78	2.06	2.05	2.06	44
中期 (3-7)	9,243	98.34	98.50	4.86	0.66	0.99	0.99	4.77	4.75	4.77	51
長期 (7-)	6,315	91.92	92.21	12.00	1.03	1.76	1.68	10.85	10.75	10.82	67
長期 (7-11)	3,295	97.21	97.51	8.66	1.03	1.41	1.39	8.26	8.20	8.25	65
超長期 (11-)	3,020	86.15	86.43	15.64	1.02	2.20	2.05	14.04	13.90	13.98	69
BBB 格	570	97.50	97.69	3.84	0.82	1.40	1.37	3.67	3.64	3.66	94
短期 (1-3)	251	98.95	99.13	1.94	0.77	1.31	1.30	1.92	1.91	1.92	97
中期 (3-7)	277	97.93	98.11	4.50	0.84	1.30	1.29	4.41	4.38	4.41	83
長期 (7-)	41	85.73	85.93	10.95	0.93	2.77	2.54	10.28	10.16	10.26	158
長期 (7-11)	21	86.64	86.87	7.50	0.93	3.18	2.90	7.26	7.16	7.26	228
超長期 (11-)	20	84.77	84.94	14.58	0.93	2.33	2.15	13.52	13.38	13.49	83
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	6,063	97.22	97.41	5.06	0.70	1.17	1.14	4.78	4.74	4.77	63
短期 (1-3)	2,015	99.26	99.41	1.94	0.58	0.95	0.94	1.93	1.92	1.93	61
中期 (3-7)	2,770	98.14	98.30	4.70	0.62	1.02	1.01	4.62	4.60	4.62	54
長期 (7-)	1,279	92.01	92.31	10.76	1.06	1.92	1.80	9.96	9.87	9.95	87
長期 (7-11)	767	96.41	96.76	8.40	1.21	1.75	1.67	7.98	7.92	7.98	95
超長期 (11-)	512	85.43	85.66	14.28	0.85	2.21	2.02	13.31	13.18	13.28	73

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9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	30,186	97.10	97.24	5.94	0.56	0.92	0.89	5.31	5.27	5.29	34
短期 (1-3)	10,333	99.47	99.56	1.96	0.35	0.62	0.62	1.95	1.95	1.95	29
中期 (3-7)	12,256	98.74	98.86	4.65	0.54	0.80	0.80	4.58	4.56	4.58	33
長期 (7-)	7,597	91.23	91.45	13.42	0.89	1.55	1.47	11.53	11.43	11.46	42
長期 (7-11)	4,143	97.91	98.14	8.44	0.85	1.14	1.13	8.13	8.09	8.13	41
超長期 (11-)	3,454	83.22	83.44	19.38	0.94	2.14	1.95	16.31	16.15	16.16	43
AAA~A 格	42,084	97.00	97.16	5.91	0.64	1.03	1.00	5.34	5.30	5.32	44
短期 (1-3)	13,819	99.41	99.51	1.98	0.40	0.70	0.70	1.97	1.96	1.97	36
中期 (3-7)	17,096	98.67	98.82	4.67	0.62	0.89	0.89	4.59	4.57	4.59	42
長期 (7-)	11,169	91.45	91.71	12.66	0.96	1.69	1.60	11.08	10.99	11.03	58
長期 (7-11)	6,153	97.18	97.44	8.52	0.94	1.33	1.31	8.17	8.11	8.16	58
超長期 (11-)	5,015	84.43	84.68	17.73	0.99	2.20	2.02	15.20	15.05	15.08	58
AAA~BBB 格	42,387	97.01	97.17	5.89	0.64	1.03	1.00	5.33	5.29	5.31	44
短期 (1-3)	13,973	99.41	99.51	1.98	0.41	0.70	0.70	1.97	1.96	1.97	37
中期 (3-7)	17,215	98.67	98.82	4.67	0.62	0.90	0.89	4.59	4.57	4.59	42
長期 (7-)	11,199	91.45	91.70	12.66	0.96	1.69	1.60	11.08	10.99	11.03	58
長期 (7-11)	6,163	97.17	97.44	8.52	0.94	1.33	1.31	8.17	8.11	8.16	58
超長期 (11-)	5,035	84.44	84.68	17.72	0.99	2.20	2.02	15.20	15.04	15.08	58
AAA~BB 格	42,387	97.01	97.17	5.89	0.64	1.03	1.00	5.33	5.29	5.31	44
短期 (1-3)	13,973	99.41	99.51	1.98	0.41	0.70	0.70	1.97	1.96	1.97	37
中期 (3-7)	17,215	98.67	98.82	4.67	0.62	0.90	0.89	4.59	4.57	4.59	42
長期 (7-)	11,199	91.45	91.70	12.66	0.96	1.69	1.60	11.08	10.99	11.03	58
長期 (7-11)	6,163	97.17	97.44	8.52	0.94	1.33	1.31	8.17	8.11	8.16	58
超長期 (11-)	5,035	84.44	84.68	17.72	0.99	2.20	2.02	15.20	15.04	15.08	58
AAA 格	11,043	97.49	97.57	5.59	0.44	0.75	0.73	4.83	4.80	4.81	21
短期 (1-3)	4,325	99.37	99.41	1.95	0.19	0.53	0.52	1.95	1.94	1.95	19
中期 (3-7)	4,783	98.93	99.01	4.64	0.46	0.68	0.68	4.58	4.56	4.58	21
長期 (7-)	1,935	89.72	89.92	16.05	0.92	1.49	1.38	12.62	12.52	12.48	27
長期 (7-11)	1,123	98.77	98.96	8.55	0.83	1.00	1.00	8.25	8.20	8.24	27
超長期 (11-)	812	77.20	77.41	26.42	1.03	2.36	2.06	20.36	20.14	19.98	27
AA 格	19,142	96.88	97.04	6.14	0.64	1.01	0.99	5.58	5.55	5.57	41
短期 (1-3)	6,009	99.55	99.67	1.97	0.47	0.69	0.69	1.96	1.95	1.96	36
中期 (3-7)	7,473	98.61	98.77	4.66	0.59	0.88	0.88	4.59	4.57	4.59	41
長期 (7-)	5,661	91.75	91.98	12.52	0.88	1.57	1.50	11.16	11.07	11.12	47
長期 (7-11)	3,020	97.59	97.83	8.40	0.85	1.19	1.18	8.09	8.04	8.09	46
超長期 (11-)	2,642	85.07	85.29	17.22	0.91	2.07	1.91	15.19	15.04	15.09	47
A 格	11,898	96.75	96.97	5.83	0.83	1.31	1.27	5.42	5.38	5.41	70
短期 (1-3)	3,486	99.24	99.37	2.02	0.54	0.92	0.92	2.01	2.00	2.01	58
中期 (3-7)	4,840	98.50	98.71	4.73	0.81	1.12	1.11	4.62	4.60	4.62	64
長期 (7-)	3,572	91.93	92.26	11.05	1.13	1.98	1.88	10.15	10.06	10.14	93
長期 (7-11)	2,011	95.67	96.01	8.69	1.14	1.74	1.68	8.24	8.17	8.24	94
超長期 (11-)	1,562	87.12	87.44	14.08	1.11	2.33	2.17	12.85	12.72	12.82	91
BBB 格	303	97.79	97.95	3.88	0.72	1.18	1.16	3.66	3.64	3.66	72
短期 (1-3)	153	99.25	99.40	1.80	0.66	1.06	1.06	1.78	1.77	1.78	74
中期 (3-7)	120	98.30	98.46	4.44	0.75	1.14	1.13	4.35	4.33	4.35	67
長期 (7-)	30	88.36	88.52	12.33	0.88	2.00	1.87	11.38	11.27	11.36	79
長期 (7-11)	10	95.54	95.68	7.82	0.77	1.41	1.38	7.59	7.54	7.59	73
超長期 (11-)	20	84.77	84.94	14.58	0.93	2.33	2.15	13.52	13.38	13.49	83
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	28,455	95.62	95.79	9.67	0.90	1.14	1.09	7.93	7.87	7.87	31
短期 (1-3)	7,204	99.83	99.94	2.04	0.56	0.67	0.66	2.03	2.02	2.03	33
中期 (3-7)	8,838	100.15	100.31	4.74	0.83	0.79	0.79	4.64	4.63	4.64	32
長期 (7-)	12,414	89.96	90.18	17.61	1.13	1.71	1.61	14.32	14.19	14.18	29
長期 (7-11)	4,066	100.85	101.08	8.84	1.16	1.06	1.07	8.39	8.35	8.39	31
超長期 (11-)	8,348	84.66	84.87	21.89	1.12	2.09	1.92	17.76	17.58	17.53	28

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9月末、10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	30,167	97.10	97.24	6.00	0.57	0.92	0.90	5.36	5.33	5.35	34
短期 (1-3)	10,304	99.47	99.56	2.02	0.36	0.63	0.63	2.01	2.00	2.01	29
中期 (3-7)	12,590	98.62	98.75	4.78	0.54	0.81	0.81	4.70	4.68	4.70	34
長期 (7-)	7,273	91.10	91.32	13.74	0.92	1.58	1.49	11.77	11.67	11.70	41
長期 (7-11)	3,864	98.14	98.37	8.66	0.90	1.15	1.14	8.31	8.27	8.31	40
超長期 (11-)	3,409	83.12	83.33	19.49	0.94	2.15	1.95	16.40	16.23	16.24	43
AAA~A 格	42,089	97.00	97.16	5.95	0.64	1.03	1.01	5.38	5.35	5.37	44
短期 (1-3)	13,854	99.41	99.51	2.03	0.41	0.70	0.70	2.02	2.02	2.02	36
中期 (3-7)	17,450	98.57	98.72	4.78	0.61	0.90	0.89	4.70	4.68	4.70	42
長期 (7-)	10,785	91.36	91.62	12.88	0.99	1.71	1.62	11.26	11.16	11.21	58
長期 (7-11)	5,815	97.33	97.60	8.68	0.99	1.35	1.32	8.30	8.25	8.30	58
超長期 (11-)	4,970	84.37	84.62	17.79	1.00	2.21	2.02	15.25	15.09	15.13	58
AAA~BBB 格	42,365	97.01	97.17	5.94	0.64	1.03	1.01	5.37	5.34	5.36	44
短期 (1-3)	13,992	99.41	99.51	2.03	0.41	0.71	0.71	2.02	2.01	2.02	37
中期 (3-7)	17,558	98.57	98.72	4.78	0.61	0.90	0.90	4.70	4.68	4.70	42
長期 (7-)	10,815	91.35	91.61	12.88	0.99	1.71	1.62	11.26	11.16	11.21	58
長期 (7-11)	5,825	97.32	97.60	8.68	0.99	1.35	1.32	8.30	8.25	8.30	58
超長期 (11-)	4,990	84.38	84.62	17.78	1.00	2.21	2.02	15.24	15.08	15.12	58
AAA~BB 格	42,365	97.01	97.17	5.94	0.64	1.03	1.01	5.37	5.34	5.36	44
短期 (1-3)	13,992	99.41	99.51	2.03	0.41	0.71	0.71	2.02	2.01	2.02	37
中期 (3-7)	17,558	98.57	98.72	4.78	0.61	0.90	0.90	4.70	4.68	4.70	42
長期 (7-)	10,815	91.35	91.61	12.88	0.99	1.71	1.62	11.26	11.16	11.21	58
長期 (7-11)	5,825	97.32	97.60	8.68	0.99	1.35	1.32	8.30	8.25	8.30	58
超長期 (11-)	4,990	84.38	84.62	17.78	1.00	2.21	2.02	15.24	15.08	15.12	58
AAA 格	11,095	97.50	97.59	5.62	0.44	0.75	0.73	4.87	4.84	4.85	21
短期 (1-3)	4,275	99.36	99.40	1.99	0.20	0.53	0.53	1.98	1.98	1.98	19
中期 (3-7)	4,922	98.94	99.03	4.68	0.47	0.68	0.68	4.63	4.61	4.63	21
長期 (7-)	1,898	89.57	89.76	16.25	0.93	1.51	1.40	12.76	12.65	12.62	27
長期 (7-11)	1,096	98.75	98.94	8.66	0.85	1.02	1.01	8.34	8.30	8.34	27
超長期 (11-)	802	77.02	77.23	26.61	1.04	2.38	2.08	20.50	20.28	20.12	27
AA 格	19,072	96.87	97.03	6.21	0.64	1.02	1.00	5.65	5.61	5.64	41
短期 (1-3)	6,030	99.55	99.68	2.04	0.48	0.70	0.70	2.03	2.02	2.03	36
中期 (3-7)	7,667	98.42	98.57	4.84	0.58	0.90	0.89	4.75	4.73	4.75	42
長期 (7-)	5,375	91.64	91.87	12.85	0.92	1.60	1.52	11.43	11.33	11.38	46
長期 (7-11)	2,768	97.90	98.15	8.65	0.92	1.20	1.19	8.30	8.25	8.30	45
超長期 (11-)	2,607	85.00	85.21	17.30	0.91	2.08	1.92	15.25	15.10	15.16	47
A 格	11,922	96.75	96.97	5.85	0.83	1.31	1.28	5.43	5.39	5.43	71
短期 (1-3)	3,549	99.24	99.38	2.07	0.55	0.93	0.92	2.06	2.05	2.06	58
中期 (3-7)	4,861	98.44	98.64	4.79	0.81	1.13	1.12	4.69	4.66	4.69	65
長期 (7-)	3,512	91.89	92.23	11.11	1.14	2.00	1.90	10.21	10.11	10.19	93
長期 (7-11)	1,951	95.71	96.07	8.74	1.16	1.75	1.70	8.28	8.21	8.28	95
超長期 (11-)	1,562	87.12	87.44	14.08	1.11	2.33	2.17	12.85	12.72	12.82	91
BBB 格	276	97.76	97.91	3.92	0.76	1.20	1.19	3.68	3.66	3.68	74
短期 (1-3)	138	99.30	99.46	1.78	0.74	1.11	1.11	1.77	1.76	1.77	80
中期 (3-7)	108	98.38	98.54	4.33	0.75	1.12	1.12	4.25	4.22	4.25	66
長期 (7-)	30	88.36	88.52	12.33	0.88	2.00	1.87	11.38	11.27	11.36	79
長期 (7-11)	10	95.54	95.68	7.82	0.77	1.41	1.38	7.59	7.54	7.59	73
超長期 (11-)	20	84.77	84.94	14.58	0.93	2.33	2.15	13.52	13.38	13.49	83
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	28,318	95.61	95.78	9.75	0.90	1.14	1.10	7.99	7.93	7.93	31
短期 (1-3)	7,140	99.86	99.97	2.10	0.58	0.67	0.67	2.09	2.08	2.09	33
中期 (3-7)	8,776	100.13	100.29	4.78	0.83	0.79	0.79	4.69	4.67	4.69	32
長期 (7-)	12,403	89.96	90.18	17.66	1.14	1.72	1.61	14.36	14.23	14.21	29
長期 (7-11)	4,023	100.88	101.11	8.86	1.17	1.07	1.07	8.42	8.37	8.41	31
超長期 (11-)	8,380	84.71	84.93	21.88	1.12	2.09	1.92	17.76	17.58	17.53	28

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9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	24,274	96.65	96.82	8.61	0.80	1.02	0.98	7.27	7.22	7.23	25
短期 (1-3)	6,946	99.69	99.78	2.02	0.41	0.57	0.57	2.01	2.00	2.01	23
中期 (3-7)	7,757	99.92	100.05	4.66	0.71	0.70	0.70	4.58	4.56	4.58	23
長期 (7-)	9,572	91.80	92.06	16.61	1.15	1.65	1.56	13.79	13.67	13.67	29
長期 (7-11)	3,463	100.47	100.72	8.82	1.09	1.05	1.05	8.40	8.35	8.39	30
超長期 (11-)	6,109	86.88	87.15	21.02	1.19	2.04	1.89	17.32	17.15	17.13	29
AAA~BBB 格	26,360	96.66	96.84	8.50	0.81	1.03	1.00	7.21	7.15	7.16	27
短期 (1-3)	7,286	99.67	99.76	2.03	0.40	0.57	0.57	2.02	2.01	2.02	23
中期 (3-7)	8,848	99.89	100.03	4.67	0.74	0.74	0.74	4.58	4.56	4.58	27
長期 (7-)	10,226	91.73	91.99	16.43	1.15	1.66	1.57	13.69	13.57	13.57	31
長期 (7-11)	3,770	100.29	100.55	8.81	1.08	1.07	1.07	8.39	8.35	8.39	31
超長期 (11-)	6,457	86.73	87.00	20.88	1.18	2.05	1.91	17.26	17.08	17.07	30
AAA~BB 格	26,360	96.66	96.84	8.50	0.81	1.03	1.00	7.21	7.15	7.16	27
短期 (1-3)	7,286	99.67	99.76	2.03	0.40	0.57	0.57	2.02	2.01	2.02	23
中期 (3-7)	8,848	99.89	100.03	4.67	0.74	0.74	0.74	4.58	4.56	4.58	27
長期 (7-)	10,226	91.73	91.99	16.43	1.15	1.66	1.57	13.69	13.57	13.57	31
長期 (7-11)	3,770	100.29	100.55	8.81	1.08	1.07	1.07	8.39	8.35	8.39	31
超長期 (11-)	6,457	86.73	87.00	20.88	1.18	2.05	1.91	17.26	17.08	17.07	30
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	24,274	96.65	96.82	8.61	0.80	1.02	0.98	7.27	7.22	7.23	25
短期 (1-3)	6,946	99.69	99.78	2.02	0.41	0.57	0.57	2.01	2.00	2.01	23
中期 (3-7)	7,757	99.92	100.05	4.66	0.71	0.70	0.70	4.58	4.56	4.58	23
長期 (7-)	9,572	91.80	92.06	16.61	1.15	1.65	1.56	13.79	13.67	13.67	29
長期 (7-11)	3,463	100.47	100.72	8.82	1.09	1.05	1.05	8.40	8.35	8.39	30
超長期 (11-)	6,109	86.88	87.15	21.02	1.19	2.04	1.89	17.32	17.15	17.13	29
BBB 格	2,086	96.80	97.01	7.18	0.88	1.19	1.16	6.41	6.36	6.39	52
短期 (1-3)	340	99.23	99.28	2.15	0.29	0.65	0.65	2.14	2.13	2.14	30
中期 (3-7)	1,091	99.69	99.90	4.71	0.97	1.04	1.04	4.60	4.57	4.60	57
長期 (7-)	655	90.74	91.02	13.90	1.05	1.77	1.67	12.15	12.04	12.09	54
長期 (7-11)	307	98.27	98.55	8.75	1.01	1.24	1.23	8.36	8.31	8.36	48
超長期 (11-)	348	84.09	84.37	18.46	1.09	2.32	2.13	16.06	15.89	15.95	60
BB 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
B 格以下	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
格付なし	44,483	96.32	96.48	6.77	0.71	1.10	1.06	5.86	5.82	5.83	46
短期 (1-3)	13,891	99.50	99.61	1.98	0.49	0.75	0.75	1.97	1.97	1.97	42
中期 (3-7)	17,206	98.80	98.96	4.71	0.67	0.92	0.91	4.63	4.61	4.63	45
長期 (7-)	13,386	89.85	90.07	14.37	0.98	1.74	1.63	12.06	11.95	11.97	53
長期 (7-11)	6,460	97.67	97.92	8.55	1.00	1.32	1.29	8.18	8.13	8.17	57
超長期 (11-)	6,926	82.56	82.75	19.79	0.97	2.21	2.00	16.35	16.18	16.16	48

出所:NFRC

- 格付は、Moody's の格付をもとに NFRC で分類

事業債 Moody's 格付別・ポートフォリオ指標 (2024年9月末、10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	24,217	96.65	96.82	8.68	0.81	1.02	0.99	7.34	7.29	7.29	25
短期 (1-3)	6,862	99.74	99.83	2.08	0.44	0.57	0.57	2.07	2.06	2.07	23
中期 (3-7)	7,860	99.83	99.95	4.74	0.70	0.71	0.71	4.65	4.64	4.65	24
長期 (7-)	9,495	91.78	92.04	16.73	1.16	1.66	1.57	13.88	13.76	13.77	29
長期 (7-11)	3,379	100.57	100.83	8.90	1.11	1.06	1.06	8.47	8.42	8.46	30
超長期 (11-)	6,116	86.92	87.19	21.05	1.19	2.04	1.90	17.34	17.17	17.15	29
AAA~BBB 格	26,302	96.66	96.83	8.56	0.81	1.03	1.00	7.26	7.21	7.22	27
短期 (1-3)	7,202	99.71	99.81	2.08	0.43	0.58	0.58	2.07	2.07	2.07	23
中期 (3-7)	8,951	99.81	99.94	4.73	0.73	0.75	0.75	4.65	4.63	4.65	28
長期 (7-)	10,150	91.71	91.98	16.54	1.16	1.66	1.58	13.77	13.65	13.66	31
長期 (7-11)	3,686	100.38	100.64	8.89	1.10	1.07	1.07	8.46	8.41	8.45	31
超長期 (11-)	6,464	86.77	87.04	20.91	1.19	2.05	1.91	17.28	17.10	17.09	30
AAA~BB 格	26,302	96.66	96.83	8.56	0.81	1.03	1.00	7.26	7.21	7.22	27
短期 (1-3)	7,202	99.71	99.81	2.08	0.43	0.58	0.58	2.07	2.07	2.07	23
中期 (3-7)	8,951	99.81	99.94	4.73	0.73	0.75	0.75	4.65	4.63	4.65	28
長期 (7-)	10,150	91.71	91.98	16.54	1.16	1.66	1.58	13.77	13.65	13.66	31
長期 (7-11)	3,686	100.38	100.64	8.89	1.10	1.07	1.07	8.46	8.41	8.45	31
超長期 (11-)	6,464	86.77	87.04	20.91	1.19	2.05	1.91	17.28	17.10	17.09	30
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	24,217	96.65	96.82	8.68	0.81	1.02	0.99	7.34	7.29	7.29	25
短期 (1-3)	6,862	99.74	99.83	2.08	0.44	0.57	0.57	2.07	2.06	2.07	23
中期 (3-7)	7,860	99.83	99.95	4.74	0.70	0.71	0.71	4.65	4.64	4.65	24
長期 (7-)	9,495	91.78	92.04	16.73	1.16	1.66	1.57	13.88	13.76	13.77	29
長期 (7-11)	3,379	100.57	100.83	8.90	1.11	1.06	1.06	8.47	8.42	8.46	30
超長期 (11-)	6,116	86.92	87.19	21.05	1.19	2.04	1.90	17.34	17.17	17.15	29
BBB 格	2,086	96.80	97.01	7.18	0.88	1.19	1.16	6.41	6.36	6.39	52
短期 (1-3)	340	99.23	99.28	2.15	0.29	0.65	0.65	2.14	2.13	2.14	30
中期 (3-7)	1,091	99.69	99.90	4.71	0.97	1.04	1.04	4.60	4.57	4.60	57
長期 (7-)	655	90.74	91.02	13.90	1.05	1.77	1.67	12.15	12.04	12.09	54
長期 (7-11)	307	98.27	98.55	8.75	1.01	1.24	1.23	8.36	8.31	8.36	48
超長期 (11-)	348	84.09	84.37	18.46	1.09	2.32	2.13	16.06	15.89	15.95	60
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	44,382	96.32	96.48	6.81	0.71	1.10	1.07	5.90	5.86	5.88	46
短期 (1-3)	13,930	99.48	99.60	2.04	0.49	0.76	0.76	2.03	2.02	2.03	42
中期 (3-7)	17,383	98.72	98.88	4.81	0.66	0.93	0.92	4.72	4.70	4.72	45
長期 (7-)	13,068	89.75	89.96	14.57	1.00	1.76	1.65	12.21	12.10	12.12	53
長期 (7-11)	6,162	97.82	98.07	8.68	1.04	1.33	1.31	8.28	8.23	8.28	57
超長期 (11-)	6,906	82.55	82.73	19.82	0.97	2.21	2.01	16.37	16.20	16.18	49

出所:NFRC

- 格付は、Moody's の格付をもとに NFRC で分類

## 事業債 S&amp;P 格付別・ポートフォリオ指標 (2024年9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	86.05	86.28	17.62	0.98	1.70	1.53	13.61	13.48	13.46	31
短期 (1-3)	40	102.78	103.28	2.23	1.75	0.59	0.60	2.19	2.18	2.19	24
中期 (3-7)	115	96.90	96.96	5.49	0.22	0.79	0.78	5.45	5.43	5.45	28
長期 (7-)	696	83.30	83.54	20.51	1.06	1.95	1.74	15.99	15.82	15.80	32
長期 (7-11)	212	101.69	101.99	8.70	1.25	1.03	1.04	8.24	8.20	8.24	30
超長期 (11-)	484	75.24	75.46	25.69	0.98	2.49	2.15	20.57	20.34	20.28	34
AAA~A 格	16,407	95.27	95.41	8.98	0.75	1.04	0.99	7.40	7.34	7.35	27
短期 (1-3)	4,027	99.88	99.97	1.99	0.46	0.57	0.57	1.98	1.97	1.98	23
中期 (3-7)	5,599	99.59	99.72	4.90	0.67	0.75	0.74	4.81	4.79	4.81	27
長期 (7-)	6,781	88.97	89.14	16.51	0.98	1.63	1.50	13.39	13.28	13.26	29
長期 (7-11)	2,806	100.20	100.40	8.63	1.06	1.03	1.03	8.24	8.20	8.24	29
超長期 (11-)	3,976	81.05	81.19	22.07	0.93	2.15	1.92	17.89	17.70	17.65	29
AAA~BBB 格	16,622	95.31	95.45	8.93	0.75	1.04	0.99	7.36	7.30	7.31	27
短期 (1-3)	4,077	99.87	99.97	1.99	0.46	0.57	0.57	1.98	1.97	1.98	24
中期 (3-7)	5,734	99.57	99.70	4.88	0.67	0.75	0.75	4.80	4.78	4.80	27
長期 (7-)	6,811	89.00	89.17	16.48	0.98	1.62	1.50	13.37	13.26	13.25	29
長期 (7-11)	2,826	100.20	100.39	8.63	1.06	1.03	1.03	8.24	8.20	8.24	29
超長期 (11-)	3,986	81.07	81.21	22.05	0.93	2.15	1.92	17.87	17.69	17.64	29
AAA~BB 格	16,862	95.40	95.54	8.88	0.77	1.05	1.00	7.32	7.27	7.27	29
短期 (1-3)	4,077	99.87	99.97	1.99	0.46	0.57	0.57	1.98	1.97	1.98	24
中期 (3-7)	5,949	99.65	99.80	4.87	0.73	0.79	0.79	4.78	4.76	4.78	31
長期 (7-)	6,836	89.02	89.19	16.48	0.99	1.63	1.51	13.37	13.26	13.25	30
長期 (7-11)	2,826	100.20	100.39	8.63	1.06	1.03	1.03	8.24	8.20	8.24	29
超長期 (11-)	4,011	81.15	81.29	22.01	0.94	2.15	1.93	17.84	17.65	17.60	30
AAA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA 格	851	86.05	86.28	17.62	0.98	1.70	1.53	13.61	13.48	13.46	31
短期 (1-3)	40	102.78	103.28	2.23	1.75	0.59	0.60	2.19	2.18	2.19	24
中期 (3-7)	115	96.90	96.96	5.49	0.22	0.79	0.78	5.45	5.43	5.45	28
長期 (7-)	696	83.30	83.54	20.51	1.06	1.95	1.74	15.99	15.82	15.80	32
長期 (7-11)	212	101.69	101.99	8.70	1.25	1.03	1.04	8.24	8.20	8.24	30
超長期 (11-)	484	75.24	75.46	25.69	0.98	2.49	2.15	20.57	20.34	20.28	34
A 格	15,556	95.78	95.91	8.51	0.74	1.01	0.97	7.09	7.04	7.05	27
短期 (1-3)	3,987	99.85	99.94	1.98	0.45	0.57	0.57	1.97	1.97	1.97	23
中期 (3-7)	5,484	99.64	99.78	4.89	0.68	0.75	0.74	4.80	4.78	4.80	27
長期 (7-)	6,085	89.62	89.78	16.05	0.98	1.59	1.48	13.12	13.00	12.99	29
長期 (7-11)	2,594	100.08	100.27	8.62	1.04	1.02	1.02	8.24	8.20	8.24	29
超長期 (11-)	3,492	81.86	81.98	21.57	0.93	2.11	1.89	17.54	17.37	17.31	29
BBB 格	215	98.44	98.55	4.51	0.58	0.90	0.89	4.35	4.33	4.35	41
短期 (1-3)	50	99.24	99.31	1.95	0.28	0.68	0.67	1.95	1.94	1.95	34
中期 (3-7)	135	98.75	98.87	4.19	0.59	0.87	0.86	4.13	4.11	4.13	41
長期 (7-)	30	95.70	95.82	10.21	1.08	1.47	1.43	9.52	9.45	9.51	55
長期 (7-11)	20	99.77	99.80	8.46	1.15	1.18	1.18	8.09	8.04	8.08	47
超長期 (11-)	10	87.58	87.86	13.70	0.95	2.12	1.99	12.77	12.64	12.74	74
BB 格	240	101.16	101.59	5.66	2.26	1.87	1.87	5.13	5.08	5.12	133
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	215	101.98	102.36	4.50	2.25	1.76	1.77	4.29	4.25	4.28	131
長期 (7-)	25	94.15	94.96	15.66	2.37	2.91	2.83	12.97	12.79	12.89	147
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	25	94.15	94.96	15.66	2.37	2.91	2.83	12.97	12.79	12.89	147
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	53,980	96.78	96.95	6.95	0.73	1.08	1.05	6.07	6.02	6.04	42
短期 (1-3)	17,100	99.48	99.58	2.00	0.46	0.72	0.72	1.99	1.98	1.99	38
中期 (3-7)	20,104	99.03	99.18	4.64	0.68	0.88	0.88	4.56	4.54	4.56	41
長期 (7-)	16,776	91.33	91.60	14.77	1.08	1.73	1.64	12.53	12.42	12.45	48
長期 (7-11)	7,404	98.04	98.31	8.65	1.02	1.30	1.28	8.27	8.21	8.26	54
超長期 (11-)	9,372	86.04	86.30	19.60	1.13	2.12	1.97	16.38	16.21	16.21	43

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9月末、10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	86.05	86.28	17.62	0.98	1.70	1.53	13.61	13.48	13.46	31
短期 (1-3)	40	102.78	103.28	2.23	1.75	0.59	0.60	2.19	2.18	2.19	24
中期 (3-7)	115	96.90	96.96	5.49	0.22	0.79	0.78	5.45	5.43	5.45	28
長期 (7-)	696	83.30	83.54	20.51	1.06	1.95	1.74	15.99	15.82	15.80	32
長期 (7-11)	212	101.69	101.99	8.70	1.25	1.03	1.04	8.24	8.20	8.24	30
超長期 (11-)	484	75.24	75.46	25.69	0.98	2.49	2.15	20.57	20.34	20.28	34
AAA~A 格	16,321	95.25	95.38	9.03	0.75	1.04	1.00	7.44	7.38	7.39	27
短期 (1-3)	4,033	99.90	100.00	2.04	0.48	0.57	0.57	2.03	2.02	2.03	23
中期 (3-7)	5,592	99.53	99.66	4.97	0.66	0.75	0.75	4.88	4.86	4.88	27
長期 (7-)	6,696	88.87	89.04	16.63	0.99	1.64	1.51	13.49	13.37	13.36	29
長期 (7-11)	2,730	100.27	100.47	8.70	1.08	1.03	1.03	8.30	8.25	8.29	29
超長期 (11-)	3,966	81.02	81.16	22.10	0.93	2.15	1.92	17.91	17.72	17.67	29
AAA~BBB 格	16,536	95.29	95.43	8.97	0.75	1.04	0.99	7.40	7.34	7.35	27
短期 (1-3)	4,083	99.90	99.99	2.04	0.48	0.57	0.57	2.03	2.02	2.03	24
中期 (3-7)	5,727	99.51	99.64	4.95	0.66	0.75	0.75	4.87	4.85	4.87	27
長期 (7-)	6,726	88.90	89.07	16.60	0.99	1.64	1.51	13.47	13.35	13.34	29
長期 (7-11)	2,750	100.27	100.47	8.69	1.08	1.03	1.04	8.30	8.25	8.29	29
超長期 (11-)	3,976	81.04	81.18	22.08	0.93	2.15	1.92	17.89	17.71	17.66	29
AAA~BB 格	16,776	95.37	95.51	8.93	0.77	1.05	1.01	7.36	7.31	7.31	29
短期 (1-3)	4,083	99.90	99.99	2.04	0.48	0.57	0.57	2.03	2.02	2.03	24
中期 (3-7)	5,942	99.60	99.74	4.94	0.72	0.79	0.79	4.84	4.82	4.84	31
長期 (7-)	6,751	88.92	89.09	16.60	1.00	1.64	1.52	13.46	13.35	13.34	30
長期 (7-11)	2,750	100.27	100.47	8.69	1.08	1.03	1.04	8.30	8.25	8.29	29
超長期 (11-)	4,001	81.12	81.27	22.04	0.94	2.16	1.93	17.86	17.67	17.62	30
AAA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA 格	851	86.05	86.28	17.62	0.98	1.70	1.53	13.61	13.48	13.46	31
短期 (1-3)	40	102.78	103.28	2.23	1.75	0.59	0.60	2.19	2.18	2.19	24
中期 (3-7)	115	96.90	96.96	5.49	0.22	0.79	0.78	5.45	5.43	5.45	28
長期 (7-)	696	83.30	83.54	20.51	1.06	1.95	1.74	15.99	15.82	15.80	32
長期 (7-11)	212	101.69	101.99	8.70	1.25	1.03	1.04	8.24	8.20	8.24	30
超長期 (11-)	484	75.24	75.46	25.69	0.98	2.49	2.15	20.57	20.34	20.28	34
A 格	15,470	95.76	95.89	8.56	0.74	1.01	0.97	7.13	7.08	7.09	27
短期 (1-3)	3,993	99.87	99.97	2.04	0.47	0.57	0.57	2.03	2.02	2.03	23
中期 (3-7)	5,477	99.58	99.71	4.96	0.67	0.75	0.75	4.87	4.85	4.87	27
長期 (7-)	6,000	89.52	89.67	16.18	0.98	1.60	1.49	13.22	13.10	13.09	29
長期 (7-11)	2,518	100.15	100.34	8.70	1.06	1.03	1.03	8.30	8.26	8.30	29
超長期 (11-)	3,482	81.83	81.95	21.60	0.93	2.11	1.90	17.57	17.39	17.33	29
BBB 格	215	98.44	98.55	4.51	0.58	0.90	0.89	4.35	4.33	4.35	41
短期 (1-3)	50	99.24	99.31	1.95	0.28	0.68	0.67	1.95	1.94	1.95	34
中期 (3-7)	135	98.75	98.87	4.19	0.59	0.87	0.86	4.13	4.11	4.13	41
長期 (7-)	30	95.70	95.82	10.21	1.08	1.47	1.43	9.52	9.45	9.51	55
長期 (7-11)	20	99.77	99.80	8.46	1.15	1.18	1.18	8.09	8.04	8.08	47
超長期 (11-)	10	87.58	87.86	13.70	0.95	2.12	1.99	12.77	12.64	12.74	74
BB 格	240	101.16	101.59	5.66	2.26	1.87	1.87	5.13	5.08	5.12	133
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	215	101.98	102.36	4.50	2.25	1.76	1.77	4.29	4.25	4.28	131
長期 (7-)	25	94.15	94.96	15.66	2.37	2.91	2.83	12.97	12.79	12.89	147
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	25	94.15	94.96	15.66	2.37	2.91	2.83	12.97	12.79	12.89	147
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	53,908	96.78	96.95	7.01	0.74	1.08	1.05	6.12	6.08	6.09	42
短期 (1-3)	17,049	99.48	99.59	2.06	0.47	0.73	0.72	2.05	2.04	2.05	38
中期 (3-7)	20,392	98.94	99.09	4.74	0.68	0.89	0.88	4.65	4.63	4.65	41
長期 (7-)	16,467	91.30	91.56	14.95	1.10	1.75	1.65	12.68	12.56	12.59	48
長期 (7-11)	7,097	98.20	98.48	8.78	1.06	1.31	1.29	8.37	8.32	8.37	54
超長期 (11-)	9,369	86.07	86.33	19.63	1.13	2.12	1.97	16.40	16.24	16.24	43

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9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	1,452	99.59	99.82	3.12	0.83	0.98	0.98	3.05	3.04	3.05	58
短期(1-3)	769	99.70	99.90	1.95	0.72	0.89	0.89	1.93	1.92	1.93	56
中期(3-7)	613	99.56	99.81	3.95	0.93	1.04	1.04	3.88	3.86	3.88	60
長期(7-)	71	98.77	99.05	8.59	1.21	1.40	1.40	8.11	8.06	8.11	67
長期(7-11)	67	98.85	99.12	8.25	1.16	1.35	1.35	7.87	7.82	7.86	65
超長期(11-)	4	97.48	97.89	14.00	1.99	2.22	2.19	12.07	11.94	12.01	97
AAA~A格	3,106	99.40	99.68	3.55	1.02	1.21	1.21	3.40	3.38	3.40	78
短期(1-3)	1,660	99.65	99.90	2.07	0.92	1.08	1.08	2.05	2.04	2.05	74
中期(3-7)	1,169	99.03	99.29	3.96	0.97	1.22	1.22	3.88	3.86	3.88	77
長期(7-)	276	99.51	100.04	10.66	1.86	1.97	1.96	9.49	9.40	9.47	104
長期(7-11)	160	98.32	98.60	8.46	1.42	1.68	1.67	7.95	7.88	7.94	96
超長期(11-)	116	101.16	102.02	13.70	2.48	2.35	2.36	11.56	11.42	11.50	116
AAA~BBB格	3,576	99.40	99.70	3.75	1.05	1.23	1.22	3.58	3.55	3.57	78
短期(1-3)	1,838	99.67	99.93	2.07	0.92	1.08	1.08	2.05	2.03	2.05	74
中期(3-7)	1,381	99.15	99.43	4.11	1.01	1.23	1.23	4.02	3.99	4.02	78
長期(7-)	357	99.04	99.59	11.07	1.85	1.99	1.98	9.80	9.70	9.77	103
長期(7-11)	203	98.64	98.99	8.62	1.49	1.70	1.69	8.07	8.00	8.06	96
超長期(11-)	155	99.56	100.36	14.27	2.34	2.37	2.36	12.03	11.89	11.96	113
AAA~BB格	3,576	99.40	99.70	3.75	1.05	1.23	1.22	3.58	3.55	3.57	78
短期(1-3)	1,838	99.67	99.93	2.07	0.92	1.08	1.08	2.05	2.03	2.05	74
中期(3-7)	1,381	99.15	99.43	4.11	1.01	1.23	1.23	4.02	3.99	4.02	78
長期(7-)	357	99.04	99.59	11.07	1.85	1.99	1.98	9.80	9.70	9.77	103
長期(7-11)	203	98.64	98.99	8.62	1.49	1.70	1.69	8.07	8.00	8.06	96
超長期(11-)	155	99.56	100.36	14.27	2.34	2.37	2.36	12.03	11.89	11.96	113
AAA格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA格	1,452	99.59	99.82	3.12	0.83	0.98	0.98	3.05	3.04	3.05	58
短期(1-3)	769	99.70	99.90	1.95	0.72	0.89	0.89	1.93	1.92	1.93	56
中期(3-7)	613	99.56	99.81	3.95	0.93	1.04	1.04	3.88	3.86	3.88	60
長期(7-)	71	98.77	99.05	8.59	1.21	1.40	1.40	8.11	8.06	8.11	67
長期(7-11)	67	98.85	99.12	8.25	1.16	1.35	1.35	7.87	7.82	7.86	65
超長期(11-)	4	97.48	97.89	14.00	1.99	2.22	2.19	12.07	11.94	12.01	97
A格	1,653	99.24	99.57	3.92	1.19	1.42	1.42	3.71	3.68	3.70	96
短期(1-3)	891	99.60	99.90	2.18	1.09	1.25	1.25	2.15	2.14	2.15	90
中期(3-7)	557	98.45	98.73	3.96	1.02	1.42	1.41	3.88	3.85	3.88	97
長期(7-)	205	99.77	100.38	11.37	2.09	2.16	2.16	9.96	9.86	9.93	117
長期(7-11)	94	97.94	98.23	8.60	1.60	1.92	1.91	8.01	7.93	8.00	118
超長期(11-)	112	101.30	102.17	13.69	2.50	2.36	2.36	11.54	11.40	11.48	117
BBB格	471	99.39	99.80	5.13	1.22	1.32	1.31	4.75	4.71	4.74	79
短期(1-3)	178	99.85	100.15	2.03	0.91	1.02	1.02	2.01	2.00	2.01	68
中期(3-7)	211	99.76	100.18	4.93	1.25	1.29	1.28	4.76	4.73	4.76	81
長期(7-)	81	97.43	98.05	12.47	1.82	2.08	2.06	10.86	10.75	10.81	99
長期(7-11)	42	99.88	100.48	9.23	1.74	1.76	1.76	8.51	8.43	8.50	97
超長期(11-)	39	94.78	95.42	15.98	1.91	2.45	2.39	13.55	13.39	13.45	101
BB格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
B格以下	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
格付なし	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

出所:NFRC

- 格付は、格付会社4社の最高格付をもとにNFRCで分類

円建外債 最高格付別・ポートフォリオ指標 (2024年9月末、10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	1,334	99.58	99.80	3.30	0.85	0.99	0.99	3.23	3.21	3.23	58
短期 (1-3)	715	99.60	99.81	2.19	0.73	0.92	0.91	2.17	2.16	2.17	56
中期 (3-7)	560	99.54	99.78	4.12	0.95	1.05	1.04	4.04	4.02	4.04	60
長期 (7-)	60	99.61	99.91	8.89	1.36	1.42	1.42	8.33	8.27	8.32	66
長期 (7-11)	55	99.77	100.06	8.50	1.31	1.36	1.36	8.05	8.00	8.05	64
超長期 (11-)	4	97.48	97.89	14.00	1.99	2.22	2.19	12.07	11.94	12.01	97
AAA~A 格	3,125	99.41	99.68	3.70	1.07	1.25	1.25	3.54	3.51	3.54	81
短期 (1-3)	1,689	99.62	99.87	2.24	0.96	1.12	1.12	2.21	2.20	2.21	76
中期 (3-7)	1,159	99.03	99.28	4.09	1.01	1.25	1.25	4.00	3.98	4.00	80
長期 (7-)	278	99.72	100.24	10.94	1.95	2.02	2.02	9.67	9.57	9.64	108
長期 (7-11)	157	98.68	98.97	8.64	1.53	1.74	1.73	8.07	8.00	8.07	100
超長期 (11-)	121	101.06	101.90	13.94	2.50	2.38	2.38	11.69	11.55	11.63	117
AAA~BBB 格	3,596	99.41	99.70	3.89	1.09	1.26	1.26	3.70	3.67	3.69	80
短期 (1-3)	1,867	99.64	99.89	2.22	0.96	1.11	1.11	2.19	2.18	2.19	76
中期 (3-7)	1,370	99.14	99.42	4.22	1.05	1.26	1.25	4.12	4.10	4.12	80
長期 (7-)	359	99.20	99.75	11.28	1.92	2.04	2.03	9.93	9.83	9.90	106
長期 (7-11)	199	98.93	99.29	8.76	1.58	1.75	1.74	8.17	8.09	8.16	99
超長期 (11-)	160	99.53	100.32	14.44	2.35	2.39	2.38	12.12	11.98	12.05	113
AAA~BB 格	3,596	99.41	99.70	3.89	1.09	1.26	1.26	3.70	3.67	3.69	80
短期 (1-3)	1,867	99.64	99.89	2.22	0.96	1.11	1.11	2.19	2.18	2.19	76
中期 (3-7)	1,370	99.14	99.42	4.22	1.05	1.26	1.25	4.12	4.10	4.12	80
長期 (7-)	359	99.20	99.75	11.28	1.92	2.04	2.03	9.93	9.83	9.90	106
長期 (7-11)	199	98.93	99.29	8.76	1.58	1.75	1.74	8.17	8.09	8.16	99
超長期 (11-)	160	99.53	100.32	14.44	2.35	2.39	2.38	12.12	11.98	12.05	113
AAA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA 格	1,334	99.58	99.80	3.30	0.85	0.99	0.99	3.23	3.21	3.23	58
短期 (1-3)	715	99.60	99.81	2.19	0.73	0.92	0.91	2.17	2.16	2.17	56
中期 (3-7)	560	99.54	99.78	4.12	0.95	1.05	1.04	4.04	4.02	4.04	60
長期 (7-)	60	99.61	99.91	8.89	1.36	1.42	1.42	8.33	8.27	8.32	66
長期 (7-11)	55	99.77	100.06	8.50	1.31	1.36	1.36	8.05	8.00	8.05	64
超長期 (11-)	4	97.48	97.89	14.00	1.99	2.22	2.19	12.07	11.94	12.01	97
A 格	1,791	99.28	99.60	3.99	1.23	1.44	1.44	3.77	3.74	3.77	97
短期 (1-3)	974	99.63	99.91	2.27	1.13	1.27	1.27	2.24	2.22	2.24	91
中期 (3-7)	599	98.55	98.82	4.06	1.07	1.45	1.44	3.97	3.94	3.97	99
長期 (7-)	218	99.75	100.33	11.49	2.11	2.19	2.18	10.03	9.92	9.99	119
長期 (7-11)	102	98.09	98.37	8.71	1.66	1.95	1.94	8.08	8.01	8.08	120
超長期 (11-)	116	101.19	102.04	13.94	2.52	2.38	2.39	11.68	11.54	11.61	118
BBB 格	471	99.39	99.80	5.13	1.22	1.32	1.31	4.75	4.71	4.74	79
短期 (1-3)	178	99.85	100.15	2.03	0.91	1.02	1.02	2.01	2.00	2.01	68
中期 (3-7)	211	99.76	100.18	4.93	1.25	1.29	1.28	4.76	4.73	4.76	81
長期 (7-)	81	97.43	98.05	12.47	1.82	2.08	2.06	10.86	10.75	10.81	99
長期 (7-11)	42	99.88	100.48	9.23	1.74	1.76	1.76	8.51	8.43	8.50	97
超長期 (11-)	39	94.78	95.42	15.98	1.91	2.45	2.39	13.55	13.39	13.45	101
BB 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
B 格以下	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
格付なし	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

出所:NFRC

- 格付は、格付会社4社の最高格付をもとにNFRCで分類

## 円建外債 最低格付別・ポートフォリオ指標 (2024年9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	331	99.46	99.63	2.96	0.77	0.95	0.95	2.91	2.89	2.91	56
短期(1-3)	213	99.70	99.88	2.07	0.75	0.91	0.91	2.05	2.04	2.05	57
中期(3-7)	104	99.12	99.28	4.09	0.78	1.02	1.01	4.03	4.01	4.03	57
長期(7-)	14	98.45	98.53	8.12	0.94	1.20	1.18	7.83	7.79	7.83	50
長期(7-11)	14	98.45	98.53	8.12	0.94	1.20	1.18	7.83	7.79	7.83	50
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AAA~A格	2,128	99.81	100.09	3.32	0.96	1.06	1.06	3.21	3.19	3.21	65
短期(1-3)	1,213	99.78	100.03	2.01	0.87	0.98	0.98	1.99	1.98	1.99	64
中期(3-7)	762	99.51	99.77	3.95	0.95	1.07	1.07	3.88	3.86	3.88	63
長期(7-)	152	101.51	102.09	10.56	1.76	1.69	1.71	9.47	9.38	9.44	79
長期(7-11)	91	98.24	98.53	8.30	1.09	1.37	1.36	7.92	7.87	7.92	66
超長期(11-)	62	106.30	107.32	13.88	2.73	2.12	2.18	11.55	11.43	11.49	97
AAA~BBB格	3,576	99.40	99.70	3.75	1.05	1.23	1.22	3.58	3.55	3.57	78
短期(1-3)	1,838	99.67	99.93	2.07	0.92	1.08	1.08	2.05	2.03	2.05	74
中期(3-7)	1,381	99.15	99.43	4.11	1.01	1.23	1.23	4.02	3.99	4.02	78
長期(7-)	357	99.04	99.59	11.07	1.85	1.99	1.98	9.80	9.70	9.77	103
長期(7-11)	203	98.64	98.99	8.62	1.49	1.70	1.69	8.07	8.00	8.06	96
超長期(11-)	155	99.56	100.36	14.27	2.34	2.37	2.36	12.03	11.89	11.96	113
AAA~BB格	3,576	99.40	99.70	3.75	1.05	1.23	1.22	3.58	3.55	3.57	78
短期(1-3)	1,838	99.67	99.93	2.07	0.92	1.08	1.08	2.05	2.03	2.05	74
中期(3-7)	1,381	99.15	99.43	4.11	1.01	1.23	1.23	4.02	3.99	4.02	78
長期(7-)	357	99.04	99.59	11.07	1.85	1.99	1.98	9.80	9.70	9.77	103
長期(7-11)	203	98.64	98.99	8.62	1.49	1.70	1.69	8.07	8.00	8.06	96
超長期(11-)	155	99.56	100.36	14.27	2.34	2.37	2.36	12.03	11.89	11.96	113
AAA格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA格	331	99.46	99.63	2.96	0.77	0.95	0.95	2.91	2.89	2.91	56
短期(1-3)	213	99.70	99.88	2.07	0.75	0.91	0.91	2.05	2.04	2.05	57
中期(3-7)	104	99.12	99.28	4.09	0.78	1.02	1.01	4.03	4.01	4.03	57
長期(7-)	14	98.45	98.53	8.12	0.94	1.20	1.18	7.83	7.79	7.83	50
長期(7-11)	14	98.45	98.53	8.12	0.94	1.20	1.18	7.83	7.79	7.83	50
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
A格	1,796	99.87	100.17	3.39	0.99	1.08	1.08	3.27	3.25	3.26	66
短期(1-3)	1,000	99.80	100.07	2.00	0.89	1.00	1.00	1.98	1.97	1.98	66
中期(3-7)	658	99.57	99.85	3.93	0.97	1.08	1.08	3.85	3.83	3.85	64
長期(7-)	139	101.81	102.45	10.80	1.84	1.73	1.76	9.62	9.54	9.59	82
長期(7-11)	77	98.21	98.53	8.33	1.12	1.40	1.39	7.94	7.88	7.93	69
超長期(11-)	62	106.30	107.32	13.88	2.73	2.12	2.18	11.55	11.43	11.49	97
BBB格	1,449	98.81	99.13	4.39	1.18	1.47	1.46	4.12	4.09	4.12	98
短期(1-3)	625	99.45	99.71	2.18	1.02	1.27	1.26	2.15	2.14	2.15	91
中期(3-7)	619	98.70	99.01	4.30	1.09	1.43	1.42	4.19	4.16	4.19	97
長期(7-)	205	97.21	97.72	11.45	1.93	2.23	2.20	10.06	9.94	10.02	122
長期(7-11)	112	98.97	99.37	8.88	1.80	1.97	1.96	8.19	8.11	8.18	120
超長期(11-)	93	95.10	95.75	14.54	2.07	2.56	2.50	12.39	12.24	12.32	124
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9月末、10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	310	99.44	99.60	3.09	0.76	0.95	0.94	3.04	3.02	3.04	55
短期 (1-3)	199	99.67	99.84	2.21	0.76	0.91	0.91	2.19	2.18	2.19	56
中期 (3-7)	98	99.12	99.24	4.16	0.74	0.98	0.98	4.10	4.08	4.10	53
長期 (7-)	14	98.45	98.53	8.12	0.94	1.20	1.18	7.83	7.79	7.83	50
長期 (7-11)	14	98.45	98.53	8.12	0.94	1.20	1.18	7.83	7.79	7.83	50
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AAA~A 格	2,009	99.81	100.09	3.45	0.98	1.08	1.08	3.34	3.32	3.34	65
短期 (1-3)	1,160	99.72	99.98	2.17	0.88	1.00	1.00	2.14	2.13	2.14	65
中期 (3-7)	709	99.49	99.74	4.09	0.97	1.08	1.07	4.00	3.98	4.00	63
長期 (7-)	141	102.09	102.70	10.84	1.87	1.72	1.74	9.66	9.57	9.63	80
長期 (7-11)	79	98.80	99.10	8.48	1.19	1.38	1.37	8.06	8.00	8.05	65
超長期 (11-)	62	106.30	107.32	13.88	2.73	2.12	2.18	11.55	11.43	11.49	97
AAA~BBB 格	3,596	99.41	99.70	3.89	1.09	1.26	1.26	3.70	3.67	3.69	80
短期 (1-3)	1,867	99.64	99.89	2.22	0.96	1.11	1.11	2.19	2.18	2.19	76
中期 (3-7)	1,370	99.14	99.42	4.22	1.05	1.26	1.25	4.12	4.10	4.12	80
長期 (7-)	359	99.20	99.75	11.28	1.92	2.04	2.03	9.93	9.83	9.90	106
長期 (7-11)	199	98.93	99.29	8.76	1.58	1.75	1.74	8.17	8.09	8.16	99
超長期 (11-)	160	99.53	100.32	14.44	2.35	2.39	2.38	12.12	11.98	12.05	113
AAA~BB 格	3,596	99.41	99.70	3.89	1.09	1.26	1.26	3.70	3.67	3.69	80
短期 (1-3)	1,867	99.64	99.89	2.22	0.96	1.11	1.11	2.19	2.18	2.19	76
中期 (3-7)	1,370	99.14	99.42	4.22	1.05	1.26	1.25	4.12	4.10	4.12	80
長期 (7-)	359	99.20	99.75	11.28	1.92	2.04	2.03	9.93	9.83	9.90	106
長期 (7-11)	199	98.93	99.29	8.76	1.58	1.75	1.74	8.17	8.09	8.16	99
超長期 (11-)	160	99.53	100.32	14.44	2.35	2.39	2.38	12.12	11.98	12.05	113
AAA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA 格	310	99.44	99.60	3.09	0.76	0.95	0.94	3.04	3.02	3.04	55
短期 (1-3)	199	99.67	99.84	2.21	0.76	0.91	0.91	2.19	2.18	2.19	56
中期 (3-7)	98	99.12	99.24	4.16	0.74	0.98	0.98	4.10	4.08	4.10	53
長期 (7-)	14	98.45	98.53	8.12	0.94	1.20	1.18	7.83	7.79	7.83	50
長期 (7-11)	14	98.45	98.53	8.12	0.94	1.20	1.18	7.83	7.79	7.83	50
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
A 格	1,700	99.87	100.18	3.52	1.02	1.10	1.10	3.39	3.37	3.39	67
短期 (1-3)	961	99.74	100.01	2.16	0.90	1.02	1.02	2.14	2.12	2.14	67
中期 (3-7)	611	99.55	99.82	4.07	1.00	1.09	1.09	3.99	3.96	3.99	64
長期 (7-)	127	102.48	103.15	11.14	1.97	1.77	1.80	9.85	9.75	9.81	83
長期 (7-11)	65	98.88	99.22	8.55	1.24	1.42	1.41	8.10	8.05	8.10	68
超長期 (11-)	62	106.30	107.32	13.88	2.73	2.12	2.18	11.55	11.43	11.49	97
BBB 格	1,586	98.90	99.20	4.43	1.22	1.49	1.48	4.16	4.12	4.15	100
短期 (1-3)	708	99.51	99.75	2.30	1.08	1.29	1.29	2.27	2.26	2.27	93
中期 (3-7)	661	98.77	99.07	4.37	1.14	1.46	1.45	4.25	4.22	4.25	99
長期 (7-)	218	97.34	97.83	11.57	1.96	2.25	2.22	10.12	10.01	10.08	123
長期 (7-11)	120	99.02	99.41	8.95	1.83	1.99	1.98	8.24	8.15	8.23	122
超長期 (11-)	98	95.26	95.90	14.79	2.11	2.59	2.53	12.52	12.37	12.44	125
BB 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
B 格以下	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
格付なし	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

出所:NFRC

- 格付は、格付会社 4 社の最低格付をもとに NFRC で分類

## 円建外債 R&amp;I 格付別・ポートフォリオ指標 (2024年9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	100.28	100.59	1.76	1.37	1.22	1.22	1.74	1.73	1.74	90
短期(1-3)	30	100.28	100.59	1.76	1.37	1.22	1.22	1.74	1.73	1.74	90
中期(3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AAA~A格	754	99.12	99.39	3.05	0.98	1.24	1.24	2.98	2.96	2.98	84
短期(1-3)	408	99.53	99.80	2.03	0.95	1.16	1.15	2.01	2.00	2.01	82
中期(3-7)	317	98.86	99.14	3.90	1.02	1.33	1.32	3.82	3.80	3.82	89
長期(7-)	29	96.22	96.47	8.10	0.96	1.50	1.48	7.78	7.72	7.77	80
長期(7-11)	29	96.22	96.47	8.10	0.96	1.50	1.48	7.78	7.72	7.77	80
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AAA~BBB格	766	98.96	99.24	3.18	0.99	1.26	1.25	3.09	3.07	3.09	85
短期(1-3)	408	99.53	99.80	2.03	0.95	1.16	1.15	2.01	2.00	2.01	82
中期(3-7)	317	98.86	99.14	3.90	1.02	1.33	1.32	3.82	3.80	3.82	89
長期(7-)	41	94.12	94.41	9.25	1.06	1.77	1.72	8.68	8.60	8.67	93
長期(7-11)	29	96.22	96.47	8.10	0.96	1.50	1.48	7.78	7.72	7.77	80
超長期(11-)	11	88.75	89.16	12.19	1.32	2.53	2.39	11.18	11.05	11.16	129
AAA~BB格	766	98.96	99.24	3.18	0.99	1.26	1.25	3.09	3.07	3.09	85
短期(1-3)	408	99.53	99.80	2.03	0.95	1.16	1.15	2.01	2.00	2.01	82
中期(3-7)	317	98.86	99.14	3.90	1.02	1.33	1.32	3.82	3.80	3.82	89
長期(7-)	41	94.12	94.41	9.25	1.06	1.77	1.72	8.68	8.60	8.67	93
長期(7-11)	29	96.22	96.47	8.10	0.96	1.50	1.48	7.78	7.72	7.77	80
超長期(11-)	11	88.75	89.16	12.19	1.32	2.53	2.39	11.18	11.05	11.16	129
AAA格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA格	30	100.28	100.59	1.76	1.37	1.22	1.22	1.74	1.73	1.74	90
短期(1-3)	30	100.28	100.59	1.76	1.37	1.22	1.22	1.74	1.73	1.74	90
中期(3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
A格	724	99.07	99.34	3.10	0.97	1.24	1.24	3.03	3.02	3.03	84
短期(1-3)	378	99.47	99.74	2.05	0.92	1.15	1.15	2.03	2.02	2.03	81
中期(3-7)	317	98.86	99.14	3.90	1.02	1.33	1.32	3.82	3.80	3.82	89
長期(7-)	29	96.22	96.47	8.10	0.96	1.50	1.48	7.78	7.72	7.77	80
長期(7-11)	29	96.22	96.47	8.10	0.96	1.50	1.48	7.78	7.72	7.77	80
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
BBB格	11	88.75	89.16	12.19	1.32	2.53	2.39	11.18	11.05	11.16	129
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-)	11	88.75	89.16	12.19	1.32	2.53	2.39	11.18	11.05	11.16	129
長期(7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期(11-)	11	88.75	89.16	12.19	1.32	2.53	2.39	11.18	11.05	11.16	129
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	2,811	99.52	99.82	3.91	1.07	1.22	1.22	3.71	3.68	3.71	76
短期(1-3)	1,430	99.71	99.96	2.08	0.91	1.06	1.05	2.06	2.05	2.06	71
中期(3-7)	1,064	99.23	99.52	4.17	1.01	1.20	1.20	4.07	4.05	4.07	75
長期(7-)	317	99.67	100.25	11.30	1.96	2.02	2.02	9.93	9.83	9.90	104
長期(7-11)	173	99.05	99.42	8.70	1.57	1.73	1.73	8.11	8.05	8.11	99
超長期(11-)	144	100.42	101.25	14.44	2.42	2.36	2.36	12.09	11.95	12.02	111

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9月末、10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	100.28	100.59	1.76	1.37	1.22	1.22	1.74	1.73	1.74	90
短期 (1-3)	30	100.28	100.59	1.76	1.37	1.22	1.22	1.74	1.73	1.74	90
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AAA~A 格	740	99.11	99.38	3.09	0.98	1.24	1.23	3.02	3.00	3.02	84
短期 (1-3)	394	99.53	99.79	2.07	0.95	1.15	1.14	2.04	2.03	2.04	80
中期 (3-7)	317	98.86	99.14	3.90	1.02	1.33	1.32	3.82	3.80	3.82	89
長期 (7-)	29	96.22	96.47	8.10	0.96	1.50	1.48	7.78	7.72	7.77	80
長期 (7-11)	29	96.22	96.47	8.10	0.96	1.50	1.48	7.78	7.72	7.77	80
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AAA~BBB 格	751	98.95	99.23	3.23	0.99	1.26	1.25	3.13	3.11	3.13	84
短期 (1-3)	394	99.53	99.79	2.07	0.95	1.15	1.14	2.04	2.03	2.04	80
中期 (3-7)	317	98.86	99.14	3.90	1.02	1.33	1.32	3.82	3.80	3.82	89
長期 (7-)	41	94.12	94.41	9.25	1.06	1.77	1.72	8.68	8.60	8.67	93
長期 (7-11)	29	96.22	96.47	8.10	0.96	1.50	1.48	7.78	7.72	7.77	80
超長期 (11-)	11	88.75	89.16	12.19	1.32	2.53	2.39	11.18	11.05	11.16	129
AAA~BB 格	751	98.95	99.23	3.23	0.99	1.26	1.25	3.13	3.11	3.13	84
短期 (1-3)	394	99.53	99.79	2.07	0.95	1.15	1.14	2.04	2.03	2.04	80
中期 (3-7)	317	98.86	99.14	3.90	1.02	1.33	1.32	3.82	3.80	3.82	89
長期 (7-)	41	94.12	94.41	9.25	1.06	1.77	1.72	8.68	8.60	8.67	93
長期 (7-11)	29	96.22	96.47	8.10	0.96	1.50	1.48	7.78	7.72	7.77	80
超長期 (11-)	11	88.75	89.16	12.19	1.32	2.53	2.39	11.18	11.05	11.16	129
AAA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA 格	30	100.28	100.59	1.76	1.37	1.22	1.22	1.74	1.73	1.74	90
短期 (1-3)	30	100.28	100.59	1.76	1.37	1.22	1.22	1.74	1.73	1.74	90
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
A 格	710	99.06	99.33	3.14	0.97	1.24	1.23	3.08	3.06	3.08	84
短期 (1-3)	364	99.47	99.73	2.09	0.92	1.14	1.14	2.07	2.06	2.07	80
中期 (3-7)	317	98.86	99.14	3.90	1.02	1.33	1.32	3.82	3.80	3.82	89
長期 (7-)	29	96.22	96.47	8.10	0.96	1.50	1.48	7.78	7.72	7.77	80
長期 (7-11)	29	96.22	96.47	8.10	0.96	1.50	1.48	7.78	7.72	7.77	80
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
BBB 格	11	88.75	89.16	12.19	1.32	2.53	2.39	11.18	11.05	11.16	129
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	11	88.75	89.16	12.19	1.32	2.53	2.39	11.18	11.05	11.16	129
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	11	88.75	89.16	12.19	1.32	2.53	2.39	11.18	11.05	11.16	129
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	2,845	99.53	99.82	4.06	1.11	1.26	1.26	3.85	3.82	3.84	79
短期 (1-3)	1,473	99.67	99.92	2.26	0.96	1.10	1.10	2.23	2.22	2.23	74
中期 (3-7)	1,053	99.23	99.50	4.32	1.06	1.24	1.23	4.21	4.19	4.21	78
長期 (7-)	318	99.85	100.42	11.54	2.03	2.07	2.06	10.08	9.98	10.04	107
長期 (7-11)	170	99.40	99.77	8.87	1.68	1.79	1.78	8.23	8.16	8.22	103
超長期 (11-)	148	100.36	101.18	14.61	2.43	2.38	2.38	12.19	12.04	12.11	112

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9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	99.52	99.75	3.23	1.04	1.17	1.17	3.12	3.10	3.12	77
短期 (1-3)	160	99.85	100.05	2.09	0.96	1.06	1.06	2.07	2.06	2.07	71
中期 (3-7)	73	99.45	99.74	4.00	1.12	1.27	1.26	3.91	3.88	3.91	82
長期 (7-)	22	97.39	97.66	8.88	1.36	1.72	1.70	8.23	8.16	8.22	96
長期 (7-11)	18	97.37	97.61	7.69	1.21	1.61	1.59	7.33	7.27	7.33	95
超長期 (11-)	4	97.48	97.89	14.00	1.99	2.22	2.19	12.07	11.94	12.01	97
AAA~A 格	944	99.45	99.83	4.54	1.35	1.51	1.51	4.21	4.17	4.20	100
短期 (1-3)	511	99.80	100.13	2.19	1.19	1.27	1.27	2.16	2.15	2.16	92
中期 (3-7)	248	98.40	98.69	4.08	1.09	1.49	1.48	3.98	3.95	3.98	103
長期 (7-)	186	99.90	100.55	11.61	2.14	2.19	2.19	10.12	10.00	10.08	119
長期 (7-11)	73	98.01	98.33	8.25	1.62	1.93	1.91	7.71	7.64	7.71	122
超長期 (11-)	113	101.11	101.97	13.77	2.48	2.36	2.36	11.61	11.47	11.55	116
AAA~BBB 格	945	99.45	99.83	4.54	1.35	1.51	1.51	4.21	4.17	4.20	100
短期 (1-3)	511	99.80	100.13	2.19	1.19	1.27	1.27	2.16	2.15	2.16	92
中期 (3-7)	249	98.38	98.67	4.08	1.09	1.49	1.48	3.99	3.96	3.99	104
長期 (7-)	186	99.90	100.55	11.61	2.14	2.19	2.19	10.12	10.00	10.08	119
長期 (7-11)	73	98.01	98.33	8.25	1.62	1.93	1.91	7.71	7.64	7.71	122
超長期 (11-)	113	101.11	101.97	13.77	2.48	2.36	2.36	11.61	11.47	11.55	116
AAA~BB 格	945	99.45	99.83	4.54	1.35	1.51	1.51	4.21	4.17	4.20	100
短期 (1-3)	511	99.80	100.13	2.19	1.19	1.27	1.27	2.16	2.15	2.16	92
中期 (3-7)	249	98.38	98.67	4.08	1.09	1.49	1.48	3.99	3.96	3.99	104
長期 (7-)	186	99.90	100.55	11.61	2.14	2.19	2.19	10.12	10.00	10.08	119
長期 (7-11)	73	98.01	98.33	8.25	1.62	1.93	1.91	7.71	7.64	7.71	122
超長期 (11-)	113	101.11	101.97	13.77	2.48	2.36	2.36	11.61	11.47	11.55	116
AAA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA 格	255	99.52	99.75	3.23	1.04	1.17	1.17	3.12	3.10	3.12	77
短期 (1-3)	160	99.85	100.05	2.09	0.96	1.06	1.06	2.07	2.06	2.07	71
中期 (3-7)	73	99.45	99.74	4.00	1.12	1.27	1.26	3.91	3.88	3.91	82
長期 (7-)	22	97.39	97.66	8.88	1.36	1.72	1.70	8.23	8.16	8.22	96
長期 (7-11)	18	97.37	97.61	7.69	1.21	1.61	1.59	7.33	7.27	7.33	95
超長期 (11-)	4	97.48	97.89	14.00	1.99	2.22	2.19	12.07	11.94	12.01	97
A 格	690	99.43	99.86	5.02	1.47	1.64	1.63	4.61	4.57	4.60	109
短期 (1-3)	351	99.78	100.17	2.24	1.30	1.37	1.37	2.20	2.19	2.20	101
中期 (3-7)	176	97.96	98.26	4.11	1.08	1.58	1.57	4.01	3.98	4.01	112
長期 (7-)	163	100.24	100.94	11.98	2.25	2.26	2.26	10.37	10.25	10.32	122
長期 (7-11)	55	98.23	98.57	8.44	1.75	2.03	2.02	7.83	7.76	7.83	131
超長期 (11-)	109	101.25	102.13	13.76	2.50	2.36	2.37	11.59	11.45	11.53	117
BBB 格	1	93.78	93.81	4.97	1.05	2.45	2.38	4.85	4.80	4.85	191
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	1	93.78	93.81	4.97	1.05	2.45	2.38	4.85	4.80	4.85	191
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
BB 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
B 格以下	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
格付なし	2,631	99.39	99.65	3.47	0.94	1.13	1.12	3.35	3.33	3.35	70
短期 (1-3)	1,328	99.61	99.85	2.02	0.82	1.00	1.00	2.00	1.99	2.00	66
中期 (3-7)	1,131	99.31	99.60	4.11	0.99	1.17	1.17	4.02	4.00	4.02	72
長期 (7-)	172	98.11	98.55	10.48	1.54	1.77	1.76	9.45	9.36	9.42	86
長期 (7-11)	130	99.00	99.36	8.82	1.41	1.57	1.57	8.26	8.20	8.26	82
超長期 (11-)	42	95.36	96.02	15.63	1.94	2.42	2.37	13.25	13.10	13.16	102

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9月末、10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	243	99.51	99.73	3.33	1.04	1.17	1.17	3.22	3.20	3.22	76
短期 (1-3)	155	99.83	100.02	2.21	0.97	1.07	1.07	2.18	2.17	2.18	72
中期 (3-7)	66	99.47	99.74	4.09	1.09	1.23	1.23	4.00	3.98	4.00	78
長期 (7-)	22	97.39	97.66	8.88	1.36	1.72	1.70	8.23	8.16	8.22	96
長期 (7-11)	18	97.37	97.61	7.69	1.21	1.61	1.59	7.33	7.27	7.33	95
超長期 (11-)	4	97.48	97.89	14.00	1.99	2.22	2.19	12.07	11.94	12.01	97
AAA~A 格	1,085	99.50	99.85	4.57	1.39	1.53	1.53	4.24	4.20	4.23	103
短期 (1-3)	603	99.81	100.10	2.34	1.23	1.31	1.31	2.30	2.29	2.30	95
中期 (3-7)	284	98.59	98.86	4.30	1.19	1.53	1.52	4.18	4.15	4.18	107
長期 (7-)	198	99.87	100.48	11.73	2.17	2.22	2.21	10.18	10.07	10.14	120
長期 (7-11)	81	98.19	98.50	8.42	1.68	1.97	1.95	7.84	7.76	7.83	124
超長期 (11-)	118	101.02	101.85	14.01	2.50	2.38	2.39	11.74	11.60	11.68	117
AAA~BBB 格	1,086	99.50	99.84	4.57	1.39	1.54	1.53	4.24	4.20	4.23	103
短期 (1-3)	603	99.81	100.10	2.34	1.23	1.31	1.31	2.30	2.29	2.30	95
中期 (3-7)	285	98.57	98.84	4.30	1.19	1.53	1.52	4.18	4.15	4.18	107
長期 (7-)	198	99.87	100.48	11.73	2.17	2.22	2.21	10.18	10.07	10.14	120
長期 (7-11)	81	98.19	98.50	8.42	1.68	1.97	1.95	7.84	7.76	7.83	124
超長期 (11-)	118	101.02	101.85	14.01	2.50	2.38	2.39	11.74	11.60	11.68	117
AAA~BB 格	1,086	99.50	99.84	4.57	1.39	1.54	1.53	4.24	4.20	4.23	103
短期 (1-3)	603	99.81	100.10	2.34	1.23	1.31	1.31	2.30	2.29	2.30	95
中期 (3-7)	285	98.57	98.84	4.30	1.19	1.53	1.52	4.18	4.15	4.18	107
長期 (7-)	198	99.87	100.48	11.73	2.17	2.22	2.21	10.18	10.07	10.14	120
長期 (7-11)	81	98.19	98.50	8.42	1.68	1.97	1.95	7.84	7.76	7.83	124
超長期 (11-)	118	101.02	101.85	14.01	2.50	2.38	2.39	11.74	11.60	11.68	117
AAA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA 格	243	99.51	99.73	3.33	1.04	1.17	1.17	3.22	3.20	3.22	76
短期 (1-3)	155	99.83	100.02	2.21	0.97	1.07	1.07	2.18	2.17	2.18	72
中期 (3-7)	66	99.47	99.74	4.09	1.09	1.23	1.23	4.00	3.98	4.00	78
長期 (7-)	22	97.39	97.66	8.88	1.36	1.72	1.70	8.23	8.16	8.22	96
長期 (7-11)	18	97.37	97.61	7.69	1.21	1.61	1.59	7.33	7.27	7.33	95
超長期 (11-)	4	97.48	97.89	14.00	1.99	2.22	2.19	12.07	11.94	12.01	97
A 格	842	99.50	99.88	4.93	1.49	1.64	1.63	4.53	4.49	4.52	110
短期 (1-3)	448	99.80	100.13	2.38	1.32	1.39	1.39	2.35	2.33	2.35	103
中期 (3-7)	218	98.32	98.59	4.36	1.21	1.62	1.61	4.24	4.20	4.24	116
長期 (7-)	176	100.18	100.84	12.09	2.27	2.28	2.28	10.42	10.30	10.38	123
長期 (7-11)	63	98.43	98.75	8.63	1.82	2.07	2.06	7.98	7.90	7.97	133
超長期 (11-)	113	101.15	102.00	14.01	2.52	2.39	2.40	11.73	11.59	11.66	118
BBB 格	1	93.78	93.81	4.97	1.05	2.45	2.38	4.85	4.80	4.85	191
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	1	93.78	93.81	4.97	1.05	2.45	2.38	4.85	4.80	4.85	191
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
BB 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
B 格以下	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
格付なし	2,510	99.37	99.63	3.59	0.96	1.14	1.14	3.46	3.44	3.46	71
短期 (1-3)	1,264	99.56	99.79	2.16	0.82	1.02	1.01	2.14	2.13	2.14	67
中期 (3-7)	1,085	99.29	99.57	4.20	1.01	1.19	1.18	4.11	4.08	4.11	73
長期 (7-)	160	98.37	98.83	10.73	1.62	1.81	1.79	9.62	9.53	9.59	87
長期 (7-11)	119	99.44	99.82	8.99	1.51	1.60	1.59	8.39	8.32	8.38	83
超長期 (11-)	42	95.36	96.02	15.63	1.94	2.42	2.37	13.25	13.10	13.16	102

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9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	1,282	99.57	99.80	3.07	0.79	0.95	0.95	3.02	3.00	3.02	55
短期 (1-3)	661	99.65	99.85	1.88	0.66	0.86	0.86	1.87	1.86	1.87	53
中期 (3-7)	566	99.57	99.81	3.94	0.91	1.02	1.02	3.87	3.85	3.87	58
長期 (7-)	56	98.80	99.06	8.32	1.07	1.28	1.27	7.96	7.91	7.95	56
長期 (7-11)	56	98.80	99.06	8.32	1.07	1.28	1.27	7.96	7.91	7.95	56
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AAA～A 格	2,183	99.78	100.06	3.38	0.95	1.06	1.06	3.26	3.24	3.26	64
短期 (1-3)	1,214	99.78	100.03	2.02	0.84	0.95	0.95	2.00	1.99	2.00	62
中期 (3-7)	801	99.44	99.71	3.93	0.95	1.09	1.09	3.86	3.84	3.86	65
長期 (7-)	168	101.34	101.89	10.52	1.79	1.73	1.75	9.43	9.35	9.41	84
長期 (7-11)	106	98.46	98.74	8.57	1.25	1.49	1.48	8.10	8.04	8.09	75
超長期 (11-)	62	106.30	107.32	13.88	2.73	2.12	2.18	11.55	11.43	11.49	97
AAA～BBB 格	3,336	99.47	99.76	3.84	1.03	1.19	1.19	3.65	3.63	3.65	74
短期 (1-3)	1,645	99.75	99.99	2.07	0.87	1.00	1.00	2.05	2.04	2.05	66
中期 (3-7)	1,341	99.21	99.49	4.10	1.01	1.21	1.21	4.01	3.99	4.01	76
長期 (7-)	350	99.15	99.71	11.15	1.87	1.99	1.98	9.86	9.76	9.82	102
長期 (7-11)	195	98.83	99.19	8.67	1.50	1.69	1.68	8.10	8.04	8.10	94
超長期 (11-)	155	99.56	100.36	14.27	2.34	2.37	2.36	12.03	11.89	11.96	113
AAA～BB 格	3,336	99.47	99.76	3.84	1.03	1.19	1.19	3.65	3.63	3.65	74
短期 (1-3)	1,645	99.75	99.99	2.07	0.87	1.00	1.00	2.05	2.04	2.05	66
中期 (3-7)	1,341	99.21	99.49	4.10	1.01	1.21	1.21	4.01	3.99	4.01	76
長期 (7-)	350	99.15	99.71	11.15	1.87	1.99	1.98	9.86	9.76	9.82	102
長期 (7-11)	195	98.83	99.19	8.67	1.50	1.69	1.68	8.10	8.04	8.10	94
超長期 (11-)	155	99.56	100.36	14.27	2.34	2.37	2.36	12.03	11.89	11.96	113
AAA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA 格	1,282	99.57	99.80	3.07	0.79	0.95	0.95	3.02	3.00	3.02	55
短期 (1-3)	661	99.65	99.85	1.88	0.66	0.86	0.86	1.87	1.86	1.87	53
中期 (3-7)	566	99.57	99.81	3.94	0.91	1.02	1.02	3.87	3.85	3.87	58
長期 (7-)	56	98.80	99.06	8.32	1.07	1.28	1.27	7.96	7.91	7.95	56
長期 (7-11)	56	98.80	99.06	8.32	1.07	1.28	1.27	7.96	7.91	7.95	56
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
A 格	901	100.07	100.42	3.80	1.19	1.23	1.23	3.61	3.58	3.60	77
短期 (1-3)	553	99.95	100.25	2.18	1.06	1.07	1.07	2.15	2.14	2.15	72
中期 (3-7)	236	99.15	99.45	3.91	1.04	1.25	1.25	3.83	3.81	3.83	81
長期 (7-)	112	102.61	103.30	11.61	2.15	1.95	1.98	10.14	10.04	10.10	97
長期 (7-11)	50	98.10	98.39	8.84	1.43	1.73	1.72	8.26	8.18	8.25	97
超長期 (11-)	62	106.30	107.32	13.88	2.73	2.12	2.18	11.55	11.43	11.49	97
BBB 格	1,153	98.88	99.20	4.71	1.18	1.43	1.42	4.40	4.36	4.39	92
短期 (1-3)	432	99.64	99.88	2.21	0.95	1.13	1.13	2.18	2.17	2.18	77
中期 (3-7)	540	98.86	99.16	4.35	1.11	1.40	1.39	4.24	4.21	4.24	94
長期 (7-)	182	97.13	97.69	11.74	1.94	2.24	2.21	10.26	10.15	10.22	120
長期 (7-11)	88	99.28	99.73	8.78	1.80	1.92	1.91	8.11	8.04	8.11	117
超長期 (11-)	93	95.10	95.75	14.54	2.07	2.56	2.50	12.39	12.24	12.32	124
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	240	98.49	98.85	2.61	1.30	1.78	1.77	2.54	2.52	2.54	141
短期 (1-3)	193	98.98	99.34	2.08	1.34	1.75	1.75	2.04	2.03	2.04	141
中期 (3-7)	39	96.99	97.40	4.30	1.11	1.87	1.85	4.18	4.15	4.18	139
長期 (7-)	8	93.94	94.05	7.41	1.15	2.10	2.04	7.10	7.03	7.10	143
長期 (7-11)	8	93.94	94.05	7.41	1.15	2.10	2.04	7.10	7.03	7.10	143
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9月末、10月ポートフォリオ)

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
<hr/>											
AAA~AA 格	1,164	99.55	99.77	3.28	0.81	0.96	0.96	3.22	3.20	3.22	55
短期 (1-3)	607	99.53	99.74	2.17	0.67	0.89	0.88	2.15	2.14	2.15	53
中期 (3-7)	512	99.54	99.78	4.13	0.93	1.02	1.02	4.04	4.02	4.04	57
長期 (7-)	45	99.93	100.21	8.65	1.24	1.27	1.27	8.20	8.15	8.20	53
長期 (7-11)	45	99.93	100.21	8.65	1.24	1.27	1.27	8.20	8.15	8.20	53
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AAA~A 格	2,065	99.78	100.06	3.51	0.97	1.08	1.08	3.39	3.37	3.39	65
短期 (1-3)	1,160	99.73	99.98	2.17	0.85	0.97	0.97	2.15	2.14	2.15	62
中期 (3-7)	748	99.42	99.68	4.06	0.96	1.10	1.09	3.98	3.96	3.98	65
長期 (7-)	157	101.85	102.43	10.77	1.89	1.76	1.78	9.60	9.51	9.57	85
長期 (7-11)	95	98.96	99.24	8.75	1.34	1.51	1.50	8.23	8.17	8.23	76
超長期 (11-)	62	106.30	107.32	13.88	2.73	2.12	2.18	11.55	11.43	11.49	97
AAA~BBB 格	3,370	99.47	99.76	3.96	1.07	1.22	1.22	3.77	3.74	3.76	76
短期 (1-3)	1,689	99.72	99.96	2.22	0.91	1.04	1.04	2.20	2.19	2.20	69
中期 (3-7)	1,330	99.20	99.48	4.22	1.05	1.24	1.24	4.12	4.09	4.12	79
長期 (7-)	351	99.32	99.87	11.37	1.94	2.03	2.03	9.99	9.89	9.96	105
長期 (7-11)	192	99.14	99.50	8.82	1.60	1.73	1.73	8.21	8.14	8.20	98
超長期 (11-)	160	99.53	100.32	14.44	2.35	2.39	2.38	12.12	11.98	12.05	113
AAA~BB 格	3,370	99.47	99.76	3.96	1.07	1.22	1.22	3.77	3.74	3.76	76
短期 (1-3)	1,689	99.72	99.96	2.22	0.91	1.04	1.04	2.20	2.19	2.20	69
中期 (3-7)	1,330	99.20	99.48	4.22	1.05	1.24	1.24	4.12	4.09	4.12	79
長期 (7-)	351	99.32	99.87	11.37	1.94	2.03	2.03	9.99	9.89	9.96	105
長期 (7-11)	192	99.14	99.50	8.82	1.60	1.73	1.73	8.21	8.14	8.20	98
超長期 (11-)	160	99.53	100.32	14.44	2.35	2.39	2.38	12.12	11.98	12.05	113
AAA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA 格	1,164	99.55	99.77	3.28	0.81	0.96	0.96	3.22	3.20	3.22	55
短期 (1-3)	607	99.53	99.74	2.17	0.67	0.89	0.88	2.15	2.14	2.15	53
中期 (3-7)	512	99.54	99.78	4.13	0.93	1.02	1.02	4.04	4.02	4.04	57
長期 (7-)	45	99.93	100.21	8.65	1.24	1.27	1.27	8.20	8.15	8.20	53
長期 (7-11)	45	99.93	100.21	8.65	1.24	1.27	1.27	8.20	8.15	8.20	53
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
A 格	901	100.07	100.42	3.80	1.19	1.23	1.23	3.61	3.58	3.60	77
短期 (1-3)	553	99.95	100.25	2.18	1.06	1.07	1.07	2.15	2.14	2.15	72
中期 (3-7)	236	99.15	99.45	3.91	1.04	1.25	1.25	3.83	3.81	3.83	81
長期 (7-)	112	102.61	103.30	11.61	2.15	1.95	1.98	10.14	10.04	10.10	97
長期 (7-11)	50	98.10	98.39	8.84	1.43	1.73	1.72	8.26	8.18	8.25	97
超長期 (11-)	62	106.30	107.32	13.88	2.73	2.12	2.18	11.55	11.43	11.49	97
BBB 格	1,306	98.99	99.29	4.68	1.23	1.45	1.45	4.37	4.34	4.37	95
短期 (1-3)	529	99.69	99.91	2.33	1.04	1.19	1.19	2.30	2.29	2.30	83
中期 (3-7)	582	98.93	99.22	4.42	1.15	1.43	1.42	4.30	4.27	4.30	96
長期 (7-)	194	97.28	97.81	11.85	1.98	2.26	2.23	10.32	10.20	10.28	122
長期 (7-11)	97	99.32	99.75	8.88	1.84	1.95	1.95	8.18	8.10	8.17	119
超長期 (11-)	98	95.26	95.90	14.79	2.11	2.59	2.53	12.52	12.37	12.44	125
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	225	98.42	98.78	2.71	1.32	1.81	1.80	2.64	2.62	2.64	142
短期 (1-3)	178	98.93	99.29	2.16	1.38	1.78	1.78	2.13	2.11	2.13	143
中期 (3-7)	39	96.99	97.40	4.30	1.11	1.87	1.85	4.18	4.15	4.18	139
長期 (7-)	8	93.94	94.05	7.41	1.15	2.10	2.04	7.10	7.03	7.10	143
長期 (7-11)	8	93.94	94.05	7.41	1.15	2.10	2.04	7.10	7.03	7.10	143
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

出所:NFRC

- 格付は、Moody's の格付をもとに NFRC で分類

## 円建外債 S&amp;P 格付別・ポートフォリオ指標 (2024年9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	289	99.45	99.60	3.14	0.74	0.92	0.91	3.09	3.07	3.09	52
短期 (1-3)	177	99.72	99.88	2.19	0.73	0.86	0.86	2.17	2.17	2.17	51
中期 (3-7)	98	99.12	99.24	4.16	0.74	0.98	0.98	4.10	4.08	4.10	53
長期 (7-)	14	98.45	98.53	8.12	0.94	1.20	1.18	7.83	7.79	7.83	50
長期 (7-11)	14	98.45	98.53	8.12	0.94	1.20	1.18	7.83	7.79	7.83	50
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AAA～A 格	2,112	99.79	100.06	3.35	0.95	1.05	1.05	3.24	3.22	3.24	64
短期 (1-3)	1,176	99.78	100.03	2.04	0.84	0.95	0.95	2.02	2.01	2.02	61
中期 (3-7)	787	99.46	99.71	3.93	0.94	1.08	1.08	3.85	3.83	3.85	64
長期 (7-)	150	101.62	102.21	10.60	1.78	1.69	1.71	9.50	9.41	9.47	79
長期 (7-11)	88	98.36	98.65	8.32	1.11	1.37	1.36	7.94	7.88	7.93	65
超長期 (11-)	62	106.30	107.32	13.88	2.73	2.12	2.18	11.55	11.43	11.49	97
AAA～BBB 格	3,501	99.41	99.70	3.79	1.04	1.22	1.21	3.61	3.58	3.61	77
短期 (1-3)	1,778	99.67	99.92	2.08	0.90	1.05	1.05	2.06	2.05	2.06	71
中期 (3-7)	1,368	99.15	99.44	4.11	1.01	1.23	1.22	4.02	3.99	4.02	78
長期 (7-)	355	99.07	99.62	11.09	1.86	2.00	1.99	9.81	9.71	9.78	103
長期 (7-11)	200	98.70	99.05	8.63	1.50	1.70	1.69	8.08	8.01	8.07	96
超長期 (11-)	155	99.56	100.36	14.27	2.34	2.37	2.36	12.03	11.89	11.96	113
AAA～BB 格	3,501	99.41	99.70	3.79	1.04	1.22	1.21	3.61	3.58	3.61	77
短期 (1-3)	1,778	99.67	99.92	2.08	0.90	1.05	1.05	2.06	2.05	2.06	71
中期 (3-7)	1,368	99.15	99.44	4.11	1.01	1.23	1.22	4.02	3.99	4.02	78
長期 (7-)	355	99.07	99.62	11.09	1.86	2.00	1.99	9.81	9.71	9.78	103
長期 (7-11)	200	98.70	99.05	8.63	1.50	1.70	1.69	8.08	8.01	8.07	96
超長期 (11-)	155	99.56	100.36	14.27	2.34	2.37	2.36	12.03	11.89	11.96	113
AAA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA 格	289	99.45	99.60	3.14	0.74	0.92	0.91	3.09	3.07	3.09	52
短期 (1-3)	177	99.72	99.88	2.19	0.73	0.86	0.86	2.17	2.17	2.17	51
中期 (3-7)	98	99.12	99.24	4.16	0.74	0.98	0.98	4.10	4.08	4.10	53
長期 (7-)	14	98.45	98.53	8.12	0.94	1.20	1.18	7.83	7.79	7.83	50
長期 (7-11)	14	98.45	98.53	8.12	0.94	1.20	1.18	7.83	7.79	7.83	50
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
A 格	1,824	99.85	100.14	3.38	0.98	1.07	1.08	3.26	3.24	3.26	65
短期 (1-3)	998	99.80	100.05	2.01	0.86	0.97	0.97	1.99	1.98	1.99	63
中期 (3-7)	689	99.50	99.77	3.89	0.97	1.10	1.09	3.82	3.80	3.82	66
長期 (7-)	136	101.94	102.58	10.85	1.86	1.74	1.76	9.66	9.57	9.63	82
長期 (7-11)	75	98.34	98.67	8.36	1.14	1.40	1.39	7.96	7.90	7.95	68
超長期 (11-)	62	106.30	107.32	13.88	2.73	2.12	2.18	11.55	11.43	11.49	97
BBB 格	1,389	98.82	99.15	4.46	1.19	1.47	1.46	4.18	4.14	4.17	98
短期 (1-3)	602	99.44	99.71	2.17	1.01	1.26	1.25	2.15	2.13	2.15	90
中期 (3-7)	582	98.75	99.07	4.36	1.11	1.43	1.42	4.24	4.21	4.24	97
長期 (7-)	205	97.21	97.72	11.45	1.93	2.23	2.20	10.06	9.94	10.02	122
長期 (7-11)	112	98.97	99.37	8.88	1.80	1.97	1.96	8.19	8.11	8.18	120
超長期 (11-)	93	95.10	95.75	14.54	2.07	2.56	2.50	12.39	12.24	12.32	124
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	99.21	99.64	2.14	1.41	1.71	1.70	2.09	2.07	2.09	137
短期 (1-3)	61	99.64	100.08	1.60	1.53	1.77	1.76	1.58	1.56	1.58	146
中期 (3-7)	13	98.12	98.53	3.81	0.97	1.45	1.44	3.74	3.71	3.74	101
長期 (7-)	2	93.79	93.87	7.35	0.51	1.45	1.41	7.21	7.16	7.21	80
長期 (7-11)	2	93.79	93.87	7.35	0.51	1.45	1.41	7.21	7.16	7.21	80
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

出所:NFRC

- 格付は、S&P の格付をもとに NFRC で分類

## 円建外債 S&amp;P 格付別・ポートフォリオ指標(2024年9月末、10月ポートフォリオ)

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
<hr/>											
AAA~AA格	279	99.44	99.58	3.21	0.75	0.92	0.92	3.16	3.15	3.16	51
短期(1-3)	168	99.71	99.86	2.26	0.73	0.86	0.86	2.24	2.23	2.24	50
中期(3-7)	98	99.12	99.24	4.16	0.74	0.98	0.98	4.10	4.08	4.10	53
長期(7-)	14	98.45	98.53	8.12	0.94	1.20	1.18	7.83	7.79	7.83	50
長期(7-11)	14	98.45	98.53	8.12	0.94	1.20	1.18	7.83	7.79	7.83	50
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
<hr/>											
AAA~A格	2,006	99.79	100.06	3.47	0.96	1.07	1.07	3.36	3.34	3.36	64
短期(1-3)	1,127	99.73	99.98	2.18	0.85	0.97	0.97	2.16	2.15	2.16	62
中期(3-7)	740	99.43	99.68	4.05	0.96	1.09	1.09	3.96	3.94	3.96	65
長期(7-)	139	102.22	102.84	10.90	1.89	1.72	1.74	9.69	9.61	9.66	80
長期(7-11)	77	98.95	99.25	8.51	1.21	1.38	1.37	8.08	8.03	8.08	65
超長期(11-)	62	106.30	107.32	13.88	2.73	2.12	2.18	11.55	11.43	11.49	97
<hr/>											
AAA~BBB格	3,532	99.41	99.70	3.91	1.08	1.25	1.25	3.72	3.70	3.72	79
短期(1-3)	1,812	99.65	99.89	2.23	0.94	1.09	1.09	2.20	2.19	2.20	73
中期(3-7)	1,364	99.15	99.43	4.22	1.05	1.26	1.25	4.12	4.09	4.12	80
長期(7-)	357	99.23	99.78	11.31	1.93	2.04	2.03	9.95	9.85	9.91	106
長期(7-11)	197	98.99	99.35	8.78	1.59	1.75	1.74	8.18	8.10	8.17	100
超長期(11-)	160	99.53	100.32	14.44	2.35	2.39	2.38	12.12	11.98	12.05	113
<hr/>											
AAA~BB格	3,532	99.41	99.70	3.91	1.08	1.25	1.25	3.72	3.70	3.72	79
短期(1-3)	1,812	99.65	99.89	2.23	0.94	1.09	1.09	2.20	2.19	2.20	73
中期(3-7)	1,364	99.15	99.43	4.22	1.05	1.26	1.25	4.12	4.09	4.12	80
長期(7-)	357	99.23	99.78	11.31	1.93	2.04	2.03	9.95	9.85	9.91	106
長期(7-11)	197	98.99	99.35	8.78	1.59	1.75	1.74	8.18	8.10	8.17	100
超長期(11-)	160	99.53	100.32	14.44	2.35	2.39	2.38	12.12	11.98	12.05	113
<hr/>											
AAA格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
<hr/>											
AA格	279	99.44	99.58	3.21	0.75	0.92	0.92	3.16	3.15	3.16	51
短期(1-3)	168	99.71	99.86	2.26	0.73	0.86	0.86	2.24	2.23	2.24	50
中期(3-7)	98	99.12	99.24	4.16	0.74	0.98	0.98	4.10	4.08	4.10	53
長期(7-)	14	98.45	98.53	8.12	0.94	1.20	1.18	7.83	7.79	7.83	50
長期(7-11)	14	98.45	98.53	8.12	0.94	1.20	1.18	7.83	7.79	7.83	50
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
<hr/>											
A格	1,727	99.85	100.14	3.51	1.00	1.09	1.09	3.39	3.37	3.39	66
短期(1-3)	960	99.74	100.00	2.17	0.87	0.99	0.99	2.15	2.14	2.15	64
中期(3-7)	642	99.47	99.74	4.03	0.99	1.11	1.11	3.94	3.92	3.94	66
長期(7-)	125	102.63	103.32	11.20	1.99	1.77	1.80	9.89	9.80	9.85	83
長期(7-11)	63	99.05	99.41	8.59	1.27	1.41	1.41	8.13	8.08	8.13	68
超長期(11-)	62	106.30	107.32	13.88	2.73	2.12	2.18	11.55	11.43	11.49	97
<hr/>											
BBB格	1,526	98.91	99.22	4.49	1.23	1.49	1.48	4.21	4.17	4.20	99
短期(1-3)	685	99.50	99.75	2.30	1.07	1.28	1.28	2.27	2.26	2.27	92
中期(3-7)	624	98.82	99.13	4.43	1.16	1.46	1.45	4.31	4.27	4.31	99
長期(7-)	218	97.34	97.83	11.57	1.96	2.25	2.22	10.12	10.01	10.08	123
長期(7-11)	120	99.02	99.41	8.95	1.83	1.99	1.98	8.24	8.15	8.23	122
超長期(11-)	98	95.26	95.90	14.79	2.11	2.59	2.53	12.52	12.37	12.44	125
<hr/>											
BB格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
<hr/>											
B格以下	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
<hr/>											
格付なし	64	99.11	99.54	2.33	1.48	1.80	1.79	2.28	2.26	2.28	144
短期(1-3)	56	99.56	100.02	1.88	1.62	1.87	1.86	1.85	1.83	1.85	153
中期(3-7)	6	96.97	97.18	4.64	0.58	1.27	1.25	4.57	4.54	4.57	79
長期(7-)	2	93.79	93.87	7.35	0.51	1.45	1.41	7.21	7.16	7.21	80
長期(7-11)	2	93.79	93.87	7.35	0.51	1.45	1.41	7.21	7.16	7.21	80
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9月末
銘柄数	14,003	14,825	15,436	15,639	16,113	16,207
額面(10億円)	972,326	1,018,210	1,056,757	1,085,263	1,124,834	1,138,196
時価単価(円)	108.39	106.48	104.19	101.51	98.40	96.80
利含単価(円)	108.52	106.59	104.30	101.61	98.50	96.92
残存年数(年)	9.84	9.89	10.01	10.16	10.21	10.24
利率(%)	0.89	0.83	0.79	0.77	0.78	0.81
単利(%)	0.08	0.14	0.27	0.43	0.73	0.92
複利(%)	0.08	0.14	0.27	0.43	0.72	0.89
Dur(年)	9.47	9.36	9.31	9.18	8.93	8.78
M-Dur	9.46	9.34	9.29	9.15	8.88	8.72
E-Dur	9.45	9.33	9.29	9.15	8.89	8.74
Tspd(bp)	5	4	3	6	4	4

出所:NFRG

## 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 8 月の月末営業日から 2024 年 9 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 9 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 9 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 8 月の月末営業日から 2024 年 9 月の月末営業日までの投資収益率(年率換算,%)
- 2024 年 8 月の月末営業日において、9 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 9 月ポートフォリオの、右ページには 10 月ポートフォリオの、2024 年 9 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 9 月末(暦上)における残存年数(至最終償還日)で区分。ただし 10 月ポートフォリオでは、2024 年 10 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](mailto:bpi@nfrco.jp)