

月間投資収益率 (2024年12月末)

累積投資 収益指数	前月末からの投資収益率			過去からの期間投資収益率	
	トータル	キャピタル	インカム	前年度末	前年末
総合 357.857	-1.24	-2.10	0.86	-3.20	-2.91

出所: 野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング(NFRC)

(注) 投資収益率は年率換算(%)

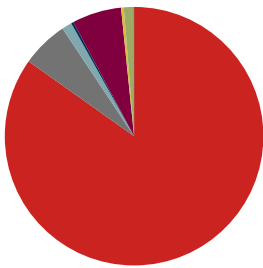
ポートフォリオ指標 (2024年12月末)

	翌月ポート (2025年1月)	当月ポート (2024年12月)	差
額面[兆円]	1153.43	1144.23	9.21
デュレーション[年]	8.74	8.70	0.03
修正デュレーション	8.67	8.64	0.03
時価単価[円]	95.33	95.32	0.01
利含単価[円]	95.49	95.47	0.02
残存年数[年]	10.30	10.25	0.04
利率[%]	0.83	0.83	0.00
単利[%]	1.14	1.14	0.00
複利[%]	1.11	1.10	0.00
Tスプレッド[bp]	5	5	0

出所: NFRC

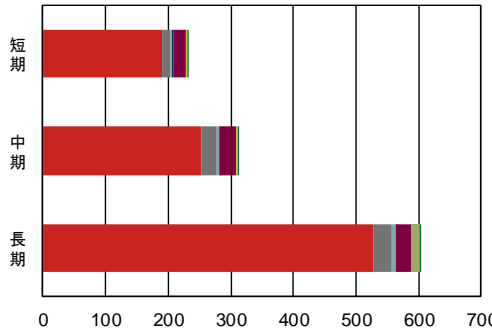
(注) デュレーション・修正デュレーションは経過利子込時価総額加重平均、単利・複利・Tスプレッドは時価総額加重平均、それ以外は額面加重平均。

銘柄別額面構成 (2024年12月末)



出所: NFRC

残存別額面構成 (2024年12月末)



出所: NFRC

(兆円)

	国債	地方債	政保債	金融債	事業債	円建外債	MBS	ABS
構成比	84.8%	5.8%	1.3%	0.3%	6.2%	0.3%	1.2%	0.1%
全体	970.60	66.80	14.37	3.38	70.59	3.95	13.88	0.66
短期	189.83	12.88	3.44	1.97	20.59	2.17	-	0.18
中期	252.46	24.73	4.16	1.25	26.95	1.41	-	0.31
長期	528.31	29.19	6.78	0.16	23.05	0.36	13.88	0.17

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12月末)

	累積投資 収益指数	前月末からの投資収益率			過去からの投資収益率	
		トータル	キャピタル	インカム	前年度末	前年末
総合	357.857	-1.24	-2.10	0.86	-3.20	-2.91
国債	367.797	-1.29	-2.17	0.88	-3.40	-3.11
地方債	385.259	-1.56	-2.20	0.64	-2.14	-1.88
政保債	359.987	-0.96	-1.75	0.78	-2.80	-2.38
金融債	272.169	1.06	0.72	0.34	-0.61	-0.70
事業債	381.467	-0.21	-1.01	0.80	-1.95	-1.51
円建外債	392.723	-0.14	-1.24	1.09	0.39	0.62
MBS	122.702	-2.74	-3.42	0.68	-2.78	-2.49
ABS	112.965	-0.33	-1.11	0.77	-1.05	-1.05

出所:NFRC

投資収益率は年率換算(%)

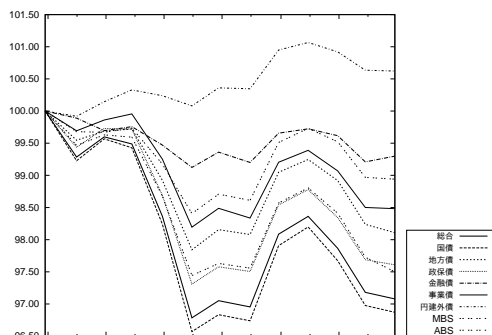
銘柄別・累積投資収益指数の推移

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
2023/12/29	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
2024/09/30	362.589	372.840	389.729	364.301	273.331	384.980	394.456	124.344	113.867
2024/10/31	360.756	370.841	388.443	362.695	273.039	383.739	393.887	123.849	113.629
2024/11/29	358.235	368.199	385.771	360.281	271.924	381.536	392.771	122.988	112.997
2024/12/02	357.646	367.578	385.185	359.712	271.740	381.068	392.387	122.781	112.860
2024/12/03	357.684	367.615	385.246	359.754	271.798	381.139	392.476	122.745	112.884
2024/12/04	358.263	368.223	385.838	360.285	272.019	381.637	392.823	122.937	113.034
2024/12/05	357.894	367.831	385.487	359.949	271.936	381.347	392.729	122.825	112.952
2024/12/06	358.347	368.320	385.849	360.369	272.020	381.677	392.986	122.955	113.035
2024/12/09	358.767	368.766	386.233	360.775	272.178	382.033	393.226	123.073	113.132
2024/12/10	358.347	368.318	385.837	360.360	272.068	381.722	393.069	122.933	113.042
2024/12/11	358.291	368.272	385.684	360.271	272.017	381.622	393.045	122.872	112.999
2024/12/12	358.752	368.765	386.081	360.719	272.147	381.990	392.998	123.011	113.094
2024/12/13	358.994	369.012	386.379	361.000	272.304	382.262	393.163	123.069	113.186
2024/12/16	358.223	368.177	385.768	360.301	272.153	381.715	392.944	122.852	113.056
2024/12/17	357.868	367.795	385.466	359.976	272.088	381.453	392.800	122.753	112.987
2024/12/18	358.336	368.301	385.825	360.374	272.190	381.818	392.996	122.877	113.069
2024/12/19	357.997	367.949	385.414	360.060	272.034	381.500	393.223	122.751	112.963
2024/12/20	358.759	368.750	386.186	360.800	272.330	382.176	393.326	123.000	113.162
2024/12/23	358.415	368.383	385.887	360.477	272.263	381.890	393.164	122.897	113.100
2024/12/24	358.499	368.487	385.833	360.555	272.248	381.920	392.899	122.893	113.082
2024/12/25	358.656	368.661	385.933	360.675	272.261	382.015	392.949	122.913	113.106
2024/12/26	358.153	368.138	385.347	360.173	272.094	381.568	392.643	122.739	112.965
2024/12/27	357.611	367.541	385.012	359.711	272.093	381.227	392.547	122.619	112.899
2024/12/30	357.857	367.797	385.259	359.987	272.169	381.467	392.723	122.702	112.965

出所:NFRC

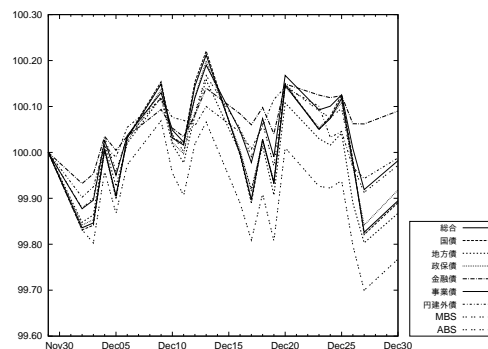
1983年12月末=100。MBSセクターは2003年3月末=100。ABSセクターは2008年3月末=100

指数の推移(月次) 2023年12月末=100に補正。



出所:NFRC

指数の推移(日次) 2024年11月末=100に補正。



出所:NFRC

総合 残存別・投資収益率(2024年12月末)

	累積投資 収益指数	前月末からの投資収益率			過去からの投資収益率	
		トータル	キャピタル	インカム	前年度末	前年末
総合	357.857	-1.24	-2.10	0.86	-3.20	-2.91
短期 (1-3)	233.830	1.07	0.66	0.41	-0.46	-0.53
中期 (3-7)	334.002	-0.61	-1.28	0.67	-1.48	-1.53
長期 (7-)	522.157	-2.56	-3.71	1.15	-5.25	-4.60
長期 (7-11)	191.375	-3.81	-4.84	1.03	-2.25	-2.04
超長期 (11-)	229.743	-1.79	-3.02	1.23	-7.01	-6.10
(11-15)	221.468	-3.42	-4.40	0.98	-3.84	-3.18
(15-)	234.579	-1.22	-2.54	1.31	-8.15	-7.14

出所:NFRC

投資収益率は年率換算(%)

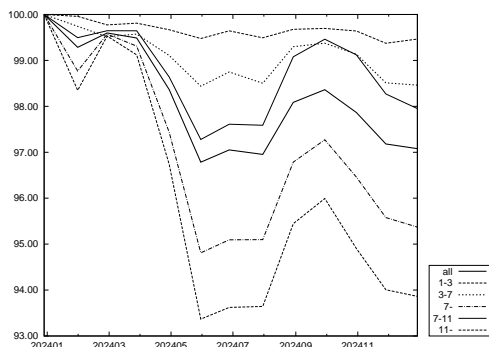
総合 残存別・投資収益指数の推移

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-)*
2023/12/29	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
2024/09/30	362.589	234.378	337.099	532.566	194.325	234.958	225.316	240.358
2024/10/31	360.756	234.244	336.293	528.115	193.659	232.291	224.162	237.094
2024/11/29	358.235	233.617	334.175	523.293	191.996	230.093	222.113	234.823
2024/12/02	357.646	233.517	333.800	522.017	191.592	229.485	221.437	234.236
2024/12/03	357.684	233.564	333.881	522.011	191.615	229.465	221.446	234.204
2024/12/04	358.263	233.684	334.340	523.167	192.010	229.994	221.932	234.753
2024/12/05	357.894	233.660	334.085	522.348	191.783	229.581	221.583	234.313
2024/12/06	358.347	233.706	334.256	523.465	192.005	230.208	222.062	235.000
2024/12/09	358.767	233.788	334.497	524.389	192.248	230.685	222.436	235.518
2024/12/10	358.347	233.725	334.299	523.408	191.951	230.207	221.954	235.039
2024/12/11	358.291	233.704	334.151	523.397	191.836	230.284	221.878	235.172
2024/12/12	358.752	233.768	334.378	524.467	192.099	230.848	222.351	235.775
2024/12/13	358.994	233.860	334.676	524.821	192.259	230.981	222.600	235.866
2024/12/16	358.223	233.784	334.336	522.965	191.889	229.939	221.907	234.687
2024/12/17	357.868	233.760	334.150	522.123	191.682	229.495	221.576	234.199
2024/12/18	358.336	233.816	334.359	523.241	191.938	230.099	221.944	234.893
2024/12/19	357.997	233.740	334.027	522.623	191.630	229.886	221.589	234.731
2024/12/20	358.759	233.897	334.609	524.165	192.113	230.624	222.265	235.498
2024/12/23	358.415	233.874	334.426	523.354	191.935	230.180	221.935	235.009
2024/12/24	358.499	233.877	334.357	523.656	191.802	230.491	222.011	235.408
2024/12/25	358.656	233.880	334.416	524.052	191.853	230.734	222.167	235.685
2024/12/26	358.153	233.826	334.046	522.975	191.402	230.301	221.675	235.270
2024/12/27	357.611	233.808	333.861	521.591	191.256	229.429	221.179	234.254
2024/12/30	357.857	233.830	334.002	522.157	191.375	229.743	221.468	234.579

出所:NFRC

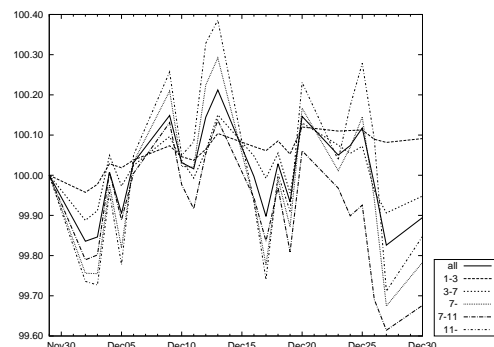
* は 1995 年 12 月末=100。それ以外は、1983 年 12 月末=100。

指数の推移(月次) 2023年12月末=100に補正。



出所:NFRC

指数の推移(日次) 2024年11月末=100に補正。



出所:NFRC

国債 残存別・投資収益率(2024年12月末)

	累積投資 収益指数	前月末からの投資収益率			過去からの投資収益率	
		トータル	キャピタル	インカム	前年度末	前年末
国債	367.797	-1.29	-2.17	0.88	-3.40	-3.11
短期(1-3)	220.414	1.01	0.60	0.41	-0.51	-0.58
中期(3-7)	332.423	-0.72	-1.39	0.68	-1.54	-1.61
長期(7-)	531.474	-2.48	-3.66	1.18	-5.44	-4.82
長期(7-11)	189.686	-3.85	-4.89	1.03	-2.29	-2.12
超長期(11-)	228.178	-1.66	-2.92	1.26	-7.29	-6.39
(11-15)	219.278	-3.46	-4.45	0.99	-3.90	-3.28
(15-)	233.391	-1.03	-2.39	1.36	-8.50	-7.50

出所:NFRC

投資収益率は年率換算(%)

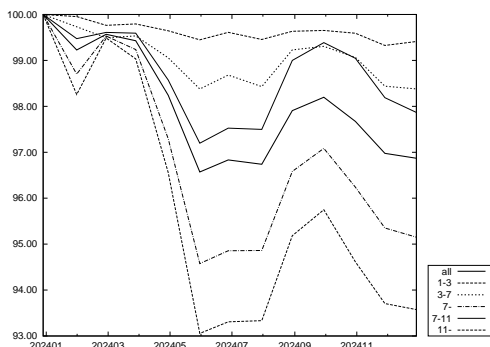
国債 残存別・投資収益指数の推移

国債 年/月/日	全体	短期 (1-3)	中期 (3-7)	長期 (7-)	長期*	超長期*		
					(7-11)	(11-)	(11-15)*	(15-)*
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
2024/09/30	372.840	220.946	335.557	542.274	192.631	233.479	223.103	239.305
2024/10/31	370.841	220.814	334.742	537.559	191.969	230.711	221.962	235.892
2024/11/29	368.199	220.225	332.626	532.596	190.309	228.499	219.924	233.596
2024/12/02	367.578	220.131	332.249	531.283	189.906	227.887	219.248	233.002
2024/12/03	367.615	220.175	332.329	531.277	189.928	227.867	219.256	232.972
2024/12/04	368.223	220.288	332.789	532.467	190.320	228.402	219.740	233.530
2024/12/05	367.831	220.265	332.532	531.618	190.094	227.982	219.393	233.080
2024/12/06	368.320	220.307	332.701	532.790	190.316	228.627	219.870	233.792
2024/12/09	368.766	220.383	332.940	533.750	190.557	229.113	220.240	234.324
2024/12/10	368.318	220.323	332.740	532.735	190.260	228.630	219.760	233.836
2024/12/11	368.272	220.304	332.593	532.750	190.146	228.722	219.688	233.990
2024/12/12	368.765	220.365	332.821	533.864	190.408	229.299	220.159	234.610
2024/12/13	369.012	220.450	333.117	534.219	190.566	229.428	220.405	234.698
2024/12/16	368.177	220.378	332.773	532.269	190.198	228.354	219.713	233.474
2024/12/17	367.795	220.355	332.586	531.389	189.992	227.898	219.384	232.968
2024/12/18	368.301	220.405	332.793	532.567	190.247	228.523	219.753	233.692
2024/12/19	367.949	220.332	332.456	531.944	189.941	228.317	219.399	233.538
2024/12/20	368.750	220.480	333.039	533.533	190.420	229.062	220.069	234.318
2024/12/23	368.383	220.458	332.854	532.693	190.243	228.613	219.741	233.820
2024/12/24	368.487	220.461	332.784	533.036	190.111	228.944	219.819	234.247
2024/12/25	368.661	220.465	332.846	533.462	190.163	229.200	219.976	234.540
2024/12/26	368.138	220.416	332.479	532.370	189.717	228.771	219.493	234.129
2024/12/27	367.541	220.398	332.291	530.892	189.570	227.862	218.994	233.061
2024/12/30	367.797	220.414	332.423	531.474	189.686	228.178	219.278	233.391

出所:NFRC

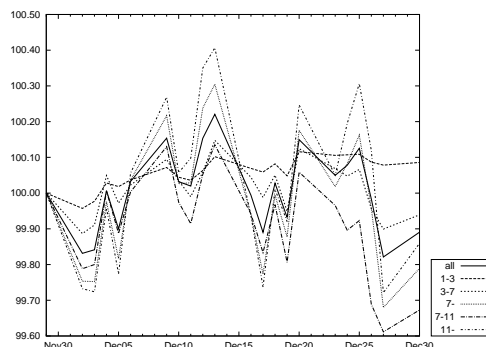
* は1995年12月末=100。それ以外は、1983年12月末=100。

指数の推移(月次) 2023年12月末=100に補正。



出所:NFRC

指数の推移(日次) 2024年11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12月末)

	累積投資 収益指数	前月末からの投資収益率			過去からの投資収益率	
		トータル	キャピタル	インカム	前年度末	前年末
除くMBS	357.743	-1.22	-2.08	0.86	-3.21	-2.91
短期(1-3)	233.830	1.07	0.66	0.41	-0.46	-0.53
中期(3-7)	334.002	-0.61	-1.28	0.67	-1.48	-1.53
長期(7-)	523.947	-2.55	-3.71	1.16	-5.31	-4.66
長期(7-11)	191.368	-3.82	-4.85	1.03	-2.25	-2.04
超長期(11-)	231.372	-1.75	-3.00	1.25	-7.18	-6.24
(11-15)	221.457	-3.42	-4.40	0.98	-3.84	-3.18
(15-)	236.408	-1.14	-2.49	1.35	-8.43	-7.39

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(%)

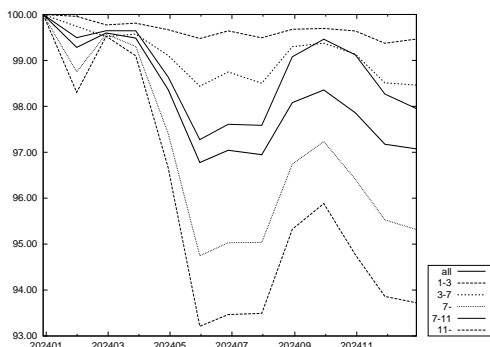
「除くMBS」残存別・投資収益指数の推移

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-)*
2023/12/29	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
2024/09/30	362.473	234.378	337.099	534.475	194.321	236.708	225.304	242.375
2024/10/31	360.636	234.244	336.293	529.951	193.655	233.953	224.151	238.959
2024/11/29	358.115	233.617	334.175	525.085	191.991	231.717	222.102	236.637
2024/12/02	357.527	233.517	333.800	523.795	191.587	231.096	221.426	236.036
2024/12/03	357.567	233.564	333.881	523.793	191.609	231.078	221.435	236.005
2024/12/04	358.145	233.684	334.340	524.960	192.005	231.617	221.921	236.568
2024/12/05	357.776	233.660	334.085	524.131	191.777	231.193	221.572	236.113
2024/12/06	358.230	233.706	334.256	525.266	192.000	231.840	222.051	236.829
2024/12/09	358.651	233.788	334.497	526.203	192.242	232.330	222.425	237.367
2024/12/10	358.231	233.725	334.299	525.209	191.946	231.841	221.943	236.872
2024/12/11	358.177	233.704	334.151	525.204	191.830	231.925	221.867	237.020
2024/12/12	358.638	233.768	334.378	526.290	192.093	232.506	222.340	237.645
2024/12/13	358.881	233.860	334.676	526.647	192.254	232.641	222.589	237.736
2024/12/16	358.109	233.784	334.336	524.762	191.884	231.566	221.896	236.507
2024/12/17	357.752	233.760	334.150	523.907	191.676	231.109	221.565	235.999
2024/12/18	358.222	233.816	334.359	525.043	191.932	231.731	221.933	236.723
2024/12/19	357.883	233.740	334.027	524.421	191.624	231.518	221.578	236.565
2024/12/20	358.645	233.897	334.609	525.980	192.108	232.272	222.254	237.353
2024/12/23	358.300	233.874	334.426	525.157	191.929	231.816	221.925	236.844
2024/12/24	358.386	233.877	334.357	525.468	191.797	232.140	222.000	237.268
2024/12/25	358.544	233.880	334.416	525.874	191.847	232.394	222.156	237.561
2024/12/26	358.041	233.826	334.046	524.784	191.396	231.953	221.664	237.138
2024/12/27	357.497	233.808	333.861	523.374	191.249	231.050	221.168	236.071
2024/12/30	357.743	233.830	334.002	523.947	191.368	231.372	221.457	236.408

出所:NFRC

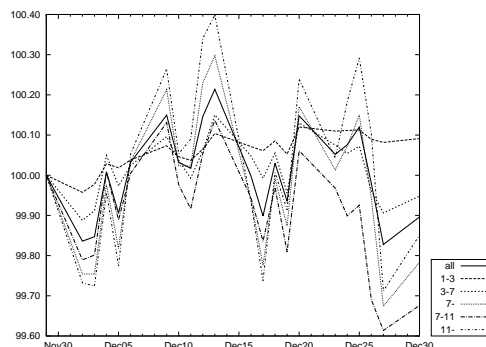
* は1995年12月末=100。それ以外は、1983年12月末=100。

指数の推移(月次) 2023年12月末=100に補正。



出所:NFRC

指数の推移(日次) 2024年11月末=100に補正。



出所:NFRC

「除く ABS」 残存別・投資収益率 (2024 年 12 月末)

	累積投資 収益指数	前月末からの投資収益率			過去からの投資収益率	
		トータル	キャピタル	インカム	前年度末	前年末
除く ABS	357.881	-1.24	-2.10	0.86	-3.20	-2.91
短期 (1-3)	233.790	1.07	0.66	0.41	-0.46	-0.53
中期 (3-7)	333.997	-0.61	-1.28	0.67	-1.48	-1.53
長期 (7-)	522.154	-2.56	-3.71	1.15	-5.25	-4.60
長期 (7-11)	191.368	-3.81	-4.84	1.03	-2.25	-2.04
超長期 (11-)	229.740	-1.79	-3.02	1.23	-7.01	-6.10
(11-15)	221.459	-3.42	-4.40	0.98	-3.84	-3.18
(15-)	234.580	-1.22	-2.54	1.31	-8.15	-7.14

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 (%)

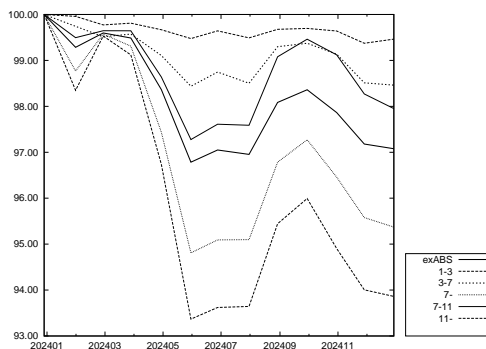
「除く ABS」 残存別 投資収益指数の推移

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-)*
2023/12/29	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
2024/09/30	362.614	234.337	337.095	532.564	194.318	234.955	225.307	240.360
2024/10/31	360.780	234.203	336.289	528.112	193.653	232.288	224.153	237.096
2024/11/29	358.258	233.576	334.170	523.290	191.990	230.090	222.105	234.825
2024/12/02	357.670	233.477	333.795	522.014	191.586	229.482	221.428	234.238
2024/12/03	357.708	233.524	333.876	522.009	191.609	229.462	221.437	234.206
2024/12/04	358.286	233.643	334.336	523.164	192.004	229.991	221.923	234.755
2024/12/05	357.917	233.620	334.080	522.345	191.776	229.578	221.575	234.315
2024/12/06	358.371	233.665	334.251	523.462	191.999	230.205	222.053	235.002
2024/12/09	358.791	233.748	334.492	524.386	192.241	230.682	222.427	235.520
2024/12/10	358.371	233.684	334.295	523.406	191.945	230.204	221.945	235.041
2024/12/11	358.315	233.663	334.146	523.395	191.829	230.281	221.869	235.173
2024/12/12	358.776	233.728	334.374	524.465	192.092	230.846	222.343	235.776
2024/12/13	359.018	233.819	334.672	524.818	192.253	230.979	222.591	235.868
2024/12/16	358.247	233.743	334.331	522.962	191.883	229.936	221.898	234.689
2024/12/17	357.891	233.719	334.146	522.120	191.675	229.492	221.568	234.200
2024/12/18	358.360	233.775	334.354	523.238	191.931	230.096	221.935	234.895
2024/12/19	358.020	233.699	334.022	522.620	191.623	229.883	221.580	234.733
2024/12/20	358.783	233.856	334.605	524.162	192.107	230.621	222.256	235.500
2024/12/23	358.438	233.833	334.421	523.351	191.928	230.178	221.927	235.011
2024/12/24	358.523	233.836	334.352	523.653	191.796	230.488	222.002	235.409
2024/12/25	358.680	233.840	334.412	524.050	191.847	230.731	222.158	235.687
2024/12/26	358.176	233.786	334.042	522.973	191.396	230.298	221.667	235.272
2024/12/27	357.635	233.767	333.857	521.588	191.249	229.427	221.170	234.255
2024/12/30	357.881	233.790	333.997	522.154	191.368	229.740	221.459	234.580

出所:NFRC

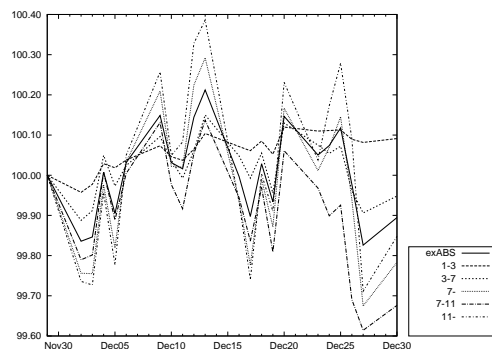
* は 1995 年 12 月末=100。それ以外は、1983 年 12 月末=100。

指数の推移 (月次) 2023 年 12 月末=100 に補正。



出所:NFRC

指数の推移 (日次) 2024 年 11 月末=100 に補正。



出所:NFRC

「除く国債」残存別・投資収益率(2024年12月末)

	累積投資 収益指数	前月末からの投資収益率			過去からの投資収益率	
		トータル	キャピタル	インカム	前年度末	前年末
除く国債	168.986	-0.97	-1.69	0.72	-2.08	-1.74
短期(1-3)	134.037	1.38	0.94	0.44	-0.24	-0.29
中期(3-7)	165.835	-0.15	-0.77	0.63	-1.22	-1.17
長期(7-)	229.309	-3.08	-4.06	0.98	-3.85	-3.06
長期(7-11)	197.553	-3.52	-4.53	1.00	-1.94	-1.47
超長期(11-)	232.519	-2.79	-3.76	0.97	-5.03	-4.03

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(%)

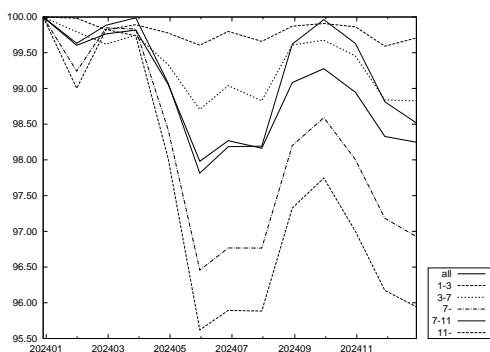
「除く国債」残存別・投資収益指数の推移

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-)
2023/12/29	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
2024/09/30	170.757	134.308	167.261	233.245	200.452	236.885
2024/10/31	170.189	134.246	166.891	231.857	199.783	235.077
2024/11/29	169.125	133.880	165.856	229.910	198.146	233.072
2024/12/02	168.890	133.824	165.678	229.396	197.746	232.518
2024/12/03	168.913	133.852	165.719	229.393	197.774	232.492
2024/12/04	169.151	133.920	165.941	229.855	198.177	232.956
2024/12/05	169.012	133.907	165.821	229.546	197.948	232.615
2024/12/06	169.167	133.937	165.908	229.930	198.175	233.083
2024/12/09	169.329	133.988	166.030	230.273	198.416	233.473
2024/12/10	169.172	133.952	165.938	229.894	198.132	233.056
2024/12/11	169.117	133.940	165.865	229.810	198.008	233.010
2024/12/12	169.284	133.977	165.974	230.201	198.269	233.464
2024/12/13	169.405	134.031	166.121	230.373	198.441	233.619
2024/12/16	169.148	133.989	165.963	229.746	198.071	232.854
2024/12/17	169.023	133.975	165.877	229.448	197.858	232.519
2024/12/18	169.182	134.015	165.980	229.814	198.113	232.937
2024/12/19	169.029	133.976	165.830	229.523	197.804	232.685
2024/12/20	169.343	134.066	166.113	230.142	198.299	233.342
2024/12/23	169.215	134.054	166.027	229.828	198.120	232.955
2024/12/24	169.210	134.054	165.995	229.851	197.986	233.095
2024/12/25	169.252	134.055	166.020	229.959	198.032	233.241
2024/12/26	169.028	134.018	165.833	229.472	197.558	232.788
2024/12/27	168.878	134.011	165.750	229.076	197.418	232.233
2024/12/30	168.986	134.037	165.835	229.309	197.553	232.519

出所:NFRC

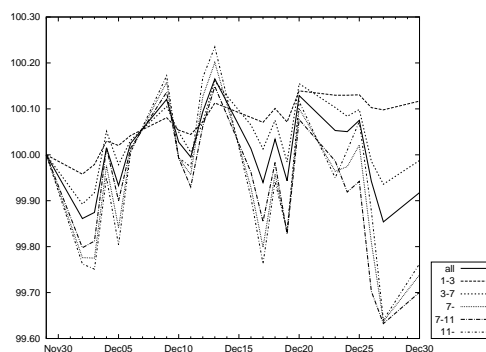
* は 1995年12月末=100。それ以外は、1993年12月末=100。

指数の推移(月次) 2023年12月末=100に補正。



出所:NFRC

指数の推移(日次) 2024年11月末=100に補正。



出所:NFRC

銘柄 残存別・月間投資収益率 (2024 年 12 月末)

	全体	短期 (1-3)	中期 (3-7)	長期 (7-)		
					(7-11)	(11-)
総合	-1.24	1.07	-0.61	-2.56	-3.81	-1.79
国債	-1.29	1.01	-0.72	-2.48	-3.85	-1.66
30 年国債	-1.63	-	-1.62	-1.63	-3.57	-1.42
20 年国債	-2.84	1.03	-1.10	-4.04	-3.74	-4.23
10 年国債	-1.44	1.01	-0.92	-4.00	-4.00	-
5 年国債	0.72	1.01	0.37	-	-	-
中期国債	0.98	0.98	-	-	-	-
地方債	-1.56	1.13	-0.59	-3.68	-3.67	-3.69
東京都債	-1.23	1.11	-0.76	-3.30	-3.69	-2.75
五大都市債	-1.41	1.11	-0.38	-3.39	-3.49	-3.34
その他地方債	-1.60	1.13	-0.57	-3.82	-3.71	-3.96
政保債	-0.96	1.09	-0.25	-2.58	-3.59	-2.05
公営企業債券	0.89	1.12	0.59	-	-	-
その他政保債	-1.18	1.08	-0.41	-2.58	-3.59	-2.05
金融債	1.06	1.77	0.50	-3.52	-3.52	-
特定金融債	-	-	-	-	-	-
事業債	-0.21	1.59	0.30	-2.66	-3.39	-2.04
円建外債	-0.14	0.92	-1.18	-2.51	-2.76	-2.16
MBS	-2.74	-	-	-2.74	1.00	-2.79
ABS	-0.33	1.62	-0.26	-2.76	-3.07	-2.31

出所:NFRFC

「除く(銘柄)」残存別・月間投資収益率 (2024 年 12 月末)

	全体	短期 (1-3)	中期 (3-7)	長期 (7-)		
					(7-11)	(11-)
除く国債	-0.97	1.38	-0.15	-3.08	-3.52	-2.79
除く 30 年国債	-1.17	1.07	-0.60	-2.95	-3.83	-2.08
除く 20 年国債	-0.66	1.08	-0.47	-1.76	-3.85	-0.54
除く 10 年国債	-1.17	1.10	-0.40	-2.27	-3.67	-1.79
除く 5 年国債	-1.47	1.10	-0.81	-2.56	-3.81	-1.79
除く中期国債	-1.31	1.09	-0.61	-2.56	-3.81	-1.79
除く地方債	-1.22	1.07	-0.61	-2.50	-3.82	-1.72
除く東京都債	-1.24	1.07	-0.61	-2.55	-3.81	-1.79
除く五大都市債	-1.24	1.07	-0.61	-2.55	-3.81	-1.78
除くその他地方債	-1.22	1.07	-0.61	-2.51	-3.82	-1.74
除く政保債	-1.24	1.07	-0.62	-2.56	-3.81	-1.79
除く公営企業債券	-1.24	1.07	-0.61	-2.56	-3.81	-1.79
除くその他政保債	-1.24	1.07	-0.61	-2.56	-3.81	-1.79
除く金融債	-1.25	1.07	-0.62	-2.56	-3.81	-1.79
除く特定金融債	-1.24	1.07	-0.61	-2.56	-3.81	-1.79
除く事業債	-1.31	1.03	-0.70	-2.55	-3.83	-1.78
除く円建外債	-1.24	1.08	-0.61	-2.56	-3.81	-1.79
除く MBS	-1.22	1.07	-0.61	-2.55	-3.82	-1.75
除く ABS	-1.24	1.07	-0.61	-2.56	-3.81	-1.79
除く MBS・ABS	-1.22	1.07	-0.61	-2.55	-3.82	-1.75

出所:NFRFC

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

事業債 業種別・月間投資収益率(2024年12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	-0.21	1.59	0.30	-2.66	-3.39	-2.04
水産・農林業	1.03	1.54	0.94	-	-	-
鉱業	-1.34	1.56	-2.86	-	-	-
建設業	0.32	1.29	0.37	-3.38	-3.49	-3.24
食料品	0.83	1.73	0.80	-0.60	-2.47	2.79
繊維製品	0.37	1.27	0.72	-2.87	-3.21	-2.56
パルプ・紙	-0.20	1.16	-0.71	-3.31	-3.06	-3.40
化学	-0.19	1.36	-0.02	-3.22	-3.69	-2.77
医薬品	-1.03	1.24	-1.42	-2.64	-3.33	-2.45
石油・石炭製品	-1.73	1.33	-1.16	-3.52	-3.40	-4.00
ゴム製品	0.62	1.36	0.50	-3.52	-3.52	-
ガラス・土石製品	-0.30	1.32	0.61	-2.92	-2.85	-3.11
鉄鋼	0.65	1.29	0.98	-2.97	-3.11	-2.25
非鉄金属	0.20	1.40	0.04	-3.29	-3.29	-
金属製品	0.65	1.37	0.57	-3.55	-3.55	-
機械	-0.22	1.34	0.22	-3.84	-3.84	-
電気機器	0.17	1.31	0.36	-4.19	-4.19	-
輸送用機器	0.87	2.36	0.77	-3.20	-3.29	-3.08
精密機器	-6.37	-1.03	-9.54	-3.23	-3.23	-
その他製品	-0.34	1.56	0.20	-3.43	-	-3.43
電気・ガス業	-0.90	1.36	-0.16	-2.76	-3.21	-2.31
陸運業	-1.01	1.34	-0.38	-1.93	-3.44	-1.24
海運業	0.52	1.28	1.08	-2.27	-2.27	-
空運業	-2.07	1.51	0.83	-4.63	-5.54	-3.73
倉庫・運輸関連業	-0.77	1.51	-0.15	-3.72	-4.52	-2.96
情報・通信業	1.00	2.01	1.48	-3.53	-3.01	-4.78
卸売業	-0.59	1.51	0.56	-3.22	-3.29	-3.06
小売業	1.05	1.82	1.36	-1.75	-2.48	0.48
銀行業	1.69	2.00	1.67	-2.20	-2.20	-
証券・商品先物取引業	2.62	2.71	2.41	0.46	0.46	-
保険業	0.56	1.30	1.21	-3.57	-3.57	-
その他金融業	0.95	2.25	0.83	-4.06	-4.86	2.82
不動産業	-0.56	1.36	0.21	-2.78	-3.66	-1.62
サービス業	5.41	4.36	4.93	8.48	4.63	21.73
財投機関債	-0.73	1.17	0.01	-2.82	-3.54	-2.46

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(%)。
- 東証33業種分類を参考にNFRFC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12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	-0.21	1.52	0.23	-2.66	-3.37	-2.04
AAA～A格	-0.22	1.51	0.22	-2.66	-3.38	-2.03
AAA～AA格	-0.50	1.26	-0.05	-2.69	-3.63	-1.96
AAA格	-0.09	1.19	-0.15	-3.19	-4.37	-0.92
AA格	-0.61	1.28	-0.01	-2.62	-3.49	-2.04
A格	0.45	2.09	0.80	-2.55	-2.73	-2.33
BBB格	0.93	1.96	0.87	-3.02	-1.74	-4.25
事業債全体	-0.21	1.59	0.30	-2.66	-3.39	-2.04
AAA～A格	-0.22	1.58	0.30	-2.65	-3.38	-2.03
AAA～AA格	-0.48	1.32	0.03	-2.66	-3.59	-1.96
AAA格	-0.09	1.19	-0.15	-3.19	-4.37	-0.92
AA格	-0.60	1.38	0.09	-2.60	-3.44	-2.04
A格	0.46	2.21	0.92	-2.61	-2.83	-2.33
BBB格	0.91	2.21	0.63	-7.98	-5.20	-9.55
円建外債全体	-0.14	0.92	-1.18	-2.51	-2.76	-2.16
AAA～A格	-0.30	0.84	-1.61	-2.83	-3.23	-2.28
AAA～AA格	-0.99	0.28	-2.21	-7.42	-7.71	-2.65
AAA格	-	-	-	-	-	-
AA格	-0.99	0.28	-2.21	-7.42	-7.71	-2.65
A格	0.35	1.37	-0.92	-1.25	-0.05	-2.26
BBB格	0.94	1.69	1.07	-1.35	-0.95	-1.80

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

事業債 円建外債 最高格付別・月間投資収益率(2024年12月末)

	全体	短期 (1-3)	中期 (3-7)	長期 (7-)	月間投資収益率	
					(7-11)	(11-)
事業債						
AAA~AA格	-0.48	1.32	0.03	-2.66	-3.59	-1.96
AAA~A格	-0.22	1.58	0.30	-2.65	-3.38	-2.03
AAA~BBB格	-0.21	1.59	0.30	-2.66	-3.39	-2.04
AAA~BB格	-0.21	1.59	0.30	-2.66	-3.39	-2.04
AAA格	-0.09	1.19	-0.15	-3.19	-4.37	-0.92
AA格	-0.60	1.38	0.09	-2.60	-3.44	-2.04
A格	0.46	2.21	0.92	-2.61	-2.83	-2.33
BBB格	0.91	2.21	0.63	-7.98	-5.20	-9.55
BB格	-	-	-	-	-	-
B格以下	-	-	-	-	-	-
格付なし	-	-	-	-	-	-
円建外債						
AAA~AA格	-0.99	0.28	-2.21	-7.42	-7.71	-2.65
AAA~A格	-0.30	0.84	-1.61	-2.83	-3.23	-2.28
AAA~BBB格	-0.14	0.92	-1.18	-2.51	-2.76	-2.16
AAA~BB格	-0.14	0.92	-1.18	-2.51	-2.76	-2.16
AAA格	-	-	-	-	-	-
AA格	-0.99	0.28	-2.21	-7.42	-7.71	-2.65
A格	0.35	1.37	-0.92	-1.25	-0.05	-2.26
BBB格	0.94	1.69	1.07	-1.35	-0.95	-1.80
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12月末)

	全体	短期 (1-3)	中期 (3-7)	長期 (7-)	月間投資収益率	
					(7-11)	(11-)
事業債						
AAA~AA格	0.02	1.41	0.49	-2.62	-3.39	-1.87
AAA~A格	-0.23	1.58	0.26	-2.65	-3.38	-2.02
AAA~BBB格	-0.22	1.59	0.29	-2.66	-3.39	-2.04
AAA~BB格	-0.21	1.59	0.30	-2.66	-3.39	-2.04
AAA格	-	-	-	-	-	-
AA格	0.02	1.41	0.49	-2.62	-3.39	-1.87
A格	-0.29	1.62	0.20	-2.66	-3.38	-2.05
BBB格	0.23	1.83	1.15	-2.98	-3.44	-2.52
BB格	1.02	-	1.41	-2.63	-	-2.63
B格以下	-	-	-	-	-	-
格付なし	-	-	-	-	-	-
円建外債						
AAA~AA格	0.94	1.24	0.73	-3.53	-3.53	-
AAA~A格	-0.87	0.48	-2.41	-5.72	-8.15	-2.35
AAA~BBB格	-0.14	0.92	-1.18	-2.51	-2.76	-2.16
AAA~BB格	-0.14	0.92	-1.18	-2.51	-2.76	-2.16
AAA格	-	-	-	-	-	-
AA格	0.94	1.24	0.73	-3.53	-3.53	-
A格	-1.34	0.26	-3.19	-5.94	-9.01	-2.35
BBB格	0.86	1.69	0.22	-0.27	1.09	-2.04
BB格	-	-	-	-	-	-
B格以下	-	-	-	-	-	-
格付なし	-	-	-	-	-	-

出所:NFRFC

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

事業債 円建外債 R&I 格付別・月間投資収益率(2024年12月末)

	全体	短期 (1-3)	中期 (3-7)	長期 (7-)	月間投資収益率	
					(7-11)	(11-)
事業債						
AAA~AA 格	-0.51	1.27	0.09	-2.62	-3.67	-1.86
AAA~A 格	-0.33	1.51	0.21	-2.72	-3.50	-2.07
AAA~BBB 格	-0.31	1.52	0.25	-2.73	-3.50	-2.08
AAA~BB 格	-0.31	1.52	0.25	-2.73	-3.50	-2.08
AAA 格	0.42	1.28	0.27	-3.36	-3.44	-3.15
AA 格	-0.53	1.27	0.09	-2.61	-3.67	-1.85
A 格	-0.01	1.93	0.39	-2.97	-3.18	-2.71
BBB 格	2.54	2.15	3.85	-7.98	-5.20	-9.55
BB 格	-	-	-	-	-	-
B 格以下	-	-	-	-	-	-
格付なし	0.85	2.22	0.78	-1.43	-1.71	-1.03
円建外債						
AAA~AA 格	1.95	1.82	3.16	-1.04	-0.44	-2.65
AAA~A 格	-0.21	0.99	-1.27	-7.16	-7.77	-2.65
AAA~BBB 格	-0.14	0.99	-1.27	-4.17	-7.77	3.60
AAA~BB 格	-0.14	0.99	-1.27	-4.17	-7.77	3.60
AAA 格	-	-	-	-	-	-
AA 格	1.95	1.82	3.16	-1.04	-0.44	-2.65
A 格	-1.00	0.57	-2.09	-11.73	-11.73	-
BBB 格	6.12	-	-	6.12	-	6.12
BB 格	-	-	-	-	-	-
B 格以下	-	-	-	-	-	-
格付なし	-0.14	0.90	-1.16	-2.27	-1.89	-2.75

出所:NFRC

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

事業債 円建外債 JCR 格付別・月間投資収益率(2024年12月末)

	全体	短期 (1-3)	中期 (3-7)	長期 (7-)	月間投資収益率	
					(7-11)	(11-)
事業債						
AAA~AA 格	-0.19	1.36	0.06	-3.08	-3.70	-2.24
AAA~A 格	-0.03	1.48	0.36	-2.88	-3.33	-2.29
AAA~BBB 格	-0.03	1.49	0.36	-2.89	-3.33	-2.32
AAA~BB 格	-0.03	1.49	0.36	-2.89	-3.33	-2.32
AAA 格	-0.10	1.19	-0.16	-3.19	-4.37	-0.92
AA 格	-0.25	1.49	0.21	-3.04	-3.40	-2.60
A 格	0.39	1.84	1.09	-2.44	-2.49	-2.39
BBB 格	0.50	2.41	0.88	-7.98	-5.20	-9.55
BB 格	-	-	-	-	-	-
B 格以下	-	-	-	-	-	-
格付なし	-0.51	1.79	0.18	-2.45	-3.46	-1.87
円建外債						
AAA~AA 格	1.76	1.80	2.39	-0.92	-0.52	-2.65
AAA~A 格	1.40	1.79	1.51	-0.19	2.87	-2.28
AAA~BBB 格	1.42	1.81	1.52	-0.19	2.87	-2.28
AAA~BB 格	1.42	1.81	1.52	-0.19	2.87	-2.28
AAA 格	-	-	-	-	-	-
AA 格	1.76	1.80	2.39	-0.92	-0.52	-2.65
A 格	1.27	1.78	1.16	-0.10	3.82	-2.26
BBB 格	2.11	2.35	1.68	-	-	-
BB 格	-	-	-	-	-	-
B 格以下	-	-	-	-	-	-
格付なし	-0.86	0.44	-1.87	-5.35	-6.38	-1.80

出所:NFRC

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

事業債 円建外債 Moody's 格付別・月間投資収益率 (2024 年 12 月末)

	全体	短期 (1-3)	中期 (3-7)	長期 (7-)	月間投資収益率	
					(7-11)	(11-)
事業債						
AAA ~ AA 格	-	-	-	-	-	-
AAA ~ A 格	-0.63	1.25	0.07	-2.76	-3.52	-2.26
AAA ~ BBB 格	-0.62	1.25	0.11	-2.76	-3.51	-2.25
AAA ~ BB 格	-0.62	1.25	0.11	-2.76	-3.51	-2.25
AAA 格	-	-	-	-	-	-
AA 格	-	-	-	-	-	-
A 格	-0.63	1.25	0.07	-2.76	-3.52	-2.26
BBB 格	-0.45	1.30	0.42	-2.73	-3.38	-2.14
BB 格	-	-	-	-	-	-
B 格以下	-	-	-	-	-	-
格付なし	0.03	1.76	0.40	-2.58	-3.31	-1.83
円建外債						
AAA ~ AA 格	-1.52	-0.08	-2.74	-9.06	-9.06	-
AAA ~ A 格	-0.88	0.45	-2.26	-5.60	-7.58	-2.35
AAA ~ BBB 格	-0.20	0.86	-1.21	-2.51	-2.76	-2.16
AAA ~ BB 格	-0.20	0.86	-1.21	-2.51	-2.76	-2.16
AAA 格	-	-	-	-	-	-
AA 格	-1.52	-0.08	-2.74	-9.06	-9.06	-
A 格	0.11	1.13	-0.94	-3.73	-5.66	-2.35
BBB 格	0.88	1.72	0.18	0.07	1.93	-2.04
BB 格	-	-	-	-	-	-
B 格以下	-	-	-	-	-	-
格付なし	1.38	1.93	-0.15	-	-	-

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、Moody's の格付をもとに NFRFC で分類

事業債 円建外債 S&P 格付別・月間投資収益率 (2024 年 12 月末)

	全体	短期 (1-3)	中期 (3-7)	長期 (7-)	月間投資収益率	
					(7-11)	(11-)
事業債						
AAA ~ AA 格	-1.43	1.15	-1.15	-1.68	-3.57	-0.67
AAA ~ A 格	-0.84	1.22	-0.49	-2.49	-3.93	-1.20
AAA ~ BBB 格	-0.82	1.22	-0.47	-2.50	-3.92	-1.20
AAA ~ BB 格	-0.79	1.22	-0.40	-2.50	-3.92	-1.21
AAA 格	-	-	-	-	-	-
AA 格	-1.43	1.15	-1.15	-1.68	-3.57	-0.67
A 格	-0.81	1.22	-0.48	-2.58	-3.95	-1.26
BBB 格	0.36	1.28	0.71	-3.06	-3.42	-2.25
BB 格	1.02	-	1.41	-2.63	-	-2.63
B 格以下	-	-	-	-	-	-
格付なし	-0.04	1.67	0.50	-2.73	-3.16	-2.37
円建外債						
AAA ~ AA 格	0.99	1.31	0.72	-3.53	-3.53	-
AAA ~ A 格	-0.94	0.42	-2.44	-5.79	-8.34	-2.35
AAA ~ BBB 格	-0.17	0.89	-1.19	-2.52	-2.79	-2.16
AAA ~ BB 格	-0.17	0.89	-1.19	-2.52	-2.79	-2.16
AAA 格	-	-	-	-	-	-
AA 格	0.99	1.31	0.72	-3.53	-3.53	-
A 格	-1.46	0.15	-3.23	-6.02	-9.26	-2.35
BBB 格	0.91	1.73	0.32	-0.27	1.09	-2.04
BB 格	-	-	-	-	-	-
B 格以下	-	-	-	-	-	-
格付なし	1.92	2.16	0.72	-0.61	-0.61	-

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、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12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	1,144,227	95.32	95.47	10.25	0.83	1.14	1.10	8.70	8.64	8.66	5
短期 (1-3)	231,065	99.65	99.72	1.99	0.41	0.60	0.60	1.98	1.97	1.98	5
中期 (3-7)	311,263	99.57	99.69	4.86	0.67	0.77	0.76	4.77	4.76	4.77	5
長期 (7-)	601,898	91.46	91.66	16.21	1.07	1.57	1.51	13.72	13.60	13.63	4
長期 (7-11)	207,076	100.39	100.56	8.75	1.05	1.01	1.02	8.36	8.32	8.35	3
超長期 (11-)	394,822	86.78	86.99	20.13	1.08	1.91	1.80	16.97	16.81	16.83	4
(11-15)	93,879	94.17	94.37	12.96	0.93	1.45	1.41	12.15	12.07	12.14	4
(15-)	300,943	84.47	84.69	22.37	1.12	2.07	1.94	18.64	18.46	18.47	4
国債	970,600	95.23	95.38	10.77	0.85	1.14	1.09	9.10	9.03	9.04	1
短期 (1-3)	189,830	99.73	99.80	1.98	0.41	0.55	0.55	1.97	1.97	1.97	0
中期 (3-7)	252,456	99.88	99.98	4.88	0.68	0.72	0.72	4.79	4.78	4.79	1
長期 (7-)	528,313	91.40	91.60	16.75	1.09	1.59	1.50	14.13	14.01	14.03	1
長期 (7-11)	180,067	100.70	100.86	8.77	1.06	0.98	0.99	8.37	8.33	8.37	0
超長期 (11-)	348,246	86.59	86.81	20.87	1.10	1.95	1.81	17.59	17.42	17.43	1
(11-15)	81,733	94.63	94.83	13.05	0.94	1.42	1.39	12.23	12.14	12.21	1
(15-)	266,514	84.12	84.35	23.27	1.15	2.13	1.96	19.44	19.24	19.23	2
地方債	66,798	96.45	96.59	7.32	0.62	1.01	1.02	6.74	6.69	6.72	12
短期 (1-3)	12,882	99.44	99.52	2.05	0.37	0.66	0.66	2.04	2.03	2.04	11
中期 (3-7)	24,729	98.27	98.38	4.95	0.50	0.84	0.83	4.88	4.86	4.88	11
長期 (7-)	29,186	93.58	93.78	11.66	0.84	1.33	1.36	10.59	10.51	10.54	13
政保債	14,373	95.40	95.62	9.24	0.75	1.12	1.07	7.94	7.88	7.91	7
短期 (1-3)	3,441	99.20	99.26	2.05	0.21	0.62	0.62	2.05	2.04	2.05	7
中期 (3-7)	4,157	99.87	100.08	4.45	0.68	0.76	0.76	4.38	4.36	4.38	7
長期 (7-)	6,775	90.74	91.04	15.83	1.07	1.63	1.54	13.59	13.48	13.53	8
金融債	3,376	98.40	98.47	3.11	0.33	0.87	0.87	3.07	3.05	3.07	26
短期 (1-3)	1,968	98.87	98.91	1.97	0.19	0.77	0.77	1.97	1.96	1.97	22
中期 (3-7)	1,249	97.96	98.06	4.25	0.50	0.97	0.96	4.20	4.18	4.20	29
長期 (7-)	159	96.04	96.16	8.31	0.82	1.38	1.36	8.02	7.96	8.01	41
事業債	70,593	95.36	95.54	7.39	0.77	1.30	1.25	6.29	6.24	6.26	39
短期 (1-3)	20,594	99.22	99.34	2.00	0.49	0.89	0.89	1.99	1.98	1.99	34
中期 (3-7)	26,948	98.04	98.21	4.71	0.70	1.12	1.11	4.61	4.59	4.61	40
長期 (7-)	23,051	88.77	89.04	15.35	1.09	1.93	1.80	12.74	12.62	12.64	42
長期 (7-11)	9,682	97.51	97.77	8.70	1.11	1.44	1.42	8.27	8.22	8.27	44
超長期 (11-)	13,369	82.44	82.71	20.16	1.08	2.35	2.13	16.57	16.38	16.39	40
円建外債	3,950	98.72	98.97	3.69	1.09	1.47	1.46	3.51	3.48	3.51	81
短期 (1-3)	2,174	99.28	99.50	2.17	0.97	1.31	1.31	2.15	2.13	2.15	75
中期 (3-7)	1,411	98.20	98.45	4.13	1.05	1.52	1.51	4.03	4.00	4.03	83
長期 (7-)	365	97.45	97.82	11.08	1.95	2.25	2.23	9.76	9.65	9.72	106
長期 (7-11)	208	97.62	98.02	8.70	1.64	1.99	1.97	8.08	8.00	8.08	99
超長期 (11-)	157	97.23	97.54	14.25	2.35	2.61	2.57	11.99	11.84	11.93	115
MBS	13,882	93.96	94.00	7.44	0.63	0.89	1.42	6.89	6.84	7.23	23
ABS	655	95.24	95.41	5.85	0.74	1.50	1.46	5.42	5.38	5.42	68
短期 (1-3)	176	98.84	98.96	2.07	0.64	1.20	1.19	2.06	2.05	2.06	64
中期 (3-7)	313	96.35	96.52	5.11	0.68	1.41	1.38	5.00	4.96	5.00	66
長期 (7-)	166	89.29	89.56	11.28	0.96	2.05	1.92	10.25	10.15	10.23	75

出所:NFRIC

「除く」銘柄 残存別・ポートフォリオ指標 (2024年12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	1,130,345	95.34	95.49	10.29	0.83	1.14	1.10	8.72	8.66	8.68	4
短期 (1-3)	231,065	99.65	99.72	1.99	0.41	0.60	0.60	1.98	1.97	1.98	5
中期 (3-7)	311,263	99.57	99.69	4.86	0.67	0.77	0.76	4.77	4.76	4.77	5
長期 (7-)	588,016	91.40	91.61	16.42	1.08	1.59	1.51	13.89	13.77	13.79	3
長期 (7-11)	206,904	100.39	100.56	8.76	1.05	1.01	1.02	8.36	8.32	8.36	3
超長期 (11-)	381,112	86.52	86.74	20.58	1.09	1.95	1.82	17.36	17.20	17.21	3
(11-15)	93,879	94.17	94.37	12.96	0.93	1.45	1.41	12.15	12.07	12.14	4
(15-)	287,233	84.02	84.25	23.07	1.14	2.13	1.96	19.27	19.07	19.06	3
除く ABS	1,143,572	95.32	95.47	10.26	0.83	1.14	1.10	8.70	8.64	8.66	5
短期 (1-3)	230,889	99.65	99.72	1.99	0.41	0.60	0.60	1.98	1.97	1.98	5
中期 (3-7)	310,950	99.58	99.69	4.86	0.67	0.77	0.76	4.77	4.76	4.77	5
長期 (7-)	601,732	91.46	91.66	16.22	1.07	1.57	1.51	13.72	13.61	13.63	4
長期 (7-11)	206,983	100.39	100.56	8.75	1.05	1.01	1.02	8.36	8.32	8.35	3
超長期 (11-)	394,750	86.78	86.99	20.13	1.08	1.91	1.80	16.97	16.81	16.83	4
(11-15)	93,828	94.18	94.38	12.96	0.93	1.45	1.41	12.15	12.07	12.14	4
(15-)	300,922	84.47	84.69	22.37	1.12	2.07	1.94	18.64	18.46	18.47	4
除く MBS・ABS	1,129,690	95.34	95.49	10.29	0.83	1.14	1.10	8.73	8.66	8.68	4
短期 (1-3)	230,889	99.65	99.72	1.99	0.41	0.60	0.60	1.98	1.97	1.98	5
中期 (3-7)	310,950	99.58	99.69	4.86	0.67	0.77	0.76	4.77	4.76	4.77	5
長期 (7-)	587,850	91.40	91.61	16.42	1.08	1.59	1.51	13.89	13.77	13.79	3
長期 (7-11)	206,811	100.39	100.57	8.76	1.05	1.01	1.02	8.36	8.32	8.36	3
超長期 (11-)	381,039	86.52	86.74	20.58	1.09	1.95	1.82	17.36	17.20	17.21	3
(11-15)	93,828	94.18	94.38	12.96	0.93	1.45	1.41	12.15	12.07	12.14	4
(15-)	287,212	84.02	84.25	23.08	1.14	2.13	1.96	19.27	19.07	19.06	3
除く 国債	173,627	95.80	95.96	7.35	0.70	1.14	1.16	6.51	6.47	6.52	26
短期 (1-3)	41,235	99.27	99.37	2.03	0.44	0.82	0.81	2.02	2.01	2.02	27
中期 (3-7)	58,807	98.26	98.41	4.77	0.62	0.98	0.97	4.69	4.67	4.69	27
長期 (7-)	73,585	91.90	92.10	12.39	0.91	1.46	1.53	10.79	10.70	10.80	24
長期 (7-11)	27,009	98.29	98.55	8.63	0.99	1.22	1.21	8.25	8.20	8.25	24
超長期 (11-)	46,576	88.19	88.36	14.57	0.86	1.62	1.73	12.43	12.31	12.45	24

出所:NFRC

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

銘柄 残存別・ポートフォリオ指標 (2024年12月末、1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	1,153,433	95.33	95.49	10.30	0.83	1.14	1.11	8.74	8.67	8.69	5
短期 (1-3)	230,778	99.65	99.72	2.01	0.42	0.60	0.60	2.00	1.99	2.00	5
中期 (3-7)	314,141	99.57	99.69	4.87	0.67	0.77	0.77	4.78	4.76	4.78	5
長期 (7-)	608,514	91.51	91.71	16.24	1.07	1.57	1.51	13.73	13.62	13.65	4
長期 (7-11)	210,482	100.37	100.54	8.77	1.05	1.02	1.02	8.38	8.34	8.37	3
超長期 (11-)	398,032	86.83	87.05	20.19	1.08	1.91	1.80	17.00	16.84	16.87	4
(11-15)	93,894	94.16	94.36	12.96	0.93	1.45	1.41	12.16	12.07	12.14	4
(15-)	304,139	84.57	84.79	22.43	1.13	2.07	1.94	18.67	18.48	18.49	4
国債	979,414	95.25	95.40	10.81	0.85	1.14	1.10	9.13	9.06	9.07	1
短期 (1-3)	189,531	99.73	99.80	2.00	0.42	0.55	0.55	1.99	1.98	1.99	1
中期 (3-7)	255,016	99.88	99.98	4.88	0.68	0.72	0.72	4.79	4.78	4.79	1
長期 (7-)	534,868	91.45	91.66	16.77	1.09	1.59	1.50	14.14	14.02	14.04	1
長期 (7-11)	183,498	100.66	100.83	8.79	1.05	0.99	0.99	8.39	8.35	8.39	0
超長期 (11-)	351,370	86.65	86.87	20.94	1.11	1.95	1.81	17.62	17.45	17.46	2
(11-15)	81,733	94.63	94.83	13.05	0.94	1.42	1.39	12.23	12.14	12.21	1
(15-)	269,638	84.23	84.46	23.33	1.16	2.13	1.96	19.46	19.26	19.25	2
地方債	66,892	96.45	96.59	7.38	0.63	1.02	1.03	6.79	6.75	6.77	12
短期 (1-3)	12,801	99.41	99.49	2.11	0.37	0.67	0.67	2.10	2.09	2.10	11
中期 (3-7)	24,833	98.25	98.36	5.01	0.50	0.84	0.83	4.94	4.92	4.94	11
長期 (7-)	29,257	93.62	93.81	11.71	0.85	1.34	1.37	10.63	10.55	10.57	13
政保債	14,403	95.41	95.63	9.32	0.76	1.12	1.08	8.00	7.95	7.98	7
短期 (1-3)	3,391	99.17	99.23	2.10	0.21	0.62	0.62	2.09	2.09	2.09	7
中期 (3-7)	4,197	99.92	100.14	4.51	0.69	0.76	0.76	4.43	4.41	4.43	7
長期 (7-)	6,815	90.75	91.05	15.88	1.07	1.63	1.54	13.63	13.52	13.57	8
金融債	3,369	98.40	98.46	3.18	0.34	0.88	0.87	3.13	3.11	3.13	26
短期 (1-3)	1,955	98.85	98.89	2.03	0.20	0.78	0.78	2.02	2.02	2.02	23
中期 (3-7)	1,254	97.99	98.09	4.31	0.51	0.98	0.97	4.25	4.23	4.25	29
長期 (7-)	159	96.04	96.16	8.31	0.82	1.38	1.36	8.02	7.96	8.01	41
事業債	70,594	95.36	95.54	7.42	0.77	1.30	1.25	6.32	6.27	6.29	39
短期 (1-3)	20,579	99.21	99.32	2.04	0.49	0.90	0.89	2.03	2.02	2.03	34
中期 (3-7)	27,070	98.02	98.19	4.75	0.70	1.12	1.11	4.65	4.63	4.65	40
長期 (7-)	22,946	88.76	89.03	15.40	1.10	1.93	1.81	12.78	12.65	12.68	42
長期 (7-11)	9,602	97.59	97.85	8.75	1.12	1.44	1.42	8.31	8.25	8.31	44
超長期 (11-)	13,344	82.42	82.69	20.19	1.08	2.35	2.13	16.58	16.40	16.40	40
円建外債	4,179	98.78	99.02	3.76	1.12	1.48	1.48	3.55	3.53	3.55	82
短期 (1-3)	2,353	99.30	99.51	2.21	1.01	1.34	1.34	2.18	2.17	2.18	78
中期 (3-7)	1,444	98.27	98.52	4.20	1.07	1.51	1.50	4.10	4.07	4.10	82
長期 (7-)	382	97.56	97.90	11.59	2.00	2.29	2.26	10.06	9.94	10.02	106
長期 (7-11)	211	97.71	98.09	8.80	1.67	2.01	1.99	8.16	8.08	8.16	100
超長期 (11-)	171	97.37	97.68	15.02	2.39	2.64	2.60	12.42	12.25	12.33	114
MBS	13,925	93.98	94.01	7.47	0.64	0.89	1.42	6.92	6.87	7.27	22
ABS	657	95.25	95.43	5.91	0.75	1.50	1.46	5.49	5.44	5.48	67
短期 (1-3)	169	98.82	98.92	2.12	0.64	1.20	1.19	2.10	2.09	2.10	64
中期 (3-7)	327	96.36	96.53	5.14	0.69	1.41	1.39	5.03	5.00	5.03	66
長期 (7-)	162	89.29	89.55	11.44	0.99	2.06	1.93	10.38	10.28	10.36	75

出所:NFRIC

「除く」銘柄 残存別・ポートフォリオ指標 (2024年12月末、1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	1,139,508	95.35	95.50	10.33	0.83	1.14	1.10	8.76	8.69	8.71	4
短期 (1-3)	230,778	99.65	99.72	2.01	0.42	0.60	0.60	2.00	1.99	2.00	5
中期 (3-7)	314,141	99.57	99.69	4.87	0.67	0.77	0.77	4.78	4.76	4.78	5
長期 (7-)	594,589	91.45	91.66	16.45	1.08	1.59	1.51	13.90	13.78	13.80	3
長期 (7-11)	210,310	100.37	100.54	8.78	1.05	1.02	1.02	8.38	8.34	8.38	3
超長期 (11-)	384,279	86.58	86.80	20.65	1.10	1.95	1.82	17.39	17.23	17.24	3
(11-15)	93,894	94.16	94.36	12.96	0.93	1.45	1.41	12.16	12.07	12.14	4
(15-)	290,385	84.12	84.35	23.13	1.15	2.13	1.97	19.29	19.09	19.08	3
除く ABS	1,152,776	95.33	95.49	10.30	0.83	1.14	1.11	8.74	8.67	8.69	5
短期 (1-3)	230,609	99.65	99.72	2.01	0.42	0.60	0.60	2.00	1.99	2.00	5
中期 (3-7)	313,814	99.57	99.69	4.87	0.67	0.77	0.76	4.78	4.76	4.78	5
長期 (7-)	608,353	91.51	91.71	16.25	1.07	1.57	1.51	13.74	13.62	13.65	4
長期 (7-11)	210,393	100.37	100.54	8.77	1.05	1.02	1.02	8.38	8.34	8.37	3
超長期 (11-)	397,960	86.83	87.05	20.20	1.08	1.91	1.80	17.01	16.85	16.87	4
(11-15)	93,842	94.17	94.37	12.96	0.93	1.45	1.41	12.16	12.07	12.14	4
(15-)	304,118	84.57	84.79	22.43	1.13	2.07	1.94	18.67	18.48	18.49	4
除く MBS・ABS	1,138,851	95.35	95.50	10.33	0.83	1.14	1.10	8.76	8.70	8.71	4
短期 (1-3)	230,609	99.65	99.72	2.01	0.42	0.60	0.60	2.00	1.99	2.00	5
中期 (3-7)	313,814	99.57	99.69	4.87	0.67	0.77	0.76	4.78	4.76	4.78	5
長期 (7-)	594,428	91.45	91.66	16.45	1.08	1.59	1.51	13.90	13.78	13.80	3
長期 (7-11)	210,221	100.37	100.54	8.78	1.05	1.02	1.02	8.38	8.34	8.38	3
超長期 (11-)	384,206	86.58	86.80	20.65	1.10	1.95	1.82	17.39	17.23	17.24	3
(11-15)	93,842	94.17	94.37	12.96	0.93	1.45	1.41	12.16	12.07	12.14	4
(15-)	290,364	84.12	84.35	23.13	1.15	2.13	1.97	19.29	19.09	19.08	3
除く 国債	174,019	95.81	95.97	7.39	0.70	1.14	1.16	6.55	6.51	6.56	26
短期 (1-3)	41,247	99.26	99.36	2.08	0.44	0.82	0.82	2.06	2.06	2.06	27
中期 (3-7)	59,125	98.24	98.40	4.82	0.62	0.98	0.98	4.74	4.71	4.74	27
長期 (7-)	73,646	91.92	92.12	12.43	0.91	1.46	1.53	10.83	10.73	10.84	24
長期 (7-11)	26,984	98.34	98.59	8.69	1.01	1.22	1.22	8.30	8.25	8.30	24
超長期 (11-)	46,662	88.21	88.38	14.60	0.86	1.62	1.73	12.45	12.33	12.47	24

出所:NFRC

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

事業債 業種別・ポートフォリオ指標 (1/4) (2024年12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	70,593	95.36	95.54	7.39	0.77	1.30	1.25	6.29	6.24	6.26	39
短期 (1-3)	20,594	99.22	99.34	2.00	0.49	0.89	0.89	1.99	1.98	1.99	34
中期 (3-7)	26,948	98.04	98.21	4.71	0.70	1.12	1.11	4.61	4.59	4.61	40
長期 (7-)	23,051	88.77	89.04	15.35	1.09	1.93	1.80	12.74	12.62	12.64	42
長期 (7-11)	9,682	97.51	97.77	8.70	1.11	1.44	1.42	8.27	8.22	8.27	44
超長期 (11-)	13,369	82.44	82.71	20.16	1.08	2.35	2.13	16.57	16.38	16.39	40
水産・農林業	33	98.90	99.11	3.84	0.86	1.16	1.16	3.77	3.75	3.77	50
短期 (1-3)	5	98.61	98.69	2.84	0.55	1.06	1.05	2.82	2.81	2.82	45
中期 (3-7)	28	98.96	99.18	4.02	0.91	1.18	1.18	3.94	3.92	3.94	51
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
鉱業	30	96.11	96.16	4.73	0.21	1.03	1.01	4.64	4.61	4.64	32
短期 (1-3)	10	99.21	99.23	1.21	0.08	0.74	0.74	1.21	1.20	1.21	25
中期 (3-7)	20	94.55	94.62	6.50	0.28	1.17	1.14	6.44	6.40	6.44	35
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
建設業	1,255	97.45	97.54	4.29	0.52	1.08	1.07	4.12	4.10	4.12	38
短期 (1-3)	510	98.88	98.94	2.22	0.36	0.90	0.89	2.21	2.20	2.21	33
中期 (3-7)	595	97.71	97.85	4.49	0.60	1.12	1.11	4.42	4.40	4.42	41
長期 (7-)	150	91.56	91.60	10.50	0.75	1.63	1.55	9.90	9.82	9.89	43
長期 (7-11)	84	95.71	95.76	8.03	0.78	1.38	1.36	7.79	7.73	7.79	44
超長期 (11-)	66	86.29	86.31	13.64	0.71	1.97	1.83	12.88	12.76	12.86	41
食料品	1,566	97.54	97.66	5.03	0.55	1.04	1.02	4.75	4.72	4.75	29
短期 (1-3)	584	99.01	99.06	1.84	0.28	0.73	0.73	1.84	1.83	1.84	20
中期 (3-7)	607	97.89	98.00	4.47	0.52	1.03	1.02	4.41	4.39	4.41	32
長期 (7-)	375	94.70	94.92	10.88	1.02	1.57	1.52	10.06	9.98	10.04	37
長期 (7-11)	235	97.33	97.51	8.62	0.98	1.34	1.32	8.26	8.21	8.26	35
超長期 (11-)	140	90.27	90.58	14.67	1.09	1.98	1.89	13.32	13.19	13.27	39
繊維製品	225	97.31	97.47	4.60	0.53	1.10	1.08	4.38	4.35	4.38	37
短期 (1-3)	80	98.79	98.92	2.34	0.33	0.87	0.86	2.33	2.32	2.33	30
中期 (3-7)	109	97.99	98.12	3.99	0.52	1.06	1.05	3.94	3.92	3.94	38
長期 (7-)	36	91.98	92.25	11.48	1.03	1.80	1.72	10.68	10.58	10.66	50
長期 (7-11)	16	98.47	98.60	8.90	1.29	1.49	1.47	8.42	8.36	8.42	48
超長期 (11-)	20	86.79	87.17	13.54	0.83	2.08	1.94	12.72	12.59	12.70	52
パルプ・紙	329	96.04	96.14	4.78	0.44	1.25	1.22	4.49	4.46	4.49	50
短期 (1-3)	144	98.70	98.76	1.85	0.31	1.04	1.03	1.85	1.84	1.85	49
中期 (3-7)	140	95.75	95.84	5.02	0.41	1.25	1.22	4.94	4.91	4.94	50
長期 (7-)	45	88.47	88.70	13.39	0.98	2.02	1.90	12.36	12.25	12.34	51
長期 (7-11)	10	97.80	97.87	8.95	1.34	1.63	1.61	8.45	8.39	8.45	61
超長期 (11-)	35	85.80	86.08	14.65	0.88	2.15	2.00	13.63	13.50	13.60	48
化学	2,303	95.60	95.72	5.48	0.54	1.25	1.21	5.08	5.04	5.08	45
短期 (1-3)	747	98.81	98.90	2.19	0.36	0.93	0.92	2.18	2.17	2.18	36
中期 (3-7)	1,063	96.94	97.06	4.79	0.51	1.15	1.13	4.72	4.69	4.71	43
長期 (7-)	493	87.83	88.01	11.93	0.88	2.04	1.90	10.89	10.78	10.87	67
長期 (7-11)	220	96.22	96.45	8.26	0.94	1.48	1.45	7.93	7.88	7.93	51
超長期 (11-)	273	81.08	81.22	14.89	0.83	2.58	2.33	13.72	13.56	13.68	82
医薬品	818	95.90	96.07	5.92	0.57	1.22	1.19	5.57	5.53	5.56	41
短期 (1-3)	168	99.12	99.21	1.80	0.33	0.82	0.82	1.79	1.79	1.79	28
中期 (3-7)	525	96.41	96.56	5.57	0.56	1.20	1.18	5.45	5.42	5.45	43
長期 (7-)	125	89.41	89.79	12.95	0.94	1.90	1.79	11.69	11.59	11.66	48
長期 (7-11)	25	96.82	97.13	8.50	1.05	1.49	1.46	8.12	8.06	8.12	50
超長期 (11-)	100	87.56	87.96	14.07	0.91	2.02	1.89	12.68	12.56	12.64	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12月末、1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	70,594	95.36	95.54	7.42	0.77	1.30	1.25	6.32	6.27	6.29	39
短期 (1-3)	20,579	99.21	99.32	2.04	0.49	0.90	0.89	2.03	2.02	2.03	34
中期 (3-7)	27,070	98.02	98.19	4.75	0.70	1.12	1.11	4.65	4.63	4.65	40
長期 (7-)	22,946	88.76	89.03	15.40	1.10	1.93	1.81	12.78	12.65	12.68	42
長期 (7-11)	9,602	97.59	97.85	8.75	1.12	1.44	1.42	8.31	8.25	8.31	44
超長期 (11-)	13,344	82.42	82.69	20.19	1.08	2.35	2.13	16.58	16.40	16.40	40
水産・農林業	33	98.90	99.11	3.84	0.86	1.16	1.16	3.77	3.75	3.77	50
短期 (1-3)	5	98.61	98.69	2.84	0.55	1.06	1.05	2.82	2.81	2.82	45
中期 (3-7)	28	98.96	99.18	4.02	0.91	1.18	1.18	3.94	3.92	3.94	51
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
鉱業	30	96.11	96.16	4.73	0.21	1.03	1.01	4.64	4.61	4.64	32
短期 (1-3)	10	99.21	99.23	1.21	0.08	0.74	0.74	1.21	1.20	1.21	25
中期 (3-7)	20	94.55	94.62	6.50	0.28	1.17	1.14	6.44	6.40	6.44	35
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
建設業	1,255	97.45	97.54	4.29	0.52	1.08	1.07	4.12	4.10	4.12	38
短期 (1-3)	510	98.88	98.94	2.22	0.36	0.90	0.89	2.21	2.20	2.21	33
中期 (3-7)	595	97.71	97.85	4.49	0.60	1.12	1.11	4.42	4.40	4.42	41
長期 (7-)	150	91.56	91.60	10.50	0.75	1.63	1.55	9.90	9.82	9.89	43
長期 (7-11)	84	95.71	95.76	8.03	0.78	1.38	1.36	7.79	7.73	7.79	44
超長期 (11-)	66	86.29	86.31	13.64	0.71	1.97	1.83	12.88	12.76	12.86	41
食料品	1,566	97.54	97.66	5.03	0.55	1.04	1.02	4.75	4.72	4.75	29
短期 (1-3)	584	99.01	99.06	1.84	0.28	0.73	0.73	1.84	1.83	1.84	20
中期 (3-7)	607	97.89	98.00	4.47	0.52	1.03	1.02	4.41	4.39	4.41	32
長期 (7-)	375	94.70	94.92	10.88	1.02	1.57	1.52	10.06	9.98	10.04	37
長期 (7-11)	235	97.33	97.51	8.62	0.98	1.34	1.32	8.26	8.21	8.26	35
超長期 (11-)	140	90.27	90.58	14.67	1.09	1.98	1.89	13.32	13.19	13.27	39
繊維製品	225	97.31	97.47	4.60	0.53	1.10	1.08	4.38	4.35	4.38	37
短期 (1-3)	80	98.79	98.92	2.34	0.33	0.87	0.86	2.33	2.32	2.33	30
中期 (3-7)	109	97.99	98.12	3.99	0.52	1.06	1.05	3.94	3.92	3.94	38
長期 (7-)	36	91.98	92.25	11.48	1.03	1.80	1.72	10.68	10.58	10.66	50
長期 (7-11)	16	98.47	98.60	8.90	1.29	1.49	1.47	8.42	8.36	8.42	48
超長期 (11-)	20	86.79	87.17	13.54	0.83	2.08	1.94	12.72	12.59	12.70	52
パルプ・紙	329	96.04	96.14	4.78	0.44	1.25	1.22	4.49	4.46	4.49	50
短期 (1-3)	154	98.68	98.74	1.93	0.31	1.03	1.03	1.92	1.91	1.92	48
中期 (3-7)	130	95.55	95.63	5.17	0.41	1.27	1.24	5.09	5.06	5.09	52
長期 (7-)	45	88.47	88.70	13.39	0.98	2.02	1.90	12.36	12.25	12.34	51
長期 (7-11)	10	97.80	97.87	8.95	1.34	1.63	1.61	8.45	8.39	8.45	61
超長期 (11-)	35	85.80	86.08	14.65	0.88	2.15	2.00	13.63	13.50	13.60	48
化学	2,303	95.60	95.72	5.48	0.54	1.25	1.21	5.08	5.04	5.08	45
短期 (1-3)	747	98.81	98.90	2.19	0.36	0.93	0.92	2.18	2.17	2.18	36
中期 (3-7)	1,063	96.94	97.06	4.79	0.51	1.15	1.13	4.72	4.69	4.71	43
長期 (7-)	493	87.83	88.01	11.93	0.88	2.04	1.90	10.89	10.78	10.87	67
長期 (7-11)	220	96.22	96.45	8.26	0.94	1.48	1.45	7.93	7.88	7.93	51
超長期 (11-)	273	81.08	81.22	14.89	0.83	2.58	2.33	13.72	13.56	13.68	82
医薬品	818	95.90	96.07	5.92	0.57	1.22	1.19	5.57	5.53	5.56	41
短期 (1-3)	168	99.12	99.21	1.80	0.33	0.82	0.82	1.79	1.79	1.79	28
中期 (3-7)	525	96.41	96.56	5.57	0.56	1.20	1.18	5.45	5.42	5.45	43
長期 (7-)	125	89.41	89.79	12.95	0.94	1.90	1.79	11.69	11.59	11.66	48
長期 (7-11)	25	96.82	97.13	8.50	1.05	1.49	1.46	8.12	8.06	8.12	50
超長期 (11-)	100	87.56	87.96	14.07	0.91	2.02	1.89	12.68	12.56	12.64	48

出所:NFRG

- 東証 33 業種分類を参考に NFRG で分類

事業債 業種別・ポートフォリオ指標 (2/4) (2024年12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	95.54	95.65	6.37	0.60	1.34	1.30	6.02	5.98	6.02	49
短期 (1-3)	50	98.84	98.97	1.99	0.30	0.91	0.91	1.98	1.97	1.98	36
中期 (3-7)	95	95.84	95.97	5.27	0.39	1.20	1.18	5.19	5.16	5.19	45
長期 (7-)	120	93.93	94.03	9.06	0.90	1.63	1.58	8.47	8.40	8.46	59
長期 (7-11)	95	95.79	95.86	7.47	0.84	1.46	1.44	7.24	7.19	7.24	57
超長期 (11-)	25	86.88	87.06	15.10	1.13	2.32	2.16	13.59	13.45	13.54	64
ゴム製品	330	97.82	97.90	3.53	0.39	1.01	1.00	3.47	3.45	3.47	36
短期 (1-3)	158	98.92	98.98	1.95	0.30	0.87	0.86	1.94	1.93	1.94	32
中期 (3-7)	147	97.07	97.16	4.51	0.41	1.09	1.08	4.46	4.43	4.46	38
長期 (7-)	25	95.29	95.45	7.75	0.76	1.45	1.42	7.51	7.46	7.51	53
長期 (7-11)	25	95.29	95.45	7.75	0.76	1.45	1.42	7.51	7.46	7.51	53
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
ガラス・土石製品	272	96.04	96.16	5.62	0.57	1.24	1.21	5.28	5.24	5.27	43
短期 (1-3)	68	98.87	98.90	1.96	0.29	0.88	0.88	1.95	1.94	1.95	33
中期 (3-7)	117	97.48	97.59	4.26	0.52	1.13	1.11	4.20	4.18	4.20	43
長期 (7-)	87	91.91	92.12	10.28	0.87	1.69	1.61	9.56	9.48	9.55	51
長期 (7-11)	62	96.16	96.34	8.45	0.89	1.42	1.39	8.13	8.07	8.13	44
超長期 (11-)	25	81.32	81.61	14.84	0.80	2.50	2.25	13.77	13.61	13.74	73
鉄鋼	458	97.87	97.96	3.93	0.53	1.10	1.08	3.81	3.79	3.81	42
短期 (1-3)	170	98.87	98.92	1.88	0.28	0.90	0.89	1.88	1.87	1.88	35
中期 (3-7)	235	97.75	97.86	4.19	0.58	1.12	1.11	4.13	4.11	4.13	44
長期 (7-)	53	95.18	95.37	9.37	1.09	1.63	1.58	8.81	8.73	8.80	56
長期 (7-11)	43	97.31	97.54	8.42	1.12	1.49	1.47	8.03	7.97	8.03	52
超長期 (11-)	10	85.99	86.04	13.45	0.95	2.32	2.16	12.58	12.44	12.55	74
非鉄金属	390	97.77	97.91	4.04	0.48	1.08	1.07	3.95	3.93	3.95	40
短期 (1-3)	165	98.72	98.80	2.05	0.30	0.95	0.94	2.04	2.04	2.04	39
中期 (3-7)	175	97.34	97.46	4.63	0.56	1.14	1.13	4.56	4.54	4.56	43
長期 (7-)	50	96.15	96.53	8.53	0.81	1.31	1.29	8.23	8.17	8.22	33
長期 (7-11)	50	96.15	96.53	8.53	0.81	1.31	1.29	8.23	8.17	8.22	33
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
金属製品	196	98.22	98.42	3.88	0.59	1.09	1.08	3.81	3.79	3.81	42
短期 (1-3)	65	98.66	98.77	2.33	0.39	0.99	0.98	2.32	2.30	2.32	42
中期 (3-7)	122	98.23	98.47	4.42	0.69	1.11	1.10	4.35	4.32	4.35	41
長期 (7-)	9	94.89	95.12	7.66	0.70	1.45	1.41	7.44	7.39	7.44	53
長期 (7-11)	9	94.89	95.12	7.66	0.70	1.45	1.41	7.44	7.39	7.44	53
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
機械	1,307	97.59	97.73	4.58	0.52	1.10	1.09	4.46	4.43	4.46	39
短期 (1-3)	445	98.74	98.82	2.19	0.32	0.92	0.91	2.18	2.17	2.18	35
中期 (3-7)	595	97.20	97.34	4.66	0.49	1.11	1.09	4.59	4.57	4.59	39
長期 (7-)	267	96.54	96.79	8.36	0.91	1.40	1.38	8.03	7.98	8.03	43
長期 (7-11)	267	96.54	96.79	8.36	0.91	1.40	1.38	8.03	7.98	8.03	43
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
電気機器	1,945	97.96	98.10	4.20	0.55	1.08	1.07	4.10	4.08	4.10	39
短期 (1-3)	765	98.85	98.93	2.23	0.38	0.91	0.90	2.22	2.21	2.22	34
中期 (3-7)	935	97.40	97.54	4.67	0.56	1.12	1.11	4.60	4.57	4.60	40
長期 (7-)	245	97.29	97.60	8.59	1.10	1.47	1.45	8.19	8.13	8.19	48
長期 (7-11)	245	97.29	97.60	8.59	1.10	1.47	1.45	8.19	8.13	8.19	48
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
輸送用機器	1,185	97.18	97.29	4.25	0.45	1.09	1.07	4.06	4.03	4.06	38
短期 (1-3)	564	98.89	98.96	1.79	0.27	0.90	0.89	1.78	1.77	1.78	36
中期 (3-7)	412	97.28	97.41	4.59	0.50	1.09	1.08	4.52	4.49	4.52	38
長期 (7-)	209	92.35	92.56	10.24	0.81	1.63	1.56	9.68	9.60	9.67	45
長期 (7-11)	119	96.64	96.83	8.46	0.92	1.39	1.37	8.12	8.07	8.12	41
超長期 (11-)	90	86.69	86.91	12.60	0.67	1.98	1.85	11.97	11.86	11.95	51

出所:NFRC

- 東証 33 業種分類を参考に NFRC で分類

事業債 業種別・ポートフォリオ指標 (2/4) (2024年12月末、1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	280	95.78	95.89	6.32	0.64	1.33	1.30	5.99	5.94	5.98	50
短期 (1-3)	50	98.84	98.97	1.99	0.30	0.91	0.91	1.98	1.97	1.98	36
中期 (3-7)	110	96.40	96.53	5.31	0.52	1.22	1.20	5.22	5.19	5.22	46
長期 (7-)	120	93.93	94.03	9.06	0.90	1.63	1.58	8.47	8.40	8.46	59
長期 (7-11)	95	95.79	95.86	7.47	0.84	1.46	1.44	7.24	7.19	7.24	57
超長期 (11-)	25	86.88	87.06	15.10	1.13	2.32	2.16	13.59	13.45	13.54	64
ゴム製品	330	97.82	97.90	3.53	0.39	1.01	1.00	3.47	3.45	3.47	36
短期 (1-3)	158	98.92	98.98	1.95	0.30	0.87	0.86	1.94	1.93	1.94	32
中期 (3-7)	147	97.07	97.16	4.51	0.41	1.09	1.08	4.46	4.43	4.46	38
長期 (7-)	25	95.29	95.45	7.75	0.76	1.45	1.42	7.51	7.46	7.51	53
長期 (7-11)	25	95.29	95.45	7.75	0.76	1.45	1.42	7.51	7.46	7.51	53
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
ガラス・土石製品	277	96.10	96.22	5.61	0.58	1.23	1.20	5.27	5.23	5.26	43
短期 (1-3)	68	98.87	98.90	1.96	0.29	0.88	0.88	1.95	1.94	1.95	33
中期 (3-7)	122	97.56	97.67	4.29	0.54	1.12	1.11	4.23	4.21	4.23	43
長期 (7-)	87	91.91	92.12	10.28	0.87	1.69	1.61	9.56	9.48	9.55	51
長期 (7-11)	62	96.16	96.34	8.45	0.89	1.42	1.39	8.13	8.07	8.13	44
超長期 (11-)	25	81.32	81.61	14.84	0.80	2.50	2.25	13.77	13.61	13.74	73
鉄鋼	488	98.00	98.09	3.90	0.56	1.09	1.08	3.79	3.76	3.78	42
短期 (1-3)	192	99.00	99.05	2.00	0.36	0.91	0.91	1.99	1.98	1.99	36
中期 (3-7)	243	97.82	97.92	4.21	0.60	1.13	1.11	4.15	4.13	4.15	44
長期 (7-)	53	95.18	95.37	9.37	1.09	1.63	1.58	8.81	8.73	8.80	56
長期 (7-11)	43	97.31	97.54	8.42	1.12	1.49	1.47	8.03	7.97	8.03	52
超長期 (11-)	10	85.99	86.04	13.45	0.95	2.32	2.16	12.58	12.44	12.55	74
非鉄金属	400	97.83	97.96	4.06	0.50	1.08	1.07	3.97	3.95	3.97	40
短期 (1-3)	165	98.72	98.80	2.05	0.30	0.95	0.94	2.04	2.04	2.04	39
中期 (3-7)	185	97.48	97.60	4.65	0.59	1.14	1.13	4.58	4.55	4.58	42
長期 (7-)	50	96.15	96.53	8.53	0.81	1.31	1.29	8.23	8.17	8.22	33
長期 (7-11)	50	96.15	96.53	8.53	0.81	1.31	1.29	8.23	8.17	8.22	33
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
金属製品	196	98.22	98.42	3.88	0.59	1.09	1.08	3.81	3.79	3.81	42
短期 (1-3)	65	98.66	98.77	2.33	0.39	0.99	0.98	2.32	2.30	2.32	42
中期 (3-7)	122	98.23	98.47	4.42	0.69	1.11	1.10	4.35	4.32	4.35	41
長期 (7-)	9	94.89	95.12	7.66	0.70	1.45	1.41	7.44	7.39	7.44	53
長期 (7-11)	9	94.89	95.12	7.66	0.70	1.45	1.41	7.44	7.39	7.44	53
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
機械	1,307	97.59	97.73	4.58	0.52	1.10	1.09	4.46	4.43	4.46	39
短期 (1-3)	445	98.74	98.82	2.19	0.32	0.92	0.91	2.18	2.17	2.18	35
中期 (3-7)	595	97.20	97.34	4.66	0.49	1.11	1.09	4.59	4.57	4.59	39
長期 (7-)	267	96.54	96.79	8.36	0.91	1.40	1.38	8.03	7.98	8.03	43
長期 (7-11)	267	96.54	96.79	8.36	0.91	1.40	1.38	8.03	7.98	8.03	43
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
電気機器	1,945	97.96	98.10	4.20	0.55	1.08	1.07	4.10	4.08	4.10	39
短期 (1-3)	765	98.85	98.93	2.23	0.38	0.91	0.90	2.22	2.21	2.22	34
中期 (3-7)	935	97.40	97.54	4.67	0.56	1.12	1.11	4.60	4.57	4.60	40
長期 (7-)	245	97.29	97.60	8.59	1.10	1.47	1.45	8.19	8.13	8.19	48
長期 (7-11)	245	97.29	97.60	8.59	1.10	1.47	1.45	8.19	8.13	8.19	48
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
輸送用機器	1,135	97.06	97.16	4.39	0.42	1.08	1.06	4.20	4.17	4.19	37
短期 (1-3)	524	98.82	98.86	1.88	0.22	0.88	0.87	1.88	1.87	1.88	34
中期 (3-7)	402	97.22	97.33	4.62	0.48	1.08	1.07	4.56	4.53	4.56	37
長期 (7-)	209	92.35	92.56	10.24	0.81	1.63	1.56	9.68	9.60	9.67	45
長期 (7-11)	119	96.64	96.83	8.46	0.92	1.39	1.37	8.12	8.07	8.12	41
超長期 (11-)	90	86.69	86.91	12.60	0.67	1.98	1.85	11.97	11.86	11.95	51

出所:NFRC

- 東証 33 業種分類を参考に NFRC で分類

事業債 業種別・ポートフォリオ指標 (3/4) (2024年12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	259	97.27	97.40	4.39	0.66	1.32	1.30	4.28	4.25	4.27	61
短期 (1-3)	70	99.02	99.09	2.04	0.43	0.98	0.97	2.04	2.03	2.04	42
中期 (3-7)	154	96.81	96.96	4.66	0.70	1.42	1.40	4.57	4.54	4.57	69
長期 (7-)	35	95.81	95.99	7.88	0.97	1.58	1.55	7.57	7.51	7.57	65
長期 (7-11)	35	95.81	95.99	7.88	0.97	1.58	1.55	7.57	7.51	7.57	65
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
その他製品	195	94.71	94.83	6.54	0.53	1.26	1.22	6.11	6.07	6.10	38
短期 (1-3)	30	98.80	98.88	1.77	0.41	1.09	1.09	1.76	1.75	1.76	55
中期 (3-7)	120	97.41	97.51	4.94	0.52	1.07	1.06	4.87	4.84	4.87	34
長期 (7-)	45	84.80	85.00	14.02	0.63	2.00	1.84	13.28	13.15	13.26	38
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	45	84.80	85.00	14.02	0.63	2.00	1.84	13.28	13.15	13.26	38
電気・ガス業	12,367	94.38	94.58	8.04	0.83	1.45	1.40	7.03	6.97	7.01	48
短期 (1-3)	2,671	99.19	99.29	2.05	0.48	0.89	0.89	2.04	2.03	2.04	34
中期 (3-7)	4,273	97.66	97.84	4.94	0.74	1.21	1.20	4.83	4.80	4.83	49
長期 (7-)	5,424	89.43	89.69	13.44	1.07	1.97	1.86	11.65	11.53	11.60	56
長期 (7-11)	2,534	96.38	96.64	8.68	1.09	1.57	1.54	8.25	8.19	8.25	57
超長期 (11-)	2,890	83.34	83.59	17.62	1.06	2.38	2.17	15.09	14.92	14.99	56
陸運業	6,630	88.88	89.15	13.75	1.03	1.66	1.53	10.29	10.18	10.16	35
短期 (1-3)	813	100.42	100.65	2.04	0.97	0.82	0.83	2.02	2.01	2.02	28
中期 (3-7)	1,810	99.66	99.93	5.00	1.03	1.06	1.05	4.86	4.84	4.86	34
長期 (7-)	4,007	81.67	81.95	20.09	1.04	2.21	1.97	15.34	15.17	15.10	38
長期 (7-11)	1,049	98.75	99.08	8.74	1.19	1.35	1.34	8.29	8.23	8.28	36
超長期 (11-)	2,958	75.61	75.88	24.11	0.98	2.61	2.26	18.60	18.38	18.26	39
海運業	169	98.52	98.74	4.83	0.92	1.21	1.20	4.67	4.64	4.67	48
短期 (1-3)	20	100.74	100.82	1.53	1.46	0.92	0.93	1.51	1.51	1.51	41
中期 (3-7)	119	98.62	98.85	4.31	0.77	1.17	1.16	4.23	4.21	4.23	48
長期 (7-)	30	96.65	96.91	9.08	1.14	1.56	1.54	8.62	8.56	8.62	53
長期 (7-11)	30	96.65	96.91	9.08	1.14	1.56	1.54	8.62	8.56	8.62	53
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
空運業	315	93.59	93.70	7.80	0.98	1.80	1.73	7.03	6.96	7.02	79
短期 (1-3)	90	99.18	99.28	1.62	0.65	1.17	1.17	1.62	1.61	1.62	64
中期 (3-7)	40	95.61	95.67	4.35	0.36	1.41	1.38	4.31	4.28	4.31	70
長期 (7-)	185	90.43	90.56	11.55	1.28	2.23	2.11	10.54	10.42	10.52	90
長期 (7-11)	85	98.25	98.38	9.18	1.53	1.76	1.75	8.57	8.50	8.57	73
超長期 (11-)	100	83.78	83.90	13.57	1.07	2.70	2.48	12.50	12.34	12.47	107
倉庫・運輸関連業	152	94.78	94.94	6.45	0.61	1.44	1.40	6.12	6.08	6.12	57
短期 (1-3)	18	99.00	99.19	2.78	0.68	1.04	1.03	2.76	2.74	2.76	44
中期 (3-7)	97	95.67	95.80	5.12	0.47	1.37	1.34	5.04	5.01	5.04	62
長期 (7-)	37	90.33	90.56	11.79	0.93	1.84	1.74	10.98	10.88	10.97	50
長期 (7-11)	17	97.35	97.69	9.01	1.18	1.51	1.49	8.54	8.47	8.53	49
超長期 (11-)	20	84.55	84.68	14.08	0.72	2.15	1.98	13.30	13.17	13.28	51
情報・通信業	2,431	96.84	97.10	4.52	0.95	1.61	1.57	4.21	4.17	4.20	88
短期 (1-3)	955	99.01	99.21	2.04	0.76	1.29	1.29	2.02	2.01	2.02	74
中期 (3-7)	1,118	97.05	97.31	4.69	0.94	1.59	1.57	4.57	4.53	4.56	87
長期 (7-)	358	90.37	90.80	10.59	1.50	2.59	2.43	9.38	9.26	9.36	132
長期 (7-11)	240	95.17	95.64	8.84	1.40	2.06	2.00	8.29	8.21	8.29	101
超長期 (11-)	118	80.56	80.90	14.15	1.73	3.87	3.49	12.01	11.80	11.95	208
卸売業	1,297	97.23	97.46	6.25	0.90	1.27	1.25	5.89	5.85	5.88	43
短期 (1-3)	158	99.86	100.04	2.05	0.91	1.00	1.00	2.03	2.02	2.03	45
中期 (3-7)	687	98.77	99.02	4.60	0.84	1.13	1.12	4.50	4.48	4.50	43
長期 (7-)	452	93.96	94.20	10.22	0.99	1.60	1.54	9.54	9.46	9.53	44
長期 (7-11)	307	97.55	97.77	8.52	1.07	1.39	1.38	8.13	8.08	8.13	42
超長期 (11-)	145	86.37	86.66	13.82	0.82	2.09	1.95	12.90	12.77	12.87	51

出所:NFRC

- 東証 33 業種分類を参考に NFRC で分類

事業債 業種別・ポートフォリオ指標 (3/4) (2024年12月末、1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	259	97.27	97.40	4.39	0.66	1.32	1.30	4.28	4.25	4.27	61
短期 (1-3)	70	99.02	99.09	2.04	0.43	0.98	0.97	2.04	2.03	2.04	42
中期 (3-7)	154	96.81	96.96	4.66	0.70	1.42	1.40	4.57	4.54	4.57	69
長期 (7-)	35	95.81	95.99	7.88	0.97	1.58	1.55	7.57	7.51	7.57	65
長期 (7-11)	35	95.81	95.99	7.88	0.97	1.58	1.55	7.57	7.51	7.57	65
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
その他製品	195	94.71	94.83	6.54	0.53	1.26	1.22	6.11	6.07	6.10	38
短期 (1-3)	30	98.80	98.88	1.77	0.41	1.09	1.09	1.76	1.75	1.76	55
中期 (3-7)	120	97.41	97.51	4.94	0.52	1.07	1.06	4.87	4.84	4.87	34
長期 (7-)	45	84.80	85.00	14.02	0.63	2.00	1.84	13.28	13.15	13.26	38
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	45	84.80	85.00	14.02	0.63	2.00	1.84	13.28	13.15	13.26	38
電気・ガス業	12,263	94.34	94.53	8.13	0.84	1.46	1.41	7.11	7.05	7.09	49
短期 (1-3)	2,608	99.16	99.26	2.14	0.49	0.90	0.90	2.13	2.12	2.13	34
中期 (3-7)	4,242	97.59	97.77	5.00	0.74	1.22	1.20	4.89	4.86	4.89	49
長期 (7-)	5,414	89.46	89.71	13.47	1.08	1.97	1.86	11.66	11.55	11.61	56
長期 (7-11)	2,524	96.46	96.72	8.71	1.10	1.57	1.55	8.27	8.21	8.27	57
超長期 (11-)	2,890	83.34	83.59	17.62	1.06	2.38	2.17	15.09	14.92	14.99	56
陸運業	6,622	88.87	89.14	13.79	1.03	1.67	1.53	10.32	10.22	10.19	35
短期 (1-3)	823	100.37	100.60	2.14	0.97	0.83	0.83	2.11	2.11	2.11	28
中期 (3-7)	1,827	99.56	99.83	5.10	1.02	1.06	1.06	4.95	4.93	4.95	34
長期 (7-)	3,972	81.56	81.85	20.21	1.04	2.22	1.98	15.43	15.26	15.19	38
長期 (7-11)	1,044	98.83	99.16	8.89	1.22	1.36	1.35	8.41	8.35	8.41	36
超長期 (11-)	2,928	75.41	75.68	24.24	0.98	2.62	2.27	18.71	18.48	18.36	39
海運業	169	98.52	98.74	4.83	0.92	1.21	1.20	4.67	4.64	4.67	48
短期 (1-3)	20	100.74	100.82	1.53	1.46	0.92	0.93	1.51	1.51	1.51	41
中期 (3-7)	119	98.62	98.85	4.31	0.77	1.17	1.16	4.23	4.21	4.23	48
長期 (7-)	30	96.65	96.91	9.08	1.14	1.56	1.54	8.62	8.56	8.62	53
長期 (7-11)	30	96.65	96.91	9.08	1.14	1.56	1.54	8.62	8.56	8.62	53
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
空運業	315	93.59	93.70	7.80	0.98	1.80	1.73	7.03	6.96	7.02	79
短期 (1-3)	90	99.18	99.28	1.62	0.65	1.17	1.17	1.62	1.61	1.62	64
中期 (3-7)	40	95.61	95.67	4.35	0.36	1.41	1.38	4.31	4.28	4.31	70
長期 (7-)	185	90.43	90.56	11.55	1.28	2.23	2.11	10.54	10.42	10.52	90
長期 (7-11)	85	98.25	98.38	9.18	1.53	1.76	1.75	8.57	8.50	8.57	73
超長期 (11-)	100	83.78	83.90	13.57	1.07	2.70	2.48	12.50	12.34	12.47	107
倉庫・運輸関連業	152	94.78	94.94	6.45	0.61	1.44	1.40	6.12	6.08	6.12	57
短期 (1-3)	18	99.00	99.19	2.78	0.68	1.04	1.03	2.76	2.74	2.76	44
中期 (3-7)	97	95.67	95.80	5.12	0.47	1.37	1.34	5.04	5.01	5.04	62
長期 (7-)	37	90.33	90.56	11.79	0.93	1.84	1.74	10.98	10.88	10.97	50
長期 (7-11)	17	97.35	97.69	9.01	1.18	1.51	1.49	8.54	8.47	8.53	49
超長期 (11-)	20	84.55	84.68	14.08	0.72	2.15	1.98	13.30	13.17	13.28	51
情報・通信業	2,431	96.84	97.10	4.52	0.95	1.61	1.57	4.21	4.17	4.20	88
短期 (1-3)	955	99.01	99.21	2.04	0.76	1.29	1.29	2.02	2.01	2.02	74
中期 (3-7)	1,133	96.99	97.25	4.72	0.94	1.59	1.57	4.59	4.56	4.59	87
長期 (7-)	343	90.27	90.71	10.74	1.54	2.62	2.47	9.49	9.37	9.47	134
長期 (7-11)	225	95.34	95.83	8.96	1.45	2.07	2.01	8.38	8.30	8.38	102
超長期 (11-)	118	80.56	80.90	14.15	1.73	3.87	3.49	12.01	11.80	11.95	208
卸売業	1,317	97.27	97.50	6.26	0.91	1.27	1.25	5.91	5.86	5.90	44
短期 (1-3)	158	99.86	100.04	2.05	0.91	1.00	1.00	2.03	2.02	2.03	45
中期 (3-7)	697	98.79	99.03	4.61	0.84	1.13	1.12	4.51	4.48	4.51	42
長期 (7-)	462	94.09	94.33	10.21	1.01	1.60	1.55	9.53	9.45	9.52	45
長期 (7-11)	317	97.63	97.84	8.56	1.09	1.40	1.39	8.16	8.11	8.16	42
超長期 (11-)	145	86.37	86.66	13.82	0.82	2.09	1.95	12.90	12.77	12.87	51

出所:NFRC

- 東証 33 業種分類を参考に NFRC で分類

事業債 業種別・ポートフォリオ指標 (4/4) (2024年12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	1,025	97.64	97.80	4.43	0.68	1.24	1.23	4.26	4.23	4.26	53
短期 (1-3)	315	98.69	98.77	2.07	0.39	1.03	1.02	2.06	2.05	2.06	47
中期 (3-7)	559	97.89	98.06	4.25	0.69	1.20	1.19	4.18	4.15	4.18	51
長期 (7-)	151	94.53	94.80	10.03	1.28	1.88	1.84	9.34	9.26	9.33	75
長期 (7-11)	111	96.72	97.08	8.80	1.42	1.86	1.83	8.26	8.19	8.26	85
超長期 (11-)	40	88.47	88.50	13.43	0.88	1.97	1.85	12.63	12.51	12.61	44
銀行業	1,415	99.73	99.98	3.49	1.22	1.22	1.22	3.39	3.36	3.39	59
短期 (1-3)	654	100.41	100.68	1.83	1.40	1.12	1.13	1.80	1.79	1.80	59
中期 (3-7)	713	99.20	99.42	4.63	1.05	1.28	1.28	4.51	4.48	4.51	58
長期 (7-)	48	98.19	98.62	9.06	1.32	1.57	1.55	8.52	8.45	8.51	55
長期 (7-11)	48	98.19	98.62	9.06	1.32	1.57	1.55	8.52	8.45	8.51	55
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
証券、商品先物取引業	860	98.98	99.14	2.33	0.77	1.24	1.23	2.30	2.29	2.30	66
短期 (1-3)	626	99.13	99.28	1.80	0.69	1.19	1.19	1.79	1.78	1.79	65
中期 (3-7)	229	98.67	98.85	3.69	0.98	1.36	1.35	3.62	3.60	3.62	70
長期 (7-)	5	94.12	94.41	7.68	0.90	1.77	1.72	7.40	7.34	7.40	84
長期 (7-11)	5	94.12	94.41	7.68	0.90	1.77	1.72	7.40	7.34	7.40	84
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
保険業	330	97.96	98.03	3.24	0.38	1.04	1.03	3.17	3.15	3.17	41
短期 (1-3)	210	98.61	98.65	2.12	0.26	0.94	0.93	2.12	2.11	2.12	38
中期 (3-7)	70	98.21	98.30	3.32	0.48	1.04	1.03	3.30	3.28	3.30	40
長期 (7-)	50	94.86	95.02	7.79	0.75	1.49	1.45	7.56	7.51	7.56	56
長期 (7-11)	50	94.86	95.02	7.79	0.75	1.49	1.45	7.56	7.51	7.56	56
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
その他金融業	6,673	98.06	98.17	3.99	0.56	1.08	1.07	3.88	3.86	3.88	40
短期 (1-3)	2,787	98.96	99.04	1.96	0.38	0.94	0.93	1.95	1.94	1.95	39
中期 (3-7)	3,226	97.69	97.81	4.64	0.61	1.11	1.10	4.56	4.53	4.56	40
長期 (7-)	660	96.06	96.26	9.44	1.10	1.55	1.51	8.88	8.81	8.88	48
長期 (7-11)	582	97.49	97.69	8.85	1.12	1.45	1.44	8.42	8.36	8.42	45
超長期 (11-)	78	85.40	85.56	13.86	0.96	2.34	2.16	12.81	12.67	12.78	73
不動産業	2,661	94.78	94.96	7.33	0.75	1.38	1.33	6.33	6.28	6.31	47
短期 (1-3)	573	99.34	99.50	2.07	0.58	0.96	0.96	2.06	2.05	2.06	40
中期 (3-7)	1,113	97.27	97.43	4.63	0.59	1.19	1.17	4.55	4.52	4.55	47
長期 (7-)	975	89.25	89.48	13.50	1.03	1.89	1.77	11.35	11.24	11.28	51
長期 (7-11)	507	97.04	97.24	8.47	1.06	1.44	1.42	8.09	8.04	8.09	46
超長期 (11-)	468	80.81	81.08	18.94	1.00	2.47	2.22	15.57	15.40	15.41	57
サービス業	899	93.23	93.38	5.33	0.73	1.98	1.86	4.95	4.89	4.94	112
短期 (1-3)	253	97.91	97.97	2.00	0.40	1.51	1.49	1.99	1.98	1.99	94
中期 (3-7)	461	94.68	94.85	5.24	0.72	1.74	1.66	5.09	5.04	5.09	93
長期 (7-)	185	83.22	83.43	10.09	1.22	3.41	3.02	9.30	9.16	9.28	193
長期 (7-11)	135	88.21	88.45	9.19	1.13	2.76	2.52	8.70	8.60	8.70	150
超長期 (11-)	50	69.74	69.88	12.50	1.45	5.65	4.73	11.32	11.07	11.29	341
財投機関債	20,011	95.36	95.57	9.03	0.81	1.20	1.16	7.51	7.45	7.46	19
短期 (1-3)	5,654	99.49	99.61	1.97	0.42	0.71	0.71	1.96	1.96	1.96	17
中期 (3-7)	6,239	99.18	99.37	4.60	0.71	0.88	0.88	4.52	4.50	4.52	18
長期 (7-)	8,117	89.54	89.84	17.35	1.17	1.85	1.74	14.34	14.20	14.22	21
長期 (7-11)	2,443	99.62	99.89	8.89	1.14	1.19	1.19	8.44	8.39	8.43	19
超長期 (11-)	5,674	85.20	85.51	20.99	1.18	2.18	2.01	17.31	17.13	17.13	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12月末、1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	1,025	97.64	97.80	4.43	0.68	1.24	1.23	4.26	4.23	4.26	53
短期 (1-3)	315	98.69	98.77	2.07	0.39	1.03	1.02	2.06	2.05	2.06	47
中期 (3-7)	559	97.89	98.06	4.25	0.69	1.20	1.19	4.18	4.15	4.18	51
長期 (7-)	151	94.53	94.80	10.03	1.28	1.88	1.84	9.34	9.26	9.33	75
長期 (7-11)	111	96.72	97.08	8.80	1.42	1.86	1.83	8.26	8.19	8.26	85
超長期 (11-)	40	88.47	88.50	13.43	0.88	1.97	1.85	12.63	12.51	12.61	44
銀行業	1,355	99.69	99.92	3.59	1.20	1.23	1.23	3.49	3.47	3.49	59
短期 (1-3)	604	100.37	100.60	1.92	1.36	1.13	1.14	1.90	1.89	1.90	59
中期 (3-7)	703	99.20	99.42	4.66	1.06	1.29	1.29	4.53	4.51	4.53	58
長期 (7-)	48	98.19	98.62	9.06	1.32	1.57	1.55	8.52	8.45	8.51	55
長期 (7-11)	48	98.19	98.62	9.06	1.32	1.57	1.55	8.52	8.45	8.51	55
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
証券、商品先物取引業	860	98.98	99.14	2.33	0.77	1.24	1.23	2.30	2.29	2.30	66
短期 (1-3)	626	99.13	99.28	1.80	0.69	1.19	1.19	1.79	1.78	1.79	65
中期 (3-7)	229	98.67	98.85	3.69	0.98	1.36	1.35	3.62	3.60	3.62	70
長期 (7-)	5	94.12	94.41	7.68	0.90	1.77	1.72	7.40	7.34	7.40	84
長期 (7-11)	5	94.12	94.41	7.68	0.90	1.77	1.72	7.40	7.34	7.40	84
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
保険業	335	97.98	98.05	3.26	0.39	1.04	1.03	3.19	3.17	3.19	41
短期 (1-3)	210	98.61	98.65	2.12	0.26	0.94	0.93	2.12	2.11	2.12	38
中期 (3-7)	75	98.29	98.38	3.42	0.51	1.04	1.03	3.39	3.38	3.39	40
長期 (7-)	50	94.86	95.02	7.79	0.75	1.49	1.45	7.56	7.51	7.56	56
長期 (7-11)	50	94.86	95.02	7.79	0.75	1.49	1.45	7.56	7.51	7.56	56
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
その他金融業	6,613	98.05	98.16	4.04	0.57	1.08	1.07	3.92	3.90	3.92	40
短期 (1-3)	2,744	98.94	99.02	2.01	0.39	0.94	0.94	2.00	1.99	2.00	39
中期 (3-7)	3,229	97.68	97.80	4.68	0.62	1.12	1.10	4.59	4.57	4.59	40
長期 (7-)	640	96.15	96.35	9.52	1.12	1.54	1.51	8.94	8.87	8.93	47
長期 (7-11)	562	97.64	97.84	8.91	1.14	1.45	1.43	8.47	8.41	8.47	44
超長期 (11-)	78	85.40	85.56	13.86	0.96	2.34	2.16	12.81	12.67	12.78	73
不動産業	2,651	94.76	94.94	7.35	0.75	1.38	1.33	6.36	6.30	6.33	47
短期 (1-3)	563	99.33	99.48	2.09	0.58	0.96	0.96	2.07	2.06	2.07	41
中期 (3-7)	1,113	97.27	97.43	4.63	0.59	1.19	1.17	4.55	4.52	4.55	47
長期 (7-)	975	89.25	89.48	13.50	1.03	1.89	1.77	11.35	11.24	11.28	51
長期 (7-11)	507	97.04	97.24	8.47	1.06	1.44	1.42	8.09	8.04	8.09	46
超長期 (11-)	468	80.81	81.08	18.94	1.00	2.47	2.22	15.57	15.40	15.41	57
サービス業	889	93.16	93.31	5.37	0.74	1.99	1.88	4.99	4.94	4.99	113
短期 (1-3)	243	97.84	97.91	2.04	0.41	1.54	1.53	2.03	2.02	2.03	97
中期 (3-7)	461	94.68	94.85	5.24	0.72	1.74	1.66	5.09	5.04	5.09	93
長期 (7-)	185	83.22	83.43	10.09	1.22	3.41	3.02	9.30	9.16	9.28	193
長期 (7-11)	135	88.21	88.45	9.19	1.13	2.76	2.52	8.70	8.60	8.70	150
超長期 (11-)	50	69.74	69.88	12.50	1.45	5.65	4.73	11.32	11.07	11.29	341
財投機関債	20,229	95.40	95.61	8.99	0.82	1.20	1.15	7.49	7.43	7.44	19
短期 (1-3)	5,813	99.49	99.60	2.00	0.43	0.72	0.72	1.99	1.99	1.99	17
中期 (3-7)	6,334	99.14	99.33	4.66	0.71	0.89	0.88	4.57	4.55	4.57	18
長期 (7-)	8,082	89.54	89.84	17.42	1.18	1.85	1.74	14.40	14.26	14.27	21
長期 (7-11)	2,403	99.75	100.03	8.96	1.17	1.19	1.19	8.49	8.44	8.48	19
超長期 (11-)	5,679	85.22	85.52	21.00	1.18	2.18	2.01	17.32	17.14	17.14	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 12 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	74,543	95.54	95.73	7.20	0.78	1.31	1.26	6.14	6.09	6.11	41
短期 (1-3)	22,768	99.23	99.35	2.02	0.53	0.93	0.93	2.01	2.00	2.01	38
中期 (3-7)	28,359	98.05	98.22	4.68	0.72	1.14	1.13	4.59	4.56	4.59	42
長期 (7-)	23,416	88.90	89.17	15.28	1.11	1.93	1.81	12.69	12.57	12.59	43
長期 (7-11)	9,890	97.51	97.78	8.70	1.12	1.45	1.43	8.27	8.21	8.27	45
超長期 (11-)	13,526	82.61	82.88	20.10	1.10	2.35	2.14	16.50	16.32	16.33	41
AAA ~ A 格	73,588	95.51	95.70	7.23	0.78	1.30	1.26	6.17	6.12	6.14	41
短期 (1-3)	22,344	99.23	99.35	2.02	0.53	0.93	0.92	2.01	2.00	2.01	38
中期 (3-7)	27,939	98.05	98.22	4.68	0.71	1.13	1.12	4.59	4.56	4.59	42
長期 (7-)	23,305	88.88	89.16	15.30	1.10	1.93	1.81	12.70	12.57	12.60	43
長期 (7-11)	9,838	97.51	97.78	8.70	1.12	1.45	1.43	8.27	8.21	8.27	45
超長期 (11-)	13,467	82.58	82.86	20.12	1.09	2.35	2.14	16.52	16.34	16.34	41
AAA ~ AA 格	52,764	95.12	95.31	7.96	0.76	1.25	1.20	6.63	6.58	6.59	31
短期 (1-3)	15,420	99.32	99.44	2.03	0.48	0.84	0.83	2.02	2.01	2.02	29
中期 (3-7)	19,163	98.38	98.55	4.70	0.69	1.03	1.03	4.61	4.58	4.61	32
長期 (7-)	18,181	88.12	88.38	16.43	1.07	1.90	1.76	13.41	13.28	13.29	33
長期 (7-11)	7,076	97.94	98.19	8.70	1.06	1.33	1.32	8.30	8.24	8.29	34
超長期 (11-)	11,106	81.86	82.14	21.35	1.08	2.32	2.10	17.31	17.12	17.10	32
AAA 格	11,669	96.72	96.82	5.50	0.48	0.98	0.95	4.74	4.71	4.72	22
短期 (1-3)	4,525	99.03	99.08	2.00	0.23	0.74	0.74	1.99	1.98	1.99	19
中期 (3-7)	5,157	98.05	98.16	4.60	0.51	0.93	0.92	4.54	4.51	4.54	23
長期 (7-)	1,987	88.00	88.21	15.80	0.96	1.74	1.61	12.35	12.23	12.21	29
長期 (7-11)	1,185	97.12	97.30	8.65	0.91	1.29	1.28	8.31	8.26	8.31	30
超長期 (11-)	802	74.52	74.77	26.36	1.04	2.61	2.24	20.11	19.87	19.72	28
AA 格	41,095	94.66	94.88	8.66	0.84	1.33	1.28	7.18	7.12	7.14	34
短期 (1-3)	10,895	99.45	99.59	2.05	0.59	0.88	0.88	2.03	2.02	2.03	33
中期 (3-7)	14,006	98.50	98.69	4.73	0.76	1.07	1.06	4.64	4.61	4.64	36
長期 (7-)	16,194	88.13	88.40	16.51	1.09	1.91	1.78	13.55	13.41	13.43	33
長期 (7-11)	5,890	98.11	98.37	8.71	1.09	1.34	1.33	8.29	8.24	8.29	35
超長期 (11-)	10,304	82.43	82.71	20.96	1.09	2.30	2.09	17.12	16.93	16.92	32
A 格	20,824	96.48	96.68	5.39	0.83	1.44	1.41	5.00	4.96	5.00	65
短期 (1-3)	6,925	99.03	99.17	1.99	0.62	1.13	1.12	1.98	1.97	1.98	58
中期 (3-7)	8,776	97.32	97.52	4.64	0.77	1.35	1.33	4.54	4.51	4.54	63
長期 (7-)	5,124	91.61	91.90	11.28	1.21	2.05	1.96	10.26	10.16	10.24	77
長期 (7-11)	2,762	96.42	96.73	8.69	1.25	1.74	1.70	8.20	8.13	8.20	73
超長期 (11-)	2,361	85.99	86.24	14.32	1.15	2.47	2.29	12.96	12.81	12.92	83
BBB 格	955	97.89	98.08	4.32	1.06	1.51	1.49	4.04	4.00	4.03	80
短期 (1-3)	424	99.06	99.22	1.95	0.91	1.31	1.30	1.93	1.91	1.93	76
中期 (3-7)	420	98.00	98.20	4.62	1.06	1.52	1.50	4.50	4.46	4.50	80
長期 (7-)	111	93.03	93.25	12.18	1.57	2.29	2.21	10.78	10.65	10.74	95
長期 (7-11)	52	97.52	97.71	8.71	1.56	1.91	1.89	8.14	8.06	8.14	92
超長期 (11-)	59	89.05	89.31	15.25	1.58	2.65	2.52	13.33	13.16	13.25	98

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12月末、1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	74,773	95.55	95.74	7.22	0.79	1.31	1.27	6.16	6.11	6.13	41
短期 (1-3)	22,932	99.22	99.34	2.06	0.54	0.94	0.94	2.04	2.04	2.04	39
中期 (3-7)	28,514	98.03	98.21	4.72	0.72	1.14	1.13	4.62	4.60	4.62	42
長期 (7-)	23,328	88.91	89.18	15.34	1.11	1.94	1.81	12.73	12.61	12.63	43
長期 (7-11)	9,813	97.59	97.85	8.75	1.13	1.45	1.43	8.31	8.25	8.30	45
超長期 (11-)	13,515	82.61	82.88	20.12	1.10	2.36	2.14	16.52	16.34	16.34	41
AAA~A 格	73,816	95.52	95.71	7.25	0.79	1.31	1.26	6.19	6.14	6.16	41
短期 (1-3)	22,503	99.22	99.34	2.06	0.53	0.93	0.93	2.05	2.04	2.05	38
中期 (3-7)	28,097	98.03	98.21	4.72	0.72	1.13	1.12	4.63	4.60	4.63	42
長期 (7-)	23,217	88.89	89.16	15.35	1.11	1.94	1.81	12.74	12.62	12.64	43
長期 (7-11)	9,761	97.59	97.85	8.75	1.13	1.45	1.43	8.31	8.25	8.31	45
超長期 (11-)	13,456	82.58	82.85	20.15	1.10	2.35	2.14	16.54	16.36	16.36	41
AAA~AA 格	52,709	95.06	95.25	8.06	0.76	1.25	1.20	6.72	6.66	6.68	31
短期 (1-3)	15,153	99.32	99.43	2.06	0.47	0.83	0.83	2.05	2.04	2.05	27
中期 (3-7)	19,194	98.35	98.52	4.76	0.69	1.03	1.02	4.67	4.64	4.67	32
長期 (7-)	18,363	88.11	88.38	16.45	1.08	1.90	1.77	13.44	13.31	13.32	33
長期 (7-11)	7,107	98.00	98.25	8.77	1.08	1.34	1.33	8.35	8.29	8.34	34
超長期 (11-)	11,256	81.87	82.15	21.31	1.08	2.33	2.10	17.29	17.10	17.09	32
AAA 格	11,855	96.77	96.87	5.49	0.48	0.98	0.95	4.73	4.70	4.71	22
短期 (1-3)	4,678	99.05	99.10	2.03	0.25	0.74	0.74	2.02	2.01	2.02	19
中期 (3-7)	5,227	98.03	98.15	4.66	0.51	0.94	0.93	4.59	4.57	4.59	23
長期 (7-)	1,951	87.91	88.12	16.00	0.98	1.76	1.62	12.48	12.36	12.34	30
長期 (7-11)	1,145	97.25	97.44	8.73	0.94	1.30	1.29	8.37	8.32	8.37	31
超長期 (11-)	805	74.62	74.87	26.34	1.05	2.61	2.24	20.09	19.85	19.70	28
AA 格	40,854	94.57	94.78	8.80	0.84	1.33	1.28	7.31	7.25	7.26	33
短期 (1-3)	10,475	99.44	99.58	2.07	0.58	0.87	0.86	2.06	2.05	2.06	31
中期 (3-7)	13,967	98.47	98.66	4.79	0.75	1.07	1.06	4.69	4.67	4.69	35
長期 (7-)	16,412	88.14	88.41	16.51	1.09	1.92	1.79	13.56	13.43	13.44	33
長期 (7-11)	5,962	98.14	98.40	8.77	1.10	1.34	1.33	8.34	8.29	8.34	35
超長期 (11-)	10,451	82.43	82.71	20.92	1.09	2.31	2.09	17.10	16.91	16.90	32
A 格	21,107	96.65	96.85	5.25	0.84	1.44	1.41	4.88	4.84	4.88	66
短期 (1-3)	7,350	99.02	99.17	2.06	0.65	1.16	1.15	2.05	2.03	2.05	60
中期 (3-7)	8,903	97.33	97.53	4.64	0.78	1.36	1.34	4.53	4.50	4.53	64
長期 (7-)	4,854	91.82	92.11	11.19	1.23	2.06	1.97	10.19	10.08	10.17	79
長期 (7-11)	2,654	96.49	96.81	8.70	1.28	1.75	1.71	8.20	8.13	8.20	74
超長期 (11-)	2,200	86.19	86.45	14.19	1.17	2.49	2.31	12.86	12.72	12.83	86
BBB 格	957	97.90	98.09	4.34	1.06	1.51	1.49	4.06	4.02	4.05	80
短期 (1-3)	429	99.04	99.21	1.98	0.91	1.30	1.30	1.96	1.95	1.96	76
中期 (3-7)	417	98.03	98.23	4.67	1.08	1.52	1.51	4.54	4.50	4.53	81
長期 (7-)	111	93.03	93.25	12.18	1.57	2.29	2.21	10.78	10.65	10.74	95
長期 (7-11)	52	97.52	97.71	8.71	1.56	1.91	1.89	8.14	8.06	8.14	92
超長期 (11-)	59	89.05	89.31	15.25	1.58	2.65	2.52	13.33	13.16	13.25	98

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 12 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	51,094	95.00	95.18	8.11	0.76	1.25	1.20	6.75	6.70	6.71	30
短期 (1-3)	14,455	99.33	99.44	2.02	0.46	0.82	0.82	2.01	2.00	2.01	27
中期 (3-7)	18,531	98.37	98.54	4.72	0.68	1.02	1.02	4.63	4.61	4.63	31
長期 (7-)	18,109	88.08	88.35	16.46	1.07	1.90	1.76	13.44	13.31	13.32	33
長期 (7-11)	7,007	97.94	98.19	8.70	1.06	1.33	1.32	8.30	8.24	8.29	34
超長期 (11-)	11,101	81.85	82.13	21.35	1.08	2.32	2.10	17.32	17.13	17.11	31
AAA ~ A 格	70,142	95.35	95.53	7.42	0.77	1.30	1.25	6.31	6.26	6.28	39
短期 (1-3)	20,371	99.23	99.34	2.00	0.48	0.89	0.89	1.99	1.98	1.99	34
中期 (3-7)	26,750	98.05	98.22	4.71	0.70	1.12	1.10	4.62	4.59	4.62	40
長期 (7-)	23,021	88.77	89.04	15.35	1.09	1.93	1.80	12.74	12.62	12.64	42
長期 (7-11)	9,672	97.51	97.78	8.70	1.11	1.44	1.42	8.27	8.22	8.27	44
超長期 (11-)	13,349	82.44	82.71	20.17	1.08	2.35	2.13	16.57	16.39	16.39	40
AAA ~ BBB 格	70,593	95.36	95.54	7.39	0.77	1.30	1.25	6.29	6.24	6.26	39
短期 (1-3)	20,594	99.22	99.34	2.00	0.49	0.89	0.89	1.99	1.98	1.99	34
中期 (3-7)	26,948	98.04	98.21	4.71	0.70	1.12	1.11	4.61	4.59	4.61	40
長期 (7-)	23,051	88.77	89.04	15.35	1.09	1.93	1.80	12.74	12.62	12.64	42
長期 (7-11)	9,682	97.51	97.77	8.70	1.11	1.44	1.42	8.27	8.22	8.27	44
超長期 (11-)	13,369	82.44	82.71	20.16	1.08	2.35	2.13	16.57	16.38	16.39	40
AAA ~ BB 格	70,593	95.36	95.54	7.39	0.77	1.30	1.25	6.29	6.24	6.26	39
短期 (1-3)	20,594	99.22	99.34	2.00	0.49	0.89	0.89	1.99	1.98	1.99	34
中期 (3-7)	26,948	98.04	98.21	4.71	0.70	1.12	1.11	4.61	4.59	4.61	40
長期 (7-)	23,051	88.77	89.04	15.35	1.09	1.93	1.80	12.74	12.62	12.64	42
長期 (7-11)	9,682	97.51	97.77	8.70	1.11	1.44	1.42	8.27	8.22	8.27	44
超長期 (11-)	13,369	82.44	82.71	20.16	1.08	2.35	2.13	16.57	16.38	16.39	40
AAA 格	11,669	96.72	96.82	5.50	0.48	0.98	0.95	4.74	4.71	4.72	22
短期 (1-3)	4,525	99.03	99.08	2.00	0.23	0.74	0.74	1.99	1.98	1.99	19
中期 (3-7)	5,157	98.05	98.16	4.60	0.51	0.93	0.92	4.54	4.51	4.54	23
長期 (7-)	1,987	88.00	88.21	15.80	0.96	1.74	1.61	12.35	12.23	12.21	29
長期 (7-11)	1,185	97.12	97.30	8.65	0.91	1.29	1.28	8.31	8.26	8.31	30
超長期 (11-)	802	74.52	74.77	26.36	1.04	2.61	2.24	20.11	19.87	19.72	28
AA 格	39,425	94.49	94.70	8.89	0.84	1.33	1.28	7.36	7.30	7.32	33
短期 (1-3)	9,931	99.47	99.60	2.03	0.57	0.85	0.85	2.01	2.00	2.01	30
中期 (3-7)	13,373	98.50	98.69	4.76	0.75	1.06	1.05	4.67	4.64	4.67	35
長期 (7-)	16,121	88.09	88.36	16.54	1.09	1.92	1.78	13.57	13.44	13.45	33
長期 (7-11)	5,822	98.11	98.37	8.71	1.09	1.34	1.32	8.30	8.24	8.29	35
超長期 (11-)	10,299	82.42	82.70	20.96	1.09	2.30	2.09	17.12	16.93	16.92	32
A 格	19,048	96.29	96.48	5.54	0.79	1.42	1.38	5.14	5.10	5.13	61
短期 (1-3)	5,916	98.99	99.11	1.97	0.53	1.07	1.06	1.95	1.94	1.95	52
中期 (3-7)	8,220	97.31	97.49	4.69	0.75	1.32	1.30	4.58	4.55	4.58	60
長期 (7-)	4,913	91.33	91.60	11.28	1.16	2.04	1.94	10.27	10.17	10.26	75
長期 (7-11)	2,665	96.38	96.68	8.69	1.23	1.72	1.68	8.21	8.14	8.21	71
超長期 (11-)	2,248	85.34	85.58	14.34	1.08	2.46	2.28	13.04	12.89	13.00	81
BBB 格	451	97.09	97.30	3.76	0.79	1.42	1.40	3.58	3.55	3.58	75
短期 (1-3)	223	98.61	98.79	2.00	0.80	1.30	1.29	1.98	1.97	1.98	75
中期 (3-7)	198	96.98	97.22	4.48	0.76	1.46	1.43	4.39	4.35	4.39	74
長期 (7-)	30	86.43	86.80	12.08	0.88	2.26	2.10	11.11	10.99	11.09	83
長期 (7-11)	10	93.87	94.20	7.57	0.77	1.69	1.64	7.34	7.28	7.34	76
超長期 (11-)	20	82.70	83.10	14.33	0.93	2.58	2.36	13.25	13.10	13.22	87
BB 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
B 格以下	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
格付なし	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

出所:NFRC

- 格付は、格付会社 4 社の最高格付をもとに NFRC で分類

事業債 最高格付別・ポートフォリオ指標 (2024年12月末、1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	51,916	95.00	95.19	8.13	0.76	1.25	1.21	6.78	6.72	6.74	30
短期 (1-3)	14,642	99.32	99.42	2.05	0.46	0.82	0.82	2.04	2.03	2.04	27
中期 (3-7)	18,933	98.35	98.51	4.76	0.68	1.03	1.02	4.67	4.65	4.67	31
長期 (7-)	18,341	88.10	88.37	16.46	1.08	1.90	1.77	13.45	13.32	13.33	33
長期 (7-11)	7,089	98.00	98.25	8.77	1.08	1.34	1.32	8.35	8.30	8.35	34
超長期 (11-)	11,252	81.87	82.15	21.31	1.08	2.33	2.10	17.30	17.11	17.09	32
AAA~A 格	70,141	95.35	95.53	7.44	0.77	1.30	1.25	6.34	6.29	6.31	39
短期 (1-3)	20,350	99.22	99.33	2.04	0.48	0.89	0.89	2.03	2.02	2.03	34
中期 (3-7)	26,875	98.02	98.20	4.75	0.70	1.12	1.11	4.65	4.63	4.65	40
長期 (7-)	22,916	88.77	89.04	15.41	1.10	1.93	1.81	12.78	12.66	12.68	42
長期 (7-11)	9,592	97.59	97.85	8.75	1.12	1.44	1.42	8.31	8.25	8.31	44
超長期 (11-)	13,324	82.42	82.69	20.20	1.08	2.35	2.13	16.59	16.41	16.41	40
AAA~BBB 格	70,594	95.36	95.54	7.42	0.77	1.30	1.25	6.32	6.27	6.29	39
短期 (1-3)	20,579	99.21	99.32	2.04	0.49	0.90	0.89	2.03	2.02	2.03	34
中期 (3-7)	27,070	98.02	98.19	4.75	0.70	1.12	1.11	4.65	4.63	4.65	40
長期 (7-)	22,946	88.76	89.03	15.40	1.10	1.93	1.81	12.78	12.65	12.68	42
長期 (7-11)	9,602	97.59	97.85	8.75	1.12	1.44	1.42	8.31	8.25	8.31	44
超長期 (11-)	13,344	82.42	82.69	20.19	1.08	2.35	2.13	16.58	16.40	16.40	40
AAA~BB 格	70,594	95.36	95.54	7.42	0.77	1.30	1.25	6.32	6.27	6.29	39
短期 (1-3)	20,579	99.21	99.32	2.04	0.49	0.90	0.89	2.03	2.02	2.03	34
中期 (3-7)	27,070	98.02	98.19	4.75	0.70	1.12	1.11	4.65	4.63	4.65	40
長期 (7-)	22,946	88.76	89.03	15.40	1.10	1.93	1.81	12.78	12.65	12.68	42
長期 (7-11)	9,602	97.59	97.85	8.75	1.12	1.44	1.42	8.31	8.25	8.31	44
超長期 (11-)	13,344	82.42	82.69	20.19	1.08	2.35	2.13	16.58	16.40	16.40	40
AAA 格	11,855	96.77	96.87	5.49	0.48	0.98	0.95	4.73	4.70	4.71	22
短期 (1-3)	4,678	99.05	99.10	2.03	0.25	0.74	0.74	2.02	2.01	2.02	19
中期 (3-7)	5,227	98.03	98.15	4.66	0.51	0.94	0.93	4.59	4.57	4.59	23
長期 (7-)	1,951	87.91	88.12	16.00	0.98	1.76	1.62	12.48	12.36	12.34	30
長期 (7-11)	1,145	97.25	97.44	8.73	0.94	1.30	1.29	8.37	8.32	8.37	31
超長期 (11-)	805	74.62	74.87	26.34	1.05	2.61	2.24	20.09	19.85	19.70	28
AA 格	40,060	94.48	94.69	8.91	0.84	1.34	1.28	7.39	7.33	7.35	33
短期 (1-3)	9,964	99.44	99.57	2.06	0.56	0.86	0.85	2.05	2.04	2.05	30
中期 (3-7)	13,706	98.46	98.65	4.80	0.75	1.06	1.06	4.70	4.68	4.70	35
長期 (7-)	16,390	88.13	88.40	16.52	1.09	1.92	1.79	13.57	13.43	13.45	33
長期 (7-11)	5,944	98.14	98.40	8.77	1.10	1.34	1.33	8.35	8.29	8.34	35
超長期 (11-)	10,446	82.42	82.71	20.93	1.09	2.31	2.09	17.10	16.91	16.91	32
A 格	18,226	96.33	96.52	5.49	0.79	1.42	1.39	5.10	5.06	5.10	62
短期 (1-3)	5,709	98.97	99.09	2.02	0.54	1.08	1.08	2.01	1.99	2.01	53
中期 (3-7)	7,942	97.26	97.44	4.71	0.75	1.33	1.31	4.61	4.58	4.61	61
長期 (7-)	4,575	91.43	91.71	11.16	1.18	2.05	1.95	10.20	10.10	10.18	77
長期 (7-11)	2,503	96.42	96.73	8.69	1.25	1.73	1.69	8.21	8.14	8.20	72
超長期 (11-)	2,072	85.40	85.65	14.15	1.08	2.48	2.29	12.91	12.77	12.88	84
BBB 格	453	97.11	97.33	3.80	0.80	1.42	1.40	3.62	3.59	3.62	75
短期 (1-3)	228	98.59	98.78	2.06	0.80	1.29	1.28	2.04	2.03	2.04	74
中期 (3-7)	195	97.03	97.26	4.57	0.80	1.47	1.45	4.47	4.44	4.47	75
長期 (7-)	30	86.43	86.80	12.08	0.88	2.26	2.10	11.11	10.99	11.09	83
長期 (7-11)	10	93.87	94.20	7.57	0.77	1.69	1.64	7.34	7.28	7.34	76
超長期 (11-)	20	82.70	83.10	14.33	0.93	2.58	2.36	13.25	13.10	13.22	87
BB 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
B 格以下	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
格付なし	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

出所:NFRC

- 格付は、格付会社4社の最高格付をもとにNFRCで分類

事業債 最低格付別・ポートフォリオ指標 (2024 年 12 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	12,053	95.00	95.15	7.07	0.66	1.22	1.17	5.84	5.79	5.81	35
短期 (1-3)	3,801	99.19	99.28	2.04	0.45	0.86	0.86	2.03	2.02	2.03	31
中期 (3-7)	4,947	98.00	98.15	4.59	0.63	1.08	1.07	4.52	4.49	4.52	37
長期 (7-)	3,306	85.70	85.91	16.56	0.94	1.94	1.77	13.16	13.03	13.02	38
長期 (7-11)	1,450	96.78	97.00	8.65	0.95	1.38	1.36	8.29	8.23	8.29	39
超長期 (11-)	1,856	77.05	77.25	22.73	0.93	2.48	2.18	17.94	17.74	17.67	36
AAA ~ A 格	68,069	95.34	95.52	7.43	0.76	1.29	1.24	6.31	6.26	6.28	38
短期 (1-3)	20,038	99.24	99.35	2.00	0.48	0.89	0.88	1.99	1.98	1.99	34
中期 (3-7)	25,651	98.02	98.19	4.71	0.69	1.10	1.09	4.62	4.60	4.62	39
長期 (7-)	22,380	88.76	89.03	15.39	1.09	1.93	1.80	12.76	12.63	12.66	42
長期 (7-11)	9,387	97.54	97.81	8.70	1.11	1.44	1.42	8.28	8.22	8.27	44
超長期 (11-)	12,993	82.42	82.70	20.22	1.08	2.34	2.13	16.59	16.41	16.41	40
AAA ~ BBB 格	70,353	95.34	95.53	7.40	0.76	1.29	1.25	6.30	6.25	6.27	39
短期 (1-3)	20,594	99.22	99.34	2.00	0.49	0.89	0.89	1.99	1.98	1.99	34
中期 (3-7)	26,733	98.02	98.19	4.71	0.69	1.11	1.10	4.62	4.59	4.62	40
長期 (7-)	23,026	88.76	89.03	15.35	1.09	1.93	1.80	12.74	12.62	12.64	42
長期 (7-11)	9,682	97.51	97.77	8.70	1.11	1.44	1.42	8.27	8.22	8.27	44
超長期 (11-)	13,344	82.42	82.69	20.17	1.08	2.35	2.13	16.57	16.39	16.39	40
AAA ~ BB 格	70,593	95.36	95.54	7.39	0.77	1.30	1.25	6.29	6.24	6.26	39
短期 (1-3)	20,594	99.22	99.34	2.00	0.49	0.89	0.89	1.99	1.98	1.99	34
中期 (3-7)	26,948	98.04	98.21	4.71	0.70	1.12	1.11	4.61	4.59	4.61	40
長期 (7-)	23,051	88.77	89.04	15.35	1.09	1.93	1.80	12.74	12.62	12.64	42
長期 (7-11)	9,682	97.51	97.77	8.70	1.11	1.44	1.42	8.27	8.22	8.27	44
超長期 (11-)	13,369	82.44	82.71	20.16	1.08	2.35	2.13	16.57	16.38	16.39	40
AAA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA 格	12,053	95.00	95.15	7.07	0.66	1.22	1.17	5.84	5.79	5.81	35
短期 (1-3)	3,801	99.19	99.28	2.04	0.45	0.86	0.86	2.03	2.02	2.03	31
中期 (3-7)	4,947	98.00	98.15	4.59	0.63	1.08	1.07	4.52	4.49	4.52	37
長期 (7-)	3,306	85.70	85.91	16.56	0.94	1.94	1.77	13.16	13.03	13.02	38
長期 (7-11)	1,450	96.78	97.00	8.65	0.95	1.38	1.36	8.29	8.23	8.29	39
超長期 (11-)	1,856	77.05	77.25	22.73	0.93	2.48	2.18	17.94	17.74	17.67	36
A 格	56,015	95.41	95.60	7.50	0.78	1.30	1.26	6.41	6.36	6.38	39
短期 (1-3)	16,237	99.25	99.37	1.99	0.49	0.89	0.89	1.98	1.97	1.98	34
中期 (3-7)	20,705	98.03	98.21	4.74	0.70	1.11	1.10	4.65	4.62	4.65	39
長期 (7-)	19,074	89.29	89.57	15.19	1.12	1.92	1.80	12.69	12.57	12.60	42
長期 (7-11)	7,937	97.68	97.95	8.71	1.14	1.44	1.43	8.28	8.22	8.27	45
超長期 (11-)	11,137	83.32	83.60	19.80	1.10	2.32	2.12	16.38	16.20	16.21	40
BBB 格	2,285	95.47	95.65	6.59	0.79	1.43	1.38	5.87	5.82	5.86	56
短期 (1-3)	556	98.63	98.74	2.01	0.57	1.18	1.18	1.99	1.98	1.99	63
中期 (3-7)	1,082	97.83	98.02	4.60	0.76	1.25	1.24	4.50	4.48	4.50	54
長期 (7-)	647	88.80	89.05	13.86	1.02	1.97	1.85	12.09	11.97	12.04	51
長期 (7-11)	295	96.46	96.71	8.48	0.98	1.46	1.44	8.12	8.06	8.11	48
超長期 (11-)	352	82.37	82.62	18.37	1.06	2.47	2.25	15.99	15.81	15.89	54
BB 格	240	100.03	100.49	5.41	2.26	2.10	2.09	4.90	4.84	4.89	133
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	215	100.93	101.42	4.25	2.25	1.99	2.00	4.05	4.01	4.05	132
長期 (7-)	25	92.30	92.50	15.41	2.37	3.11	2.99	12.85	12.66	12.77	146
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	25	92.30	92.50	15.41	2.37	3.11	2.99	12.85	12.66	12.77	146
B 格以下	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
格付なし	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

出所:NFRC

- 格付は、格付会社 4 社の最低格付をもとに NFRC で分類

事業債 最低格付別・ポートフォリオ指標 (2024年12月末、1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	12,082	95.01	95.16	7.08	0.66	1.22	1.17	5.86	5.81	5.82	35
短期(1-3)	3,808	99.17	99.26	2.06	0.45	0.86	0.86	2.05	2.04	2.05	31
中期(3-7)	4,955	98.02	98.16	4.61	0.63	1.08	1.07	4.53	4.51	4.53	37
長期(7-)	3,319	85.76	85.97	16.54	0.94	1.93	1.77	13.15	13.02	13.01	37
長期(7-11)	1,460	96.80	97.02	8.66	0.96	1.38	1.36	8.30	8.24	8.29	39
超長期(11-)	1,859	77.09	77.29	22.73	0.94	2.48	2.18	17.94	17.73	17.67	36
AAA~A格	68,068	95.34	95.52	7.46	0.76	1.29	1.25	6.34	6.29	6.31	38
短期(1-3)	20,018	99.23	99.34	2.04	0.48	0.89	0.89	2.03	2.02	2.03	34
中期(3-7)	25,766	98.00	98.17	4.75	0.69	1.11	1.10	4.66	4.64	4.66	39
長期(7-)	22,284	88.76	89.03	15.44	1.10	1.93	1.80	12.80	12.67	12.70	42
長期(7-11)	9,317	97.62	97.88	8.75	1.13	1.44	1.42	8.32	8.26	8.31	44
超長期(11-)	12,967	82.40	82.68	20.25	1.08	2.35	2.13	16.61	16.43	16.43	40
AAA~BBB格	70,354	95.34	95.53	7.43	0.76	1.29	1.25	6.32	6.27	6.29	39
短期(1-3)	20,579	99.21	99.32	2.04	0.49	0.90	0.89	2.03	2.02	2.03	34
中期(3-7)	26,855	97.99	98.16	4.75	0.69	1.11	1.10	4.66	4.63	4.66	40
長期(7-)	22,921	88.76	89.03	15.40	1.10	1.93	1.80	12.78	12.65	12.68	42
長期(7-11)	9,602	97.59	97.85	8.75	1.12	1.44	1.42	8.31	8.25	8.31	44
超長期(11-)	13,319	82.40	82.67	20.20	1.08	2.35	2.13	16.59	16.41	16.41	40
AAA~BB格	70,594	95.36	95.54	7.42	0.77	1.30	1.25	6.32	6.27	6.29	39
短期(1-3)	20,579	99.21	99.32	2.04	0.49	0.90	0.89	2.03	2.02	2.03	34
中期(3-7)	27,070	98.02	98.19	4.75	0.70	1.12	1.11	4.65	4.63	4.65	40
長期(7-)	22,946	88.76	89.03	15.40	1.10	1.93	1.81	12.78	12.65	12.68	42
長期(7-11)	9,602	97.59	97.85	8.75	1.12	1.44	1.42	8.31	8.25	8.31	44
超長期(11-)	13,344	82.42	82.69	20.19	1.08	2.35	2.13	16.58	16.40	16.40	40
AAA格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA格	12,082	95.01	95.16	7.08	0.66	1.22	1.17	5.86	5.81	5.82	35
短期(1-3)	3,808	99.17	99.26	2.06	0.45	0.86	0.86	2.05	2.04	2.05	31
中期(3-7)	4,955	98.02	98.16	4.61	0.63	1.08	1.07	4.53	4.51	4.53	37
長期(7-)	3,319	85.76	85.97	16.54	0.94	1.93	1.77	13.15	13.02	13.01	37
長期(7-11)	1,460	96.80	97.02	8.66	0.96	1.38	1.36	8.30	8.24	8.29	39
超長期(11-)	1,859	77.09	77.29	22.73	0.94	2.48	2.18	17.94	17.73	17.67	36
A格	55,986	95.41	95.60	7.54	0.79	1.31	1.26	6.44	6.39	6.41	39
短期(1-3)	16,210	99.24	99.36	2.04	0.49	0.89	0.89	2.02	2.02	2.02	34
中期(3-7)	20,812	98.00	98.17	4.79	0.70	1.11	1.10	4.69	4.67	4.69	39
長期(7-)	18,965	89.29	89.57	15.25	1.13	1.93	1.81	12.74	12.61	12.64	42
長期(7-11)	7,857	97.77	98.04	8.77	1.16	1.45	1.43	8.32	8.26	8.32	45
超長期(11-)	11,108	83.29	83.58	19.83	1.11	2.33	2.12	16.40	16.22	16.23	40
BBB格	2,287	95.47	95.66	6.60	0.79	1.43	1.38	5.88	5.83	5.86	56
短期(1-3)	561	98.62	98.73	2.03	0.57	1.18	1.18	2.02	2.00	2.02	63
中期(3-7)	1,089	97.82	98.00	4.64	0.76	1.26	1.24	4.54	4.51	4.54	54
長期(7-)	637	88.70	88.95	13.97	1.03	1.98	1.86	12.18	12.06	12.12	51
長期(7-11)	285	96.51	96.76	8.53	0.99	1.47	1.45	8.16	8.10	8.15	48
超長期(11-)	352	82.37	82.62	18.37	1.06	2.47	2.25	15.99	15.81	15.89	54
BB格	240	100.03	100.49	5.41	2.26	2.10	2.09	4.90	4.84	4.89	133
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	215	100.93	101.42	4.25	2.25	1.99	2.00	4.05	4.01	4.05	132
長期(7-)	25	92.30	92.50	15.41	2.37	3.11	2.99	12.85	12.66	12.77	146
長期(7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期(11-)	25	92.30	92.50	15.41	2.37	3.11	2.99	12.85	12.66	12.77	146
B格以下	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
格付なし	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

出所:NFRC

- 格付は、格付会社4社の最低格付をもとにNFRCで分類

事業債 R&I 格付別・ポートフォリオ指標 (2024年12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	41,934	94.87	95.07	8.55	0.79	1.25	1.20	7.01	6.95	6.97	28
短期 (1-3)	11,674	99.41	99.52	2.01	0.47	0.79	0.79	2.00	1.99	2.00	24
中期 (3-7)	14,567	98.73	98.91	4.67	0.72	0.99	0.98	4.58	4.56	4.58	28
長期 (7-)	15,694	87.91	88.19	17.02	1.10	1.90	1.76	13.75	13.61	13.61	30
長期 (7-11)	5,893	98.31	98.56	8.77	1.09	1.31	1.30	8.35	8.30	8.35	31
超長期 (11-)	9,801	81.66	81.96	21.97	1.11	2.33	2.10	17.65	17.45	17.42	29
AAA~A 格	64,326	95.26	95.45	7.62	0.77	1.28	1.24	6.44	6.39	6.41	36
短期 (1-3)	18,484	99.27	99.39	1.99	0.47	0.86	0.86	1.98	1.97	1.98	31
中期 (3-7)	23,957	98.21	98.39	4.70	0.70	1.08	1.07	4.61	4.58	4.61	37
長期 (7-)	21,885	88.64	88.91	15.58	1.09	1.93	1.80	12.88	12.76	12.78	41
長期 (7-11)	9,048	97.52	97.78	8.71	1.09	1.42	1.40	8.29	8.23	8.29	42
超長期 (11-)	12,837	82.37	82.66	20.42	1.09	2.35	2.13	16.71	16.53	16.53	39
AAA~BBB 格	64,856	95.27	95.46	7.59	0.77	1.29	1.24	6.42	6.37	6.39	37
短期 (1-3)	18,701	99.26	99.37	1.99	0.47	0.87	0.87	1.98	1.97	1.98	32
中期 (3-7)	24,240	98.19	98.37	4.69	0.70	1.09	1.08	4.60	4.58	4.60	38
長期 (7-)	21,915	88.63	88.91	15.57	1.09	1.93	1.80	12.88	12.75	12.78	41
長期 (7-11)	9,058	97.52	97.78	8.71	1.09	1.42	1.40	8.29	8.23	8.29	43
超長期 (11-)	12,857	82.38	82.66	20.41	1.09	2.35	2.13	16.71	16.52	16.52	39
AAA~BB 格	64,856	95.27	95.46	7.59	0.77	1.29	1.24	6.42	6.37	6.39	37
短期 (1-3)	18,701	99.26	99.37	1.99	0.47	0.87	0.87	1.98	1.97	1.98	32
中期 (3-7)	24,240	98.19	98.37	4.69	0.70	1.09	1.08	4.60	4.58	4.60	38
長期 (7-)	21,915	88.63	88.91	15.57	1.09	1.93	1.80	12.88	12.75	12.78	41
長期 (7-11)	9,058	97.52	97.78	8.71	1.09	1.42	1.40	8.29	8.23	8.29	43
超長期 (11-)	12,857	82.38	82.66	20.41	1.09	2.35	2.13	16.71	16.52	16.52	39
AAA 格	955	97.92	97.99	3.62	0.35	0.91	0.90	3.53	3.51	3.52	25
短期 (1-3)	485	98.96	99.00	1.93	0.22	0.79	0.78	1.92	1.91	1.92	24
中期 (3-7)	370	97.85	97.94	4.32	0.46	0.96	0.95	4.26	4.24	4.26	26
長期 (7-)	100	93.20	93.24	9.22	0.57	1.36	1.32	8.92	8.86	8.92	29
長期 (7-11)	70	95.52	95.57	8.13	0.62	1.23	1.21	7.93	7.89	7.93	28
超長期 (11-)	30	87.77	87.81	11.76	0.45	1.70	1.59	11.43	11.34	11.43	32
AA 格	40,979	94.80	95.00	8.67	0.80	1.26	1.20	7.10	7.04	7.05	28
短期 (1-3)	11,189	99.43	99.55	2.01	0.48	0.79	0.79	2.00	1.99	2.00	24
中期 (3-7)	14,197	98.75	98.94	4.68	0.72	0.99	0.98	4.59	4.57	4.59	28
長期 (7-)	15,594	87.88	88.16	17.07	1.10	1.90	1.77	13.78	13.64	13.64	30
長期 (7-11)	5,823	98.34	98.60	8.78	1.09	1.31	1.30	8.35	8.30	8.35	31
超長期 (11-)	9,771	81.64	81.94	22.01	1.11	2.33	2.10	17.67	17.47	17.44	29
A 格	22,391	95.98	96.16	5.88	0.72	1.35	1.32	5.39	5.35	5.38	53
短期 (1-3)	6,810	99.04	99.15	1.95	0.47	0.98	0.98	1.94	1.93	1.94	43
中期 (3-7)	9,390	97.40	97.57	4.73	0.68	1.23	1.22	4.64	4.61	4.64	51
長期 (7-)	6,191	90.47	90.72	11.94	1.07	1.99	1.89	10.76	10.65	10.73	67
長期 (7-11)	3,155	96.05	96.32	8.61	1.11	1.64	1.61	8.19	8.12	8.18	64
超長期 (11-)	3,036	84.67	84.91	15.40	1.04	2.40	2.22	13.80	13.64	13.74	70
BBB 格	530	96.67	96.88	3.95	0.86	1.73	1.70	3.77	3.74	3.77	104
短期 (1-3)	217	98.23	98.38	2.06	0.81	1.76	1.75	2.04	2.02	2.04	119
中期 (3-7)	283	96.56	96.80	4.54	0.90	1.66	1.63	4.42	4.39	4.42	93
長期 (7-)	30	86.43	86.80	12.08	0.88	2.26	2.10	11.11	10.99	11.09	83
長期 (7-11)	10	93.87	94.20	7.57	0.77	1.69	1.64	7.34	7.28	7.34	76
超長期 (11-)	20	82.70	83.10	14.33	0.93	2.58	2.36	13.25	13.10	13.22	87
BB 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
B 格以下	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
格付なし	5,737	96.34	96.49	5.15	0.74	1.40	1.36	4.85	4.81	4.85	62
短期 (1-3)	1,893	98.85	98.97	2.13	0.62	1.13	1.12	2.11	2.10	2.11	57
中期 (3-7)	2,708	96.68	96.82	4.82	0.68	1.37	1.34	4.71	4.68	4.71	64
長期 (7-)	1,136	91.37	91.58	10.98	1.10	1.96	1.84	10.11	10.01	10.10	68
長期 (7-11)	624	97.42	97.68	8.48	1.30	1.66	1.61	8.01	7.94	8.00	66
超長期 (11-)	512	83.99	84.15	14.03	0.85	2.39	2.17	13.08	12.94	13.05	72

出所:NFRC

- 格付は、R&Iの格付をもとに NFRC で分類

事業債 R&I 格付別・ポートフォリオ指標 (2024年12月末、1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	42,013	94.88	95.08	8.57	0.79	1.25	1.20	7.03	6.97	6.98	28
短期 (1-3)	11,729	99.40	99.51	2.05	0.47	0.79	0.79	2.04	2.03	2.04	24
中期 (3-7)	14,655	98.71	98.89	4.72	0.72	0.99	0.99	4.63	4.60	4.63	28
長期 (7-)	15,628	87.90	88.18	17.07	1.11	1.90	1.77	13.79	13.65	13.65	30
長期 (7-11)	5,853	98.37	98.63	8.82	1.10	1.31	1.30	8.39	8.34	8.39	31
超長期 (11-)	9,776	81.63	81.93	22.01	1.11	2.33	2.10	17.68	17.48	17.45	29
AAA~A 格	64,275	95.25	95.44	7.65	0.77	1.29	1.24	6.48	6.42	6.44	36
短期 (1-3)	18,437	99.26	99.37	2.03	0.47	0.86	0.86	2.02	2.01	2.02	31
中期 (3-7)	24,059	98.18	98.36	4.74	0.70	1.09	1.08	4.65	4.62	4.65	37
長期 (7-)	21,780	88.63	88.90	15.64	1.10	1.93	1.80	12.93	12.80	12.82	40
長期 (7-11)	8,968	97.60	97.86	8.76	1.11	1.42	1.41	8.33	8.28	8.33	42
超長期 (11-)	12,812	82.35	82.63	20.45	1.09	2.35	2.13	16.73	16.55	16.55	39
AAA~BBB 格	64,805	95.27	95.46	7.62	0.77	1.29	1.24	6.45	6.40	6.42	37
短期 (1-3)	18,664	99.25	99.36	2.03	0.47	0.87	0.87	2.02	2.01	2.02	32
中期 (3-7)	24,332	98.16	98.34	4.74	0.71	1.09	1.08	4.65	4.62	4.64	38
長期 (7-)	21,810	88.63	88.90	15.63	1.10	1.93	1.80	12.92	12.80	12.82	41
長期 (7-11)	8,978	97.60	97.86	8.76	1.11	1.42	1.41	8.33	8.27	8.33	42
超長期 (11-)	12,832	82.35	82.63	20.44	1.09	2.35	2.13	16.73	16.54	16.54	39
AAA~BB 格	64,805	95.27	95.46	7.62	0.77	1.29	1.24	6.45	6.40	6.42	37
短期 (1-3)	18,664	99.25	99.36	2.03	0.47	0.87	0.87	2.02	2.01	2.02	32
中期 (3-7)	24,332	98.16	98.34	4.74	0.71	1.09	1.08	4.65	4.62	4.64	38
長期 (7-)	21,810	88.63	88.90	15.63	1.10	1.93	1.80	12.92	12.80	12.82	41
長期 (7-11)	8,978	97.60	97.86	8.76	1.11	1.42	1.41	8.33	8.27	8.33	42
超長期 (11-)	12,832	82.35	82.63	20.44	1.09	2.35	2.13	16.73	16.54	16.54	39
AAA 格	955	97.92	97.99	3.62	0.35	0.91	0.90	3.53	3.51	3.52	25
短期 (1-3)	485	98.96	99.00	1.93	0.22	0.79	0.78	1.92	1.91	1.92	24
中期 (3-7)	370	97.85	97.94	4.32	0.46	0.96	0.95	4.26	4.24	4.26	26
長期 (7-)	100	93.20	93.24	9.22	0.57	1.36	1.32	8.92	8.86	8.92	29
長期 (7-11)	70	95.52	95.57	8.13	0.62	1.23	1.21	7.93	7.89	7.93	28
超長期 (11-)	30	87.77	87.81	11.76	0.45	1.70	1.59	11.43	11.34	11.43	32
AA 格	41,058	94.81	95.01	8.68	0.80	1.26	1.21	7.11	7.06	7.07	28
短期 (1-3)	11,244	99.42	99.53	2.05	0.48	0.79	0.79	2.04	2.03	2.04	24
中期 (3-7)	14,285	98.73	98.91	4.73	0.73	0.99	0.99	4.64	4.61	4.64	28
長期 (7-)	15,528	87.87	88.15	17.12	1.11	1.91	1.77	13.82	13.69	13.69	30
長期 (7-11)	5,783	98.41	98.67	8.83	1.11	1.31	1.30	8.40	8.34	8.39	31
超長期 (11-)	9,746	81.61	81.91	22.04	1.11	2.33	2.11	17.70	17.50	17.47	29
A 格	22,262	95.96	96.13	5.93	0.73	1.35	1.32	5.44	5.40	5.43	53
短期 (1-3)	6,707	99.02	99.13	2.00	0.47	0.98	0.98	1.99	1.98	1.99	43
中期 (3-7)	9,404	97.36	97.53	4.77	0.68	1.23	1.22	4.68	4.65	4.68	51
長期 (7-)	6,151	90.48	90.74	11.98	1.08	1.99	1.89	10.80	10.69	10.77	66
長期 (7-11)	3,115	96.15	96.43	8.66	1.13	1.64	1.61	8.22	8.16	8.22	64
超長期 (11-)	3,036	84.67	84.91	15.40	1.04	2.40	2.22	13.80	13.64	13.74	70
BBB 格	530	96.67	96.88	3.95	0.86	1.73	1.70	3.77	3.74	3.77	104
短期 (1-3)	227	98.23	98.38	2.10	0.80	1.73	1.72	2.08	2.07	2.08	116
中期 (3-7)	273	96.50	96.74	4.60	0.91	1.68	1.65	4.47	4.44	4.47	95
長期 (7-)	30	86.43	86.80	12.08	0.88	2.26	2.10	11.11	10.99	11.09	83
長期 (7-11)	10	93.87	94.20	7.57	0.77	1.69	1.64	7.34	7.28	7.34	76
超長期 (11-)	20	82.70	83.10	14.33	0.93	2.58	2.36	13.25	13.10	13.22	87
BB 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
B 格以下	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
格付なし	5,789	96.38	96.52	5.14	0.75	1.40	1.36	4.84	4.80	4.84	62
短期 (1-3)	1,915	98.87	98.98	2.14	0.62	1.13	1.12	2.12	2.11	2.12	57
中期 (3-7)	2,738	96.71	96.85	4.82	0.68	1.37	1.34	4.72	4.68	4.72	63
長期 (7-)	1,136	91.37	91.58	10.98	1.10	1.96	1.84	10.11	10.01	10.10	68
長期 (7-11)	624	97.42	97.68	8.48	1.30	1.66	1.61	8.01	7.94	8.00	66
超長期 (11-)	512	83.99	84.15	14.03	0.85	2.39	2.17	13.08	12.94	13.05	72

出所:NFRG

- 格付は、R&Iの格付をもとに NFRG で分類

事業債 JCR 格付別・ポートフォリオ指標 (2024年12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	30,430	96.19	96.33	5.92	0.59	1.14	1.11	5.26	5.23	5.25	34
短期 (1-3)	10,282	99.12	99.20	2.00	0.38	0.83	0.83	1.99	1.99	1.99	28
中期 (3-7)	12,828	97.69	97.83	4.70	0.56	1.05	1.04	4.63	4.60	4.63	34
長期 (7-)	7,320	89.45	89.67	13.56	0.95	1.80	1.69	11.56	11.46	11.50	41
長期 (7-11)	3,892	96.71	96.92	8.56	0.95	1.39	1.37	8.20	8.15	8.20	40
超長期 (11-)	3,428	81.21	81.43	19.25	0.95	2.35	2.12	16.10	15.93	15.95	43
AAA~A 格	42,460	96.12	96.27	5.86	0.66	1.25	1.21	5.27	5.23	5.26	44
短期 (1-3)	13,830	99.07	99.17	1.99	0.42	0.90	0.90	1.98	1.97	1.98	35
中期 (3-7)	17,969	97.56	97.71	4.71	0.64	1.16	1.14	4.63	4.60	4.63	44
長期 (7-)	10,661	89.86	90.10	12.82	1.02	1.91	1.80	11.14	11.04	11.09	56
長期 (7-11)	5,631	96.29	96.53	8.61	1.03	1.53	1.50	8.22	8.16	8.21	53
超長期 (11-)	5,030	82.66	82.90	17.53	1.01	2.41	2.19	14.96	14.79	14.84	59
AAA~BBB 格	42,682	96.12	96.28	5.85	0.66	1.25	1.21	5.26	5.22	5.25	44
短期 (1-3)	13,929	99.07	99.17	1.99	0.42	0.90	0.90	1.98	1.97	1.98	35
中期 (3-7)	18,063	97.56	97.71	4.71	0.64	1.16	1.14	4.62	4.60	4.62	44
長期 (7-)	10,691	89.85	90.09	12.82	1.02	1.91	1.80	11.14	11.04	11.09	56
長期 (7-11)	5,641	96.28	96.53	8.61	1.03	1.53	1.50	8.22	8.16	8.21	53
超長期 (11-)	5,050	82.66	82.90	17.52	1.01	2.41	2.19	14.95	14.78	14.84	59
AAA~BB 格	42,682	96.12	96.28	5.85	0.66	1.25	1.21	5.26	5.22	5.25	44
短期 (1-3)	13,929	99.07	99.17	1.99	0.42	0.90	0.90	1.98	1.97	1.98	35
中期 (3-7)	18,063	97.56	97.71	4.71	0.64	1.16	1.14	4.62	4.60	4.62	44
長期 (7-)	10,691	89.85	90.09	12.82	1.02	1.91	1.80	11.14	11.04	11.09	56
長期 (7-11)	5,641	96.28	96.53	8.61	1.03	1.53	1.50	8.22	8.16	8.21	53
超長期 (11-)	5,050	82.66	82.90	17.52	1.01	2.41	2.19	14.95	14.78	14.84	59
AAA 格	11,569	96.70	96.81	5.52	0.48	0.98	0.96	4.76	4.72	4.73	22
短期 (1-3)	4,465	99.04	99.09	1.99	0.23	0.74	0.74	1.99	1.98	1.99	19
中期 (3-7)	5,117	98.05	98.16	4.61	0.51	0.93	0.92	4.55	4.52	4.55	22
長期 (7-)	1,987	88.00	88.21	15.80	0.96	1.74	1.61	12.35	12.23	12.21	29
長期 (7-11)	1,185	97.12	97.30	8.65	0.91	1.29	1.28	8.31	8.26	8.31	30
超長期 (11-)	802	74.52	74.77	26.36	1.04	2.61	2.24	20.11	19.87	19.72	28
AA 格	18,860	95.88	96.03	6.17	0.66	1.24	1.21	5.58	5.54	5.57	41
短期 (1-3)	5,818	99.18	99.28	2.01	0.49	0.91	0.91	2.00	1.99	2.00	36
中期 (3-7)	7,710	97.46	97.60	4.77	0.60	1.14	1.12	4.68	4.65	4.68	42
長期 (7-)	5,332	89.99	90.21	12.73	0.94	1.82	1.72	11.28	11.17	11.24	46
長期 (7-11)	2,706	96.53	96.76	8.51	0.96	1.43	1.41	8.15	8.10	8.15	45
超長期 (11-)	2,626	83.25	83.47	17.07	0.92	2.28	2.08	15.01	14.85	14.92	47
A 格	12,030	95.93	96.14	5.71	0.84	1.51	1.47	5.28	5.23	5.27	69
短期 (1-3)	3,548	98.95	99.09	1.94	0.54	1.09	1.09	1.93	1.92	1.93	55
中期 (3-7)	5,141	97.22	97.43	4.74	0.83	1.41	1.39	4.62	4.59	4.62	68
長期 (7-)	3,341	90.75	91.05	11.19	1.19	2.16	2.05	10.24	10.13	10.22	87
長期 (7-11)	1,740	95.34	95.66	8.74	1.23	1.85	1.80	8.26	8.18	8.25	83
超長期 (11-)	1,602	85.77	86.03	13.86	1.14	2.53	2.34	12.63	12.48	12.60	91
BBB 格	222	96.57	96.80	4.35	0.82	1.26	1.24	4.05	4.02	4.05	55
短期 (1-3)	99	98.86	99.04	2.01	0.85	0.87	0.87	1.98	1.97	1.98	34
中期 (3-7)	94	97.40	97.65	4.34	0.77	1.40	1.39	4.25	4.22	4.25	70
長期 (7-)	30	86.43	86.80	12.08	0.88	2.26	2.10	11.11	10.99	11.09	83
長期 (7-11)	10	93.87	94.20	7.57	0.77	1.69	1.64	7.34	7.28	7.34	76
超長期 (11-)	20	82.70	83.10	14.33	0.93	2.58	2.36	13.25	13.10	13.22	87
BB 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
B 格以下	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
格付なし	27,911	94.19	94.42	9.75	0.92	1.37	1.31	7.90	7.83	7.84	32
短期 (1-3)	6,665	99.54	99.69	2.03	0.62	0.88	0.88	2.02	2.01	2.02	33
中期 (3-7)	8,886	99.02	99.23	4.69	0.83	1.04	1.03	4.60	4.57	4.59	33
長期 (7-)	12,361	87.83	88.13	17.54	1.15	1.94	1.80	14.15	14.01	14.01	30
長期 (7-11)	4,041	99.23	99.51	8.82	1.21	1.31	1.30	8.35	8.30	8.35	31
超長期 (11-)	8,320	82.30	82.60	21.77	1.13	2.31	2.09	17.55	17.36	17.33	29

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12月末、1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	31,224	96.17	96.30	6.00	0.60	1.15	1.12	5.33	5.29	5.32	34
短期 (1-3)	10,443	99.10	99.18	2.04	0.38	0.84	0.83	2.03	2.02	2.03	28
中期 (3-7)	13,210	97.69	97.82	4.75	0.57	1.06	1.05	4.67	4.65	4.67	34
長期 (7-)	7,571	89.46	89.68	13.62	0.96	1.81	1.70	11.62	11.52	11.56	42
長期 (7-11)	3,964	96.80	97.01	8.62	0.97	1.40	1.38	8.25	8.20	8.25	41
超長期 (11-)	3,607	81.39	81.61	19.12	0.95	2.35	2.12	16.02	15.85	15.88	44
AAA~A 格	43,205	96.10	96.25	5.93	0.67	1.25	1.22	5.33	5.29	5.32	44
短期 (1-3)	13,990	99.06	99.15	2.03	0.42	0.90	0.90	2.02	2.01	2.02	35
中期 (3-7)	18,339	97.55	97.70	4.76	0.64	1.16	1.14	4.67	4.64	4.67	44
長期 (7-)	10,877	89.84	90.08	12.90	1.03	1.92	1.81	11.21	11.10	11.16	56
長期 (7-11)	5,668	96.37	96.61	8.67	1.05	1.54	1.51	8.26	8.20	8.26	53
超長期 (11-)	5,209	82.74	82.97	17.50	1.01	2.41	2.19	14.94	14.78	14.83	59
AAA~BBB 格	43,430	96.10	96.26	5.92	0.67	1.25	1.22	5.32	5.28	5.31	44
短期 (1-3)	14,094	99.06	99.15	2.03	0.42	0.90	0.90	2.02	2.01	2.02	35
中期 (3-7)	18,429	97.55	97.70	4.76	0.64	1.16	1.14	4.67	4.64	4.67	44
長期 (7-)	10,907	89.83	90.07	12.90	1.03	1.92	1.81	11.21	11.10	11.16	56
長期 (7-11)	5,678	96.36	96.61	8.67	1.05	1.54	1.51	8.26	8.20	8.26	53
超長期 (11-)	5,229	82.74	82.97	17.49	1.01	2.41	2.19	14.94	14.77	14.82	59
AAA~BB 格	43,430	96.10	96.26	5.92	0.67	1.25	1.22	5.32	5.28	5.31	44
短期 (1-3)	14,094	99.06	99.15	2.03	0.42	0.90	0.90	2.02	2.01	2.02	35
中期 (3-7)	18,429	97.55	97.70	4.76	0.64	1.16	1.14	4.67	4.64	4.67	44
長期 (7-)	10,907	89.83	90.07	12.90	1.03	1.92	1.81	11.21	11.10	11.16	56
長期 (7-11)	5,678	96.36	96.61	8.67	1.05	1.54	1.51	8.26	8.20	8.26	53
超長期 (11-)	5,229	82.74	82.97	17.49	1.01	2.41	2.19	14.94	14.77	14.82	59
AAA 格	11,755	96.75	96.86	5.51	0.49	0.98	0.96	4.75	4.72	4.73	22
短期 (1-3)	4,618	99.05	99.10	2.02	0.25	0.74	0.74	2.02	2.01	2.02	19
中期 (3-7)	5,187	98.03	98.15	4.67	0.51	0.94	0.93	4.60	4.58	4.60	23
長期 (7-)	1,951	87.91	88.12	16.00	0.98	1.76	1.62	12.48	12.36	12.34	30
長期 (7-11)	1,145	97.25	97.44	8.73	0.94	1.30	1.29	8.37	8.32	8.37	31
超長期 (11-)	805	74.62	74.87	26.34	1.05	2.61	2.24	20.09	19.85	19.70	28
AA 格	19,469	95.81	95.96	6.29	0.67	1.26	1.22	5.69	5.64	5.67	41
短期 (1-3)	5,826	99.14	99.24	2.06	0.48	0.91	0.91	2.05	2.04	2.05	36
中期 (3-7)	8,023	97.47	97.61	4.80	0.61	1.14	1.13	4.72	4.69	4.72	42
長期 (7-)	5,620	90.00	90.22	12.80	0.96	1.83	1.72	11.33	11.23	11.29	46
長期 (7-11)	2,818	96.62	96.84	8.58	0.99	1.44	1.41	8.21	8.15	8.20	45
超長期 (11-)	2,802	83.34	83.55	17.05	0.93	2.28	2.09	14.98	14.82	14.89	48
A 格	11,981	95.92	96.13	5.74	0.85	1.51	1.47	5.31	5.27	5.31	69
短期 (1-3)	3,547	98.95	99.08	2.00	0.55	1.10	1.10	1.98	1.97	1.98	55
中期 (3-7)	5,128	97.18	97.39	4.79	0.83	1.41	1.39	4.67	4.64	4.67	68
長期 (7-)	3,306	90.72	91.01	11.24	1.20	2.17	2.06	10.27	10.17	10.26	87
長期 (7-11)	1,705	95.36	95.68	8.78	1.24	1.86	1.81	8.28	8.21	8.28	83
超長期 (11-)	1,602	85.77	86.03	13.86	1.14	2.53	2.34	12.63	12.48	12.60	91
BBB 格	224	96.63	96.86	4.43	0.85	1.27	1.24	4.13	4.10	4.13	55
短期 (1-3)	104	98.80	98.99	2.14	0.84	0.88	0.88	2.11	2.09	2.11	34
中期 (3-7)	91	97.52	97.75	4.53	0.84	1.43	1.41	4.43	4.40	4.43	72
長期 (7-)	30	86.43	86.80	12.08	0.88	2.26	2.10	11.11	10.99	11.09	83
長期 (7-11)	10	93.87	94.20	7.57	0.77	1.69	1.64	7.34	7.28	7.34	76
超長期 (11-)	20	82.70	83.10	14.33	0.93	2.58	2.36	13.25	13.10	13.22	87
BB 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
B 格以下	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
格付なし	27,165	94.17	94.41	9.82	0.93	1.37	1.31	7.95	7.88	7.89	31
短期 (1-3)	6,485	99.54	99.69	2.06	0.63	0.88	0.88	2.05	2.04	2.05	33
中期 (3-7)	8,641	99.02	99.23	4.71	0.83	1.04	1.03	4.61	4.59	4.61	33
長期 (7-)	12,039	87.80	88.09	17.67	1.16	1.94	1.80	14.24	14.09	14.09	29
長期 (7-11)	3,924	99.35	99.64	8.86	1.22	1.30	1.30	8.38	8.33	8.38	31
超長期 (11-)	8,115	82.21	82.51	21.93	1.13	2.31	2.10	17.65	17.46	17.43	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12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	24,157	95.39	95.61	8.57	0.82	1.24	1.19	7.16	7.10	7.12	25
短期 (1-3)	6,813	99.41	99.54	2.00	0.45	0.77	0.77	1.99	1.98	1.99	22
中期 (3-7)	7,844	98.81	99.01	4.62	0.70	0.94	0.94	4.54	4.51	4.54	24
長期 (7-)	9,500	89.69	89.99	16.53	1.17	1.87	1.76	13.64	13.51	13.53	29
長期 (7-11)	3,408	98.97	99.24	8.75	1.13	1.28	1.28	8.32	8.27	8.31	29
超長期 (11-)	6,092	84.49	84.81	20.89	1.19	2.25	2.07	17.12	16.94	16.94	29
AAA~BBB 格	26,049	95.40	95.62	8.48	0.83	1.25	1.21	7.11	7.05	7.07	28
短期 (1-3)	7,083	99.39	99.52	2.00	0.45	0.78	0.78	1.99	1.98	1.99	23
中期 (3-7)	8,825	98.82	99.02	4.61	0.74	0.98	0.98	4.53	4.50	4.52	28
長期 (7-)	10,142	89.65	89.94	16.37	1.16	1.88	1.76	13.55	13.42	13.44	31
長期 (7-11)	3,693	98.79	99.06	8.73	1.12	1.30	1.29	8.31	8.25	8.30	31
超長期 (11-)	6,449	84.41	84.73	20.75	1.19	2.27	2.08	17.06	16.87	16.88	31
AAA~BB 格	26,049	95.40	95.62	8.48	0.83	1.25	1.21	7.11	7.05	7.07	28
短期 (1-3)	7,083	99.39	99.52	2.00	0.45	0.78	0.78	1.99	1.98	1.99	23
中期 (3-7)	8,825	98.82	99.02	4.61	0.74	0.98	0.98	4.53	4.50	4.52	28
長期 (7-)	10,142	89.65	89.94	16.37	1.16	1.88	1.76	13.55	13.42	13.44	31
長期 (7-11)	3,693	98.79	99.06	8.73	1.12	1.30	1.29	8.31	8.25	8.30	31
超長期 (11-)	6,449	84.41	84.73	20.75	1.19	2.27	2.08	17.06	16.87	16.88	31
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	24,157	95.39	95.61	8.57	0.82	1.24	1.19	7.16	7.10	7.12	25
短期 (1-3)	6,813	99.41	99.54	2.00	0.45	0.77	0.77	1.99	1.98	1.99	22
中期 (3-7)	7,844	98.81	99.01	4.62	0.70	0.94	0.94	4.54	4.51	4.54	24
長期 (7-)	9,500	89.69	89.99	16.53	1.17	1.87	1.76	13.64	13.51	13.53	29
長期 (7-11)	3,408	98.97	99.24	8.75	1.13	1.28	1.28	8.32	8.27	8.31	29
超長期 (11-)	6,092	84.49	84.81	20.89	1.19	2.25	2.07	17.12	16.94	16.94	29
BBB 格	1,893	95.55	95.77	7.40	0.95	1.46	1.41	6.53	6.47	6.51	53
短期 (1-3)	270	98.89	98.95	2.04	0.31	0.87	0.86	2.03	2.02	2.03	31
中期 (3-7)	981	98.89	99.13	4.56	1.04	1.29	1.29	4.44	4.41	4.44	60
長期 (7-)	642	89.04	89.28	14.00	1.08	2.00	1.88	12.17	12.04	12.11	53
長期 (7-11)	285	96.55	96.80	8.51	0.98	1.46	1.43	8.14	8.09	8.14	47
超長期 (11-)	357	83.05	83.28	18.39	1.16	2.51	2.30	15.90	15.72	15.79	59
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	44,544	95.33	95.50	6.76	0.73	1.32	1.28	5.81	5.76	5.79	46
短期 (1-3)	13,511	99.13	99.24	2.00	0.51	0.96	0.95	1.99	1.98	1.99	41
中期 (3-7)	18,123	97.66	97.82	4.75	0.69	1.18	1.17	4.66	4.63	4.66	47
長期 (7-)	12,909	88.08	88.33	14.54	1.04	1.97	1.83	12.10	11.98	12.00	51
長期 (7-11)	5,989	96.72	96.98	8.68	1.10	1.52	1.50	8.25	8.19	8.25	52
超長期 (11-)	6,921	80.60	80.84	19.62	0.98	2.43	2.18	16.09	15.91	15.90	49

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12月末、1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	24,247	95.41	95.62	8.58	0.82	1.24	1.19	7.17	7.11	7.13	25
短期 (1-3)	6,852	99.40	99.53	2.04	0.46	0.77	0.77	2.03	2.02	2.03	22
中期 (3-7)	7,934	98.79	98.98	4.67	0.70	0.95	0.94	4.58	4.56	4.58	24
長期 (7-)	9,461	89.69	89.99	16.59	1.18	1.87	1.76	13.68	13.55	13.57	29
長期 (7-11)	3,373	99.06	99.33	8.80	1.15	1.29	1.28	8.36	8.31	8.35	29
超長期 (11-)	6,088	84.49	84.81	20.90	1.19	2.25	2.07	17.14	16.95	16.96	29
AAA~BBB 格	26,139	95.42	95.63	8.49	0.83	1.25	1.21	7.13	7.07	7.09	27
短期 (1-3)	7,122	99.38	99.51	2.04	0.45	0.78	0.78	2.03	2.02	2.03	23
中期 (3-7)	8,925	98.79	98.99	4.66	0.74	0.98	0.98	4.57	4.55	4.57	28
長期 (7-)	10,093	89.64	89.94	16.43	1.17	1.88	1.77	13.59	13.46	13.49	31
長期 (7-11)	3,648	98.87	99.14	8.79	1.14	1.30	1.29	8.35	8.29	8.34	31
超長期 (11-)	6,445	84.41	84.73	20.76	1.19	2.27	2.08	17.07	16.89	16.89	31
AAA~BB 格	26,139	95.42	95.63	8.49	0.83	1.25	1.21	7.13	7.07	7.09	27
短期 (1-3)	7,122	99.38	99.51	2.04	0.45	0.78	0.78	2.03	2.02	2.03	23
中期 (3-7)	8,925	98.79	98.99	4.66	0.74	0.98	0.98	4.57	4.55	4.57	28
長期 (7-)	10,093	89.64	89.94	16.43	1.17	1.88	1.77	13.59	13.46	13.49	31
長期 (7-11)	3,648	98.87	99.14	8.79	1.14	1.30	1.29	8.35	8.29	8.34	31
超長期 (11-)	6,445	84.41	84.73	20.76	1.19	2.27	2.08	17.07	16.89	16.89	31
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	24,247	95.41	95.62	8.58	0.82	1.24	1.19	7.17	7.11	7.13	25
短期 (1-3)	6,852	99.40	99.53	2.04	0.46	0.77	0.77	2.03	2.02	2.03	22
中期 (3-7)	7,934	98.79	98.98	4.67	0.70	0.95	0.94	4.58	4.56	4.58	24
長期 (7-)	9,461	89.69	89.99	16.59	1.18	1.87	1.76	13.68	13.55	13.57	29
長期 (7-11)	3,373	99.06	99.33	8.80	1.15	1.29	1.28	8.36	8.31	8.35	29
超長期 (11-)	6,088	84.49	84.81	20.90	1.19	2.25	2.07	17.14	16.95	16.96	29
BBB 格	1,893	95.55	95.77	7.40	0.95	1.46	1.41	6.53	6.47	6.51	53
短期 (1-3)	270	98.89	98.95	2.04	0.31	0.87	0.86	2.03	2.02	2.03	31
中期 (3-7)	991	98.85	99.09	4.58	1.04	1.30	1.29	4.47	4.44	4.47	59
長期 (7-)	632	88.95	89.19	14.11	1.09	2.01	1.89	12.26	12.13	12.20	54
長期 (7-11)	275	96.61	96.86	8.56	1.00	1.46	1.44	8.19	8.13	8.18	47
超長期 (11-)	357	83.05	83.28	18.39	1.16	2.51	2.30	15.90	15.72	15.79	59
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	44,455	95.32	95.49	6.79	0.74	1.33	1.28	5.84	5.80	5.82	46
短期 (1-3)	13,457	99.12	99.23	2.04	0.51	0.96	0.96	2.03	2.02	2.03	41
中期 (3-7)	18,145	97.64	97.80	4.79	0.69	1.19	1.17	4.69	4.67	4.69	47
長期 (7-)	12,853	88.08	88.32	14.59	1.04	1.97	1.84	12.13	12.01	12.04	51
長期 (7-11)	5,954	96.80	97.05	8.72	1.11	1.53	1.50	8.29	8.23	8.29	52
超長期 (11-)	6,899	80.55	80.79	19.65	0.98	2.43	2.18	16.11	15.93	15.93	49

出所:NFRC

- 格付は、Moody's の格付をもとに NFRC で分類

事業債 S&P 格付別・ポートフォリオ指標 (2024年12月末)

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
AAA~AA 格	851	84.18	84.33	17.37	0.98	1.91	1.71	13.28	13.14	13.14	31
短期 (1-3)	40	102.11	102.17	1.98	1.75	0.78	0.79	1.96	1.95	1.96	25
中期 (3-7)	135	97.22	97.26	5.50	0.46	1.04	1.03	5.42	5.39	5.42	28
長期 (7-)	676	80.51	80.70	20.66	1.03	2.21	1.95	16.02	15.84	15.83	33
長期 (7-11)	192	99.41	99.61	8.61	1.19	1.28	1.28	8.18	8.13	8.17	31
超長期 (11-)	484	73.02	73.19	25.44	0.98	2.71	2.31	20.25	20.01	19.97	34
AAA~A 格	16,246	93.95	94.12	9.01	0.78	1.27	1.21	7.35	7.29	7.31	27
短期 (1-3)	3,867	99.52	99.62	2.07	0.51	0.78	0.78	2.06	2.05	2.06	23
中期 (3-7)	5,607	98.51	98.65	4.90	0.69	0.99	0.99	4.81	4.78	4.81	28
長期 (7-)	6,772	87.00	87.23	16.38	1.00	1.86	1.71	13.19	13.06	13.06	30
長期 (7-11)	2,846	98.39	98.61	8.63	1.09	1.28	1.27	8.22	8.17	8.22	31
超長期 (11-)	3,926	78.75	78.98	22.00	0.94	2.38	2.10	17.69	17.49	17.45	30
AAA~BBB 格	16,461	94.00	94.17	8.95	0.77	1.27	1.21	7.31	7.25	7.26	28
短期 (1-3)	3,927	99.51	99.60	2.07	0.51	0.78	0.78	2.06	2.05	2.06	23
中期 (3-7)	5,732	98.49	98.63	4.88	0.69	1.00	0.99	4.79	4.77	4.79	28
長期 (7-)	6,802	87.03	87.26	16.35	1.00	1.86	1.71	13.17	13.04	13.05	30
長期 (7-11)	2,866	98.39	98.61	8.62	1.09	1.29	1.28	8.22	8.17	8.22	31
超長期 (11-)	3,936	78.76	79.00	21.98	0.94	2.38	2.10	17.67	17.48	17.44	30
AAA~BB 格	16,701	94.09	94.26	8.90	0.80	1.28	1.22	7.27	7.21	7.23	29
短期 (1-3)	3,927	99.51	99.60	2.07	0.51	0.78	0.78	2.06	2.05	2.06	23
中期 (3-7)	5,947	98.58	98.74	4.86	0.74	1.03	1.03	4.76	4.74	4.76	32
長期 (7-)	6,827	87.05	87.28	16.35	1.01	1.86	1.71	13.17	13.04	13.04	31
長期 (7-11)	2,866	98.39	98.61	8.62	1.09	1.29	1.28	8.22	8.17	8.22	31
超長期 (11-)	3,961	78.85	79.09	21.94	0.95	2.38	2.11	17.64	17.44	17.40	31
AAA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA 格	851	84.18	84.33	17.37	0.98	1.91	1.71	13.28	13.14	13.14	31
短期 (1-3)	40	102.11	102.17	1.98	1.75	0.78	0.79	1.96	1.95	1.96	25
中期 (3-7)	135	97.22	97.26	5.50	0.46	1.04	1.03	5.42	5.39	5.42	28
長期 (7-)	676	80.51	80.70	20.66	1.03	2.21	1.95	16.02	15.84	15.83	33
長期 (7-11)	192	99.41	99.61	8.61	1.19	1.28	1.28	8.18	8.13	8.17	31
超長期 (11-)	484	73.02	73.19	25.44	0.98	2.71	2.31	20.25	20.01	19.97	34
A 格	15,395	94.49	94.66	8.55	0.77	1.24	1.19	7.06	7.01	7.02	27
短期 (1-3)	3,827	99.49	99.59	2.07	0.50	0.78	0.78	2.06	2.05	2.06	23
中期 (3-7)	5,472	98.54	98.68	4.89	0.69	0.99	0.99	4.79	4.77	4.79	27
長期 (7-)	6,096	87.72	87.96	15.91	1.00	1.82	1.68	12.90	12.78	12.78	30
長期 (7-11)	2,654	98.32	98.54	8.63	1.08	1.29	1.27	8.23	8.17	8.22	31
超長期 (11-)	3,442	79.55	79.80	21.52	0.94	2.33	2.07	17.36	17.17	17.12	29
BBB 格	215	97.67	97.76	4.26	0.58	1.12	1.10	4.10	4.07	4.09	42
短期 (1-3)	60	98.89	98.91	1.91	0.29	0.88	0.88	1.91	1.90	1.91	33
中期 (3-7)	125	97.97	98.05	4.02	0.60	1.10	1.09	3.96	3.94	3.96	42
長期 (7-)	30	94.03	94.26	9.96	1.08	1.69	1.63	9.28	9.20	9.27	56
長期 (7-11)	20	98.05	98.37	8.21	1.15	1.42	1.40	7.83	7.78	7.83	48
超長期 (11-)	10	85.99	86.04	13.45	0.95	2.32	2.16	12.58	12.44	12.55	74
BB 格	240	100.03	100.49	5.41	2.26	2.10	2.09	4.90	4.84	4.89	133
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	215	100.93	101.42	4.25	2.25	1.99	2.00	4.05	4.01	4.05	132
長期 (7-)	25	92.30	92.50	15.41	2.37	3.11	2.99	12.85	12.66	12.77	146
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	25	92.30	92.50	15.41	2.37	3.11	2.99	12.85	12.66	12.77	146
B 格以下	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
格付なし	53,893	95.75	95.94	6.93	0.76	1.30	1.26	5.99	5.94	5.97	42
短期 (1-3)	16,667	99.16	99.27	1.99	0.48	0.92	0.92	1.97	1.97	1.97	37
中期 (3-7)	21,001	97.88	98.06	4.66	0.69	1.14	1.13	4.57	4.55	4.57	43
長期 (7-)	16,224	89.49	89.78	14.93	1.13	1.95	1.84	12.57	12.44	12.48	47
長期 (7-11)	6,816	97.14	97.42	8.73	1.11	1.50	1.48	8.30	8.24	8.29	50
超長期 (11-)	9,409	83.95	84.24	19.42	1.14	2.34	2.14	16.14	15.96	15.98	44

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12月末、1月ポートフォリオ)

	額面 (10億円)	時価単価 (円)	利含単価 (円)	残存年数 (年)	利率 (%)	単利 (%)	複利 (%)	Dur (年)	M-Dur	E-Dur	Tspd (bp)
AAA~AA 格	851	84.18	84.33	17.37	0.98	1.91	1.71	13.28	13.14	13.14	31
短期 (1-3)	40	102.11	102.17	1.98	1.75	0.78	0.79	1.96	1.95	1.96	25
中期 (3-7)	135	97.22	97.26	5.50	0.46	1.04	1.03	5.42	5.39	5.42	28
長期 (7-)	676	80.51	80.70	20.66	1.03	2.21	1.95	16.02	15.84	15.83	33
長期 (7-11)	192	99.41	99.61	8.61	1.19	1.28	1.28	8.18	8.13	8.17	31
超長期 (11-)	484	73.02	73.19	25.44	0.98	2.71	2.31	20.25	20.01	19.97	34
AAA~A 格	16,201	93.94	94.10	9.05	0.78	1.28	1.22	7.38	7.32	7.33	27
短期 (1-3)	3,902	99.50	99.60	2.12	0.51	0.78	0.78	2.11	2.10	2.11	23
中期 (3-7)	5,597	98.44	98.58	4.97	0.69	1.00	0.99	4.87	4.85	4.87	28
長期 (7-)	6,702	86.93	87.17	16.48	1.01	1.87	1.71	13.26	13.14	13.14	30
長期 (7-11)	2,801	98.49	98.71	8.70	1.11	1.29	1.28	8.28	8.23	8.28	31
超長期 (11-)	3,901	78.64	78.87	22.07	0.94	2.38	2.11	17.74	17.55	17.50	30
AAA~BBB 格	16,416	93.98	94.15	8.98	0.78	1.27	1.21	7.34	7.28	7.29	28
短期 (1-3)	3,962	99.49	99.59	2.12	0.51	0.78	0.78	2.10	2.10	2.10	23
中期 (3-7)	5,722	98.43	98.57	4.95	0.69	1.00	0.99	4.85	4.83	4.85	28
長期 (7-)	6,732	86.97	87.20	16.45	1.01	1.87	1.71	13.24	13.12	13.12	30
長期 (7-11)	2,821	98.48	98.71	8.69	1.11	1.29	1.28	8.28	8.22	8.27	31
超長期 (11-)	3,911	78.66	78.89	22.05	0.94	2.38	2.11	17.73	17.53	17.49	30
AAA~BB 格	16,656	94.07	94.24	8.93	0.80	1.29	1.23	7.30	7.24	7.25	29
短期 (1-3)	3,962	99.49	99.59	2.12	0.51	0.78	0.78	2.10	2.10	2.10	23
中期 (3-7)	5,937	98.52	98.67	4.92	0.74	1.04	1.03	4.82	4.80	4.82	32
長期 (7-)	6,757	86.99	87.22	16.45	1.02	1.87	1.72	13.24	13.11	13.12	31
長期 (7-11)	2,821	98.48	98.71	8.69	1.11	1.29	1.28	8.28	8.22	8.27	31
超長期 (11-)	3,936	78.74	78.98	22.01	0.95	2.39	2.11	17.69	17.50	17.45	31
AAA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA 格	851	84.18	84.33	17.37	0.98	1.91	1.71	13.28	13.14	13.14	31
短期 (1-3)	40	102.11	102.17	1.98	1.75	0.78	0.79	1.96	1.95	1.96	25
中期 (3-7)	135	97.22	97.26	5.50	0.46	1.04	1.03	5.42	5.39	5.42	28
長期 (7-)	676	80.51	80.70	20.66	1.03	2.21	1.95	16.02	15.84	15.83	33
長期 (7-11)	192	99.41	99.61	8.61	1.19	1.28	1.28	8.18	8.13	8.17	31
超長期 (11-)	484	73.02	73.19	25.44	0.98	2.71	2.31	20.25	20.01	19.97	34
A 格	15,350	94.48	94.65	8.58	0.77	1.24	1.19	7.09	7.04	7.05	27
短期 (1-3)	3,862	99.47	99.57	2.12	0.50	0.78	0.78	2.11	2.10	2.11	23
中期 (3-7)	5,462	98.47	98.62	4.95	0.69	1.00	0.99	4.86	4.84	4.86	28
長期 (7-)	6,026	87.65	87.89	16.01	1.01	1.83	1.69	12.98	12.86	12.86	30
長期 (7-11)	2,609	98.42	98.64	8.70	1.11	1.29	1.28	8.29	8.23	8.28	31
超長期 (11-)	3,417	79.43	79.68	21.60	0.94	2.34	2.08	17.42	17.23	17.18	29
BBB 格	215	97.67	97.76	4.26	0.58	1.12	1.10	4.10	4.07	4.09	42
短期 (1-3)	60	98.89	98.91	1.91	0.29	0.88	0.88	1.91	1.90	1.91	33
中期 (3-7)	125	97.97	98.05	4.02	0.60	1.10	1.09	3.96	3.94	3.96	42
長期 (7-)	30	94.03	94.26	9.96	1.08	1.69	1.63	9.28	9.20	9.27	56
長期 (7-11)	20	98.05	98.37	8.21	1.15	1.42	1.40	7.83	7.78	7.83	48
超長期 (11-)	10	85.99	86.04	13.45	0.95	2.32	2.16	12.58	12.44	12.55	74
BB 格	240	100.03	100.49	5.41	2.26	2.10	2.09	4.90	4.84	4.89	133
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	215	100.93	101.42	4.25	2.25	1.99	2.00	4.05	4.01	4.05	132
長期 (7-)	25	92.30	92.50	15.41	2.37	3.11	2.99	12.85	12.66	12.77	146
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	25	92.30	92.50	15.41	2.37	3.11	2.99	12.85	12.66	12.77	146
B 格以下	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
格付なし	53,939	95.75	95.95	6.95	0.76	1.30	1.26	6.02	5.97	6.00	42
短期 (1-3)	16,617	99.14	99.26	2.02	0.48	0.92	0.92	2.01	2.00	2.01	37
中期 (3-7)	21,133	97.87	98.05	4.70	0.69	1.14	1.13	4.60	4.58	4.60	43
長期 (7-)	16,189	89.51	89.79	14.96	1.13	1.96	1.84	12.59	12.47	12.51	47
長期 (7-11)	6,781	97.21	97.49	8.77	1.13	1.50	1.48	8.33	8.27	8.32	50
超長期 (11-)	9,408	83.95	84.25	19.43	1.14	2.34	2.14	16.15	15.97	15.99	44

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12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	1,670	98.90	99.12	3.23	0.87	1.23	1.23	3.15	3.13	3.15	61
短期(1-3)	965	99.25	99.46	2.25	0.78	1.13	1.13	2.23	2.22	2.23	56
中期(3-7)	632	98.53	98.76	4.07	0.96	1.33	1.32	3.99	3.96	3.99	65
長期(7-)	73	97.46	97.81	8.85	1.40	1.74	1.72	8.27	8.20	8.26	73
長期(7-11)	69	97.60	97.94	8.55	1.36	1.70	1.68	8.06	7.99	8.05	72
超長期(11-)	4	95.21	95.81	13.75	1.99	2.45	2.39	11.82	11.68	11.76	100
AAA~A格	3,446	98.74	99.00	3.53	1.06	1.45	1.45	3.37	3.35	3.37	80
短期(1-3)	1,974	99.25	99.48	2.20	0.96	1.31	1.31	2.17	2.16	2.17	74
中期(3-7)	1,189	98.06	98.33	4.01	1.00	1.51	1.50	3.92	3.90	3.92	83
長期(7-)	284	98.02	98.44	10.76	1.98	2.24	2.22	9.50	9.40	9.48	108
長期(7-11)	166	97.43	97.89	8.63	1.62	1.99	1.97	8.02	7.94	8.01	101
超長期(11-)	118	98.86	99.21	13.76	2.50	2.59	2.57	11.57	11.42	11.51	118
AAA~BBB格	3,950	98.72	98.97	3.69	1.09	1.47	1.46	3.51	3.48	3.51	81
短期(1-3)	2,174	99.28	99.50	2.17	0.97	1.31	1.31	2.15	2.13	2.15	75
中期(3-7)	1,411	98.20	98.45	4.13	1.05	1.52	1.51	4.03	4.00	4.03	83
長期(7-)	365	97.45	97.82	11.08	1.95	2.25	2.23	9.76	9.65	9.72	106
長期(7-11)	208	97.62	98.02	8.70	1.64	1.99	1.97	8.08	8.00	8.08	99
超長期(11-)	157	97.23	97.54	14.25	2.35	2.61	2.57	11.99	11.84	11.93	115
AAA~BB格	3,950	98.72	98.97	3.69	1.09	1.47	1.46	3.51	3.48	3.51	81
短期(1-3)	2,174	99.28	99.50	2.17	0.97	1.31	1.31	2.15	2.13	2.15	75
中期(3-7)	1,411	98.20	98.45	4.13	1.05	1.52	1.51	4.03	4.00	4.03	83
長期(7-)	365	97.45	97.82	11.08	1.95	2.25	2.23	9.76	9.65	9.72	106
長期(7-11)	208	97.62	98.02	8.70	1.64	1.99	1.97	8.08	8.00	8.08	99
超長期(11-)	157	97.23	97.54	14.25	2.35	2.61	2.57	11.99	11.84	11.93	115
AAA格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA格	1,670	98.90	99.12	3.23	0.87	1.23	1.23	3.15	3.13	3.15	61
短期(1-3)	965	99.25	99.46	2.25	0.78	1.13	1.13	2.23	2.22	2.23	56
中期(3-7)	632	98.53	98.76	4.07	0.96	1.33	1.32	3.99	3.96	3.99	65
長期(7-)	73	97.46	97.81	8.85	1.40	1.74	1.72	8.27	8.20	8.26	73
長期(7-11)	69	97.60	97.94	8.55	1.36	1.70	1.68	8.06	7.99	8.05	72
超長期(11-)	4	95.21	95.81	13.75	1.99	2.45	2.39	11.82	11.68	11.76	100
A格	1,776	98.59	98.88	3.81	1.23	1.66	1.65	3.58	3.55	3.58	99
短期(1-3)	1,009	99.25	99.49	2.15	1.13	1.48	1.48	2.12	2.11	2.12	92
中期(3-7)	556	97.53	97.85	3.95	1.04	1.71	1.69	3.85	3.82	3.85	103
長期(7-)	211	98.22	98.65	11.41	2.18	2.42	2.39	9.93	9.81	9.89	120
長期(7-11)	98	97.31	97.85	8.68	1.80	2.20	2.18	7.99	7.91	7.99	121
超長期(11-)	113	98.99	99.34	13.76	2.52	2.59	2.58	11.56	11.42	11.51	119
BBB格	504	98.61	98.78	4.81	1.30	1.58	1.57	4.44	4.40	4.44	84
短期(1-3)	200	99.55	99.70	1.89	1.04	1.32	1.32	1.87	1.86	1.87	77
中期(3-7)	222	98.90	99.08	4.75	1.33	1.57	1.56	4.59	4.55	4.59	86
長期(7-)	81	95.47	95.64	12.22	1.82	2.30	2.24	10.67	10.54	10.62	99
長期(7-11)	42	98.39	98.54	8.98	1.74	1.96	1.95	8.32	8.24	8.32	95
超長期(11-)	39	92.31	92.50	15.73	1.91	2.68	2.59	13.36	13.19	13.27	104
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12月末、1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	794	99.22	99.47	3.20	0.91	1.16	1.15	3.12	3.10	3.12	53
短期 (1-3)	511	99.51	99.76	2.31	0.86	1.09	1.09	2.29	2.28	2.29	52
中期 (3-7)	261	98.88	99.10	4.42	0.96	1.25	1.24	4.32	4.30	4.32	55
長期 (7-)	22	96.74	97.05	9.10	1.29	1.73	1.70	8.44	8.36	8.43	70
長期 (7-11)	18	97.10	97.33	8.02	1.12	1.57	1.54	7.67	7.61	7.66	63
超長期 (11-)	4	95.21	95.81	13.75	1.99	2.45	2.39	11.82	11.68	11.76	100
AAA~A 格	3,675	98.81	99.06	3.61	1.10	1.47	1.46	3.43	3.41	3.43	81
短期 (1-3)	2,152	99.27	99.50	2.24	1.01	1.34	1.34	2.21	2.20	2.21	78
中期 (3-7)	1,221	98.15	98.42	4.10	1.02	1.50	1.49	4.01	3.98	4.01	82
長期 (7-)	301	98.12	98.51	11.41	2.04	2.29	2.26	9.90	9.79	9.86	108
長期 (7-11)	169	97.54	97.97	8.76	1.66	2.02	1.99	8.12	8.04	8.12	102
超長期 (11-)	132	98.86	99.20	14.81	2.54	2.63	2.61	12.16	12.00	12.07	116
AAA~BBB 格	4,179	98.78	99.02	3.76	1.12	1.48	1.48	3.55	3.53	3.55	82
短期 (1-3)	2,353	99.30	99.51	2.21	1.01	1.34	1.34	2.18	2.17	2.18	78
中期 (3-7)	1,444	98.27	98.52	4.20	1.07	1.51	1.50	4.10	4.07	4.10	82
長期 (7-)	382	97.56	97.90	11.59	2.00	2.29	2.26	10.06	9.94	10.02	106
長期 (7-11)	211	97.71	98.09	8.80	1.67	2.01	1.99	8.16	8.08	8.16	100
超長期 (11-)	171	97.37	97.68	15.02	2.39	2.64	2.60	12.42	12.25	12.33	114
AAA~BB 格	4,179	98.78	99.02	3.76	1.12	1.48	1.48	3.55	3.53	3.55	82
短期 (1-3)	2,353	99.30	99.51	2.21	1.01	1.34	1.34	2.18	2.17	2.18	78
中期 (3-7)	1,444	98.27	98.52	4.20	1.07	1.51	1.50	4.10	4.07	4.10	82
長期 (7-)	382	97.56	97.90	11.59	2.00	2.29	2.26	10.06	9.94	10.02	106
長期 (7-11)	211	97.71	98.09	8.80	1.67	2.01	1.99	8.16	8.08	8.16	100
超長期 (11-)	171	97.37	97.68	15.02	2.39	2.64	2.60	12.42	12.25	12.33	114
AAA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA 格	794	99.22	99.47	3.20	0.91	1.16	1.15	3.12	3.10	3.12	53
短期 (1-3)	511	99.51	99.76	2.31	0.86	1.09	1.09	2.29	2.28	2.29	52
中期 (3-7)	261	98.88	99.10	4.42	0.96	1.25	1.24	4.32	4.30	4.32	55
長期 (7-)	22	96.74	97.05	9.10	1.29	1.73	1.70	8.44	8.36	8.43	70
長期 (7-11)	18	97.10	97.33	8.02	1.12	1.57	1.54	7.67	7.61	7.66	63
超長期 (11-)	4	95.21	95.81	13.75	1.99	2.45	2.39	11.82	11.68	11.76	100
A 格	2,881	98.69	98.95	3.72	1.15	1.56	1.55	3.52	3.49	3.51	89
短期 (1-3)	1,642	99.20	99.42	2.22	1.05	1.42	1.42	2.19	2.17	2.19	86
中期 (3-7)	961	97.96	98.23	4.02	1.04	1.57	1.56	3.92	3.89	3.92	89
長期 (7-)	279	98.23	98.63	11.60	2.10	2.33	2.31	10.02	9.90	9.97	111
長期 (7-11)	151	97.59	98.05	8.85	1.72	2.07	2.05	8.18	8.09	8.17	106
超長期 (11-)	128	98.98	99.31	14.85	2.56	2.63	2.61	12.17	12.01	12.08	117
BBB 格	504	98.61	98.78	4.81	1.30	1.58	1.57	4.44	4.40	4.44	84
短期 (1-3)	200	99.55	99.70	1.89	1.04	1.32	1.32	1.87	1.86	1.87	77
中期 (3-7)	222	98.90	99.08	4.75	1.33	1.57	1.56	4.59	4.55	4.59	86
長期 (7-)	81	95.47	95.64	12.22	1.82	2.30	2.24	10.67	10.54	10.62	99
長期 (7-11)	42	98.39	98.54	8.98	1.74	1.96	1.95	8.32	8.24	8.32	95
超長期 (11-)	39	92.31	92.50	15.73	1.91	2.68	2.59	13.36	13.19	13.27	104
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12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	467	99.09	99.29	3.03	0.79	1.10	1.09	2.98	2.97	2.98	49
短期(1-3)	304	99.40	99.59	2.25	0.77	1.05	1.05	2.23	2.22	2.23	49
中期(3-7)	149	98.65	98.89	4.19	0.81	1.17	1.16	4.12	4.10	4.12	48
長期(7-)	14	96.95	97.26	7.87	0.94	1.42	1.39	7.58	7.53	7.58	49
長期(7-11)	14	96.95	97.26	7.87	0.94	1.42	1.39	7.58	7.53	7.58	49
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AAA~A格	2,280	99.08	99.28	3.34	0.97	1.30	1.30	3.22	3.20	3.22	66
短期(1-3)	1,383	99.36	99.54	2.16	0.89	1.20	1.19	2.14	2.13	2.14	64
中期(3-7)	751	98.33	98.55	4.07	0.94	1.36	1.35	3.99	3.96	3.99	68
長期(7-)	145	100.24	100.57	10.74	1.92	1.96	1.97	9.57	9.47	9.54	82
長期(7-11)	87	97.45	97.79	8.68	1.36	1.72	1.70	8.17	8.10	8.16	73
超長期(11-)	59	104.36	104.68	13.77	2.75	2.30	2.34	11.50	11.37	11.44	96
AAA~BBB格	3,950	98.72	98.97	3.69	1.09	1.47	1.46	3.51	3.48	3.51	81
短期(1-3)	2,174	99.28	99.50	2.17	0.97	1.31	1.31	2.15	2.13	2.15	75
中期(3-7)	1,411	98.20	98.45	4.13	1.05	1.52	1.51	4.03	4.00	4.03	83
長期(7-)	365	97.45	97.82	11.08	1.95	2.25	2.23	9.76	9.65	9.72	106
長期(7-11)	208	97.62	98.02	8.70	1.64	1.99	1.97	8.08	8.00	8.08	99
超長期(11-)	157	97.23	97.54	14.25	2.35	2.61	2.57	11.99	11.84	11.93	115
AAA~BB格	3,950	98.72	98.97	3.69	1.09	1.47	1.46	3.51	3.48	3.51	81
短期(1-3)	2,174	99.28	99.50	2.17	0.97	1.31	1.31	2.15	2.13	2.15	75
中期(3-7)	1,411	98.20	98.45	4.13	1.05	1.52	1.51	4.03	4.00	4.03	83
長期(7-)	365	97.45	97.82	11.08	1.95	2.25	2.23	9.76	9.65	9.72	106
長期(7-11)	208	97.62	98.02	8.70	1.64	1.99	1.97	8.08	8.00	8.08	99
超長期(11-)	157	97.23	97.54	14.25	2.35	2.61	2.57	11.99	11.84	11.93	115
AAA格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期(1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期(3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期(7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA格	467	99.09	99.29	3.03	0.79	1.10	1.09	2.98	2.97	2.98	49
短期(1-3)	304	99.40	99.59	2.25	0.77	1.05	1.05	2.23	2.22	2.23	49
中期(3-7)	149	98.65	98.89	4.19	0.81	1.17	1.16	4.12	4.10	4.12	48
長期(7-)	14	96.95	97.26	7.87	0.94	1.42	1.39	7.58	7.53	7.58	49
長期(7-11)	14	96.95	97.26	7.87	0.94	1.42	1.39	7.58	7.53	7.58	49
超長期(11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
A格	1,813	99.07	99.28	3.42	1.02	1.35	1.35	3.29	3.26	3.28	71
短期(1-3)	1,079	99.35	99.53	2.14	0.92	1.24	1.24	2.11	2.10	2.11	68
中期(3-7)	602	98.25	98.47	4.04	0.97	1.41	1.40	3.96	3.93	3.95	73
長期(7-)	132	100.58	100.92	11.04	2.03	2.02	2.03	9.77	9.67	9.74	86
長期(7-11)	73	97.55	97.89	8.84	1.44	1.78	1.76	8.28	8.21	8.27	77
超長期(11-)	59	104.36	104.68	13.77	2.75	2.30	2.34	11.50	11.37	11.44	96
BBB格	1,670	98.24	98.54	4.18	1.24	1.70	1.69	3.90	3.87	3.90	101
短期(1-3)	791	99.14	99.42	2.19	1.10	1.51	1.50	2.16	2.14	2.16	94
中期(3-7)	659	98.04	98.34	4.19	1.18	1.70	1.69	4.08	4.04	4.08	101
長期(7-)	219	95.61	95.99	11.31	1.96	2.46	2.40	9.89	9.77	9.85	122
長期(7-11)	122	97.74	98.19	8.71	1.84	2.18	2.15	8.02	7.93	8.01	118
超長期(11-)	98	92.96	93.26	14.54	2.11	2.82	2.73	12.33	12.16	12.26	128
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12月末、1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	532	99.18	99.38	3.19	0.81	1.09	1.09	3.14	3.12	3.14	47
短期 (1-3)	329	99.44	99.62	2.30	0.77	1.04	1.04	2.28	2.27	2.28	47
中期 (3-7)	189	98.91	99.11	4.41	0.87	1.16	1.15	4.33	4.30	4.33	46
長期 (7-)	14	96.95	97.26	7.87	0.94	1.42	1.39	7.58	7.53	7.58	49
長期 (7-11)	14	96.95	97.26	7.87	0.94	1.42	1.39	7.58	7.53	7.58	49
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AAA~A 格	2,509	99.14	99.34	3.47	1.04	1.34	1.34	3.32	3.30	3.32	69
短期 (1-3)	1,538	99.41	99.59	2.21	0.97	1.25	1.25	2.18	2.17	2.18	69
中期 (3-7)	802	98.43	98.65	4.15	0.97	1.36	1.35	4.06	4.04	4.06	67
長期 (7-)	169	100.10	100.41	11.77	2.02	2.06	2.07	10.15	10.04	10.10	86
長期 (7-11)	96	97.67	98.00	8.80	1.45	1.78	1.76	8.24	8.17	8.24	78
超長期 (11-)	73	103.27	103.59	15.67	2.77	2.41	2.45	12.52	12.37	12.41	96
AAA~BBB 格	4,179	98.78	99.02	3.76	1.12	1.48	1.48	3.55	3.53	3.55	82
短期 (1-3)	2,353	99.30	99.51	2.21	1.01	1.34	1.34	2.18	2.17	2.18	78
中期 (3-7)	1,444	98.27	98.52	4.20	1.07	1.51	1.50	4.10	4.07	4.10	82
長期 (7-)	382	97.56	97.90	11.59	2.00	2.29	2.26	10.06	9.94	10.02	106
長期 (7-11)	211	97.71	98.09	8.80	1.67	2.01	1.99	8.16	8.08	8.16	100
超長期 (11-)	171	97.37	97.68	15.02	2.39	2.64	2.60	12.42	12.25	12.33	114
AAA~BB 格	4,179	98.78	99.02	3.76	1.12	1.48	1.48	3.55	3.53	3.55	82
短期 (1-3)	2,353	99.30	99.51	2.21	1.01	1.34	1.34	2.18	2.17	2.18	78
中期 (3-7)	1,444	98.27	98.52	4.20	1.07	1.51	1.50	4.10	4.07	4.10	82
長期 (7-)	382	97.56	97.90	11.59	2.00	2.29	2.26	10.06	9.94	10.02	106
長期 (7-11)	211	97.71	98.09	8.80	1.67	2.01	1.99	8.16	8.08	8.16	100
超長期 (11-)	171	97.37	97.68	15.02	2.39	2.64	2.60	12.42	12.25	12.33	114
AAA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA 格	532	99.18	99.38	3.19	0.81	1.09	1.09	3.14	3.12	3.14	47
短期 (1-3)	329	99.44	99.62	2.30	0.77	1.04	1.04	2.28	2.27	2.28	47
中期 (3-7)	189	98.91	99.11	4.41	0.87	1.16	1.15	4.33	4.30	4.33	46
長期 (7-)	14	96.95	97.26	7.87	0.94	1.42	1.39	7.58	7.53	7.58	49
長期 (7-11)	14	96.95	97.26	7.87	0.94	1.42	1.39	7.58	7.53	7.58	49
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
A 格	1,977	99.13	99.34	3.55	1.10	1.41	1.40	3.37	3.35	3.37	76
短期 (1-3)	1,209	99.40	99.58	2.18	1.02	1.31	1.31	2.16	2.14	2.16	75
中期 (3-7)	612	98.29	98.51	4.07	1.00	1.42	1.41	3.98	3.95	3.98	74
長期 (7-)	156	100.37	100.69	12.12	2.12	2.12	2.12	10.37	10.26	10.31	89
長期 (7-11)	82	97.79	98.12	8.96	1.54	1.84	1.82	8.35	8.28	8.35	83
超長期 (11-)	73	103.27	103.59	15.67	2.77	2.41	2.45	12.52	12.37	12.41	96
BBB 格	1,670	98.24	98.54	4.18	1.24	1.70	1.69	3.90	3.87	3.90	101
短期 (1-3)	815	99.09	99.37	2.21	1.08	1.51	1.50	2.18	2.17	2.18	94
中期 (3-7)	642	98.07	98.36	4.26	1.20	1.71	1.69	4.14	4.11	4.14	101
長期 (7-)	213	95.54	95.91	11.44	1.97	2.47	2.42	9.99	9.86	9.95	123
長期 (7-11)	115	97.73	98.16	8.80	1.86	2.19	2.17	8.09	8.01	8.09	119
超長期 (11-)	98	92.96	93.26	14.54	2.11	2.82	2.73	12.33	12.16	12.26	128
BB 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
B 格以下	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
格付なし	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

出所:NFRC

- 格付は、格付会社4社の最低格付をもとにNFRCで分類

円建外債 R&I 格付別・ポートフォリオ指標 (2024年12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	236	99.40	99.77	2.99	1.20	1.37	1.37	2.88	2.86	2.88	76
短期 (1-3)	166	99.72	100.13	2.10	1.15	1.29	1.28	2.07	2.06	2.07	73
中期 (3-7)	55	99.05	99.29	3.96	1.20	1.45	1.45	3.87	3.84	3.87	79
長期 (7-)	15	97.08	97.53	9.36	1.72	2.09	2.06	8.46	8.37	8.44	104
長期 (7-11)	11	97.80	98.20	7.65	1.62	1.95	1.93	7.18	7.12	7.18	105
超長期 (11-)	4	95.21	95.81	13.75	1.99	2.45	2.39	11.82	11.68	11.76	100
AAA~A 格	891	98.60	98.86	3.04	1.00	1.45	1.44	2.96	2.94	2.96	83
短期 (1-3)	505	99.24	99.48	2.09	0.93	1.31	1.31	2.07	2.05	2.07	75
中期 (3-7)	351	97.95	98.23	3.84	1.04	1.60	1.59	3.76	3.73	3.76	93
長期 (7-)	35	95.87	96.28	8.71	1.41	1.97	1.93	8.09	8.01	8.08	97
長期 (7-11)	31	95.95	96.34	8.03	1.33	1.91	1.87	7.59	7.52	7.59	96
超長期 (11-)	4	95.21	95.81	13.75	1.99	2.45	2.39	11.82	11.68	11.76	100
AAA~BBB 格	902	98.46	98.72	3.15	1.00	1.46	1.45	3.05	3.03	3.05	83
短期 (1-3)	505	99.24	99.48	2.09	0.93	1.31	1.31	2.07	2.05	2.07	75
中期 (3-7)	351	97.95	98.23	3.84	1.04	1.60	1.59	3.76	3.73	3.76	93
長期 (7-)	47	93.88	94.21	9.49	1.39	2.13	2.07	8.75	8.66	8.74	103
長期 (7-11)	31	95.95	96.34	8.03	1.33	1.91	1.87	7.59	7.52	7.59	96
超長期 (11-)	16	89.73	89.95	12.43	1.50	2.61	2.48	11.24	11.10	11.21	117
AAA~BB 格	902	98.46	98.72	3.15	1.00	1.46	1.45	3.05	3.03	3.05	83
短期 (1-3)	505	99.24	99.48	2.09	0.93	1.31	1.31	2.07	2.05	2.07	75
中期 (3-7)	351	97.95	98.23	3.84	1.04	1.60	1.59	3.76	3.73	3.76	93
長期 (7-)	47	93.88	94.21	9.49	1.39	2.13	2.07	8.75	8.66	8.74	103
長期 (7-11)	31	95.95	96.34	8.03	1.33	1.91	1.87	7.59	7.52	7.59	96
超長期 (11-)	16	89.73	89.95	12.43	1.50	2.61	2.48	11.24	11.10	11.21	117
AAA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA 格	236	99.40	99.77	2.99	1.20	1.37	1.37	2.88	2.86	2.88	76
短期 (1-3)	166	99.72	100.13	2.10	1.15	1.29	1.28	2.07	2.06	2.07	73
中期 (3-7)	55	99.05	99.29	3.96	1.20	1.45	1.45	3.87	3.84	3.87	79
長期 (7-)	15	97.08	97.53	9.36	1.72	2.09	2.06	8.46	8.37	8.44	104
長期 (7-11)	11	97.80	98.20	7.65	1.62	1.95	1.93	7.18	7.12	7.18	105
超長期 (11-)	4	95.21	95.81	13.75	1.99	2.45	2.39	11.82	11.68	11.76	100
A 格	655	98.31	98.53	3.06	0.92	1.48	1.47	2.99	2.97	2.99	85
短期 (1-3)	339	99.00	99.16	2.08	0.83	1.32	1.32	2.06	2.05	2.06	76
中期 (3-7)	296	97.75	98.03	3.82	1.01	1.63	1.61	3.74	3.71	3.74	96
長期 (7-)	20	94.98	95.36	8.22	1.18	1.89	1.84	7.82	7.74	7.81	91
長期 (7-11)	20	94.98	95.36	8.22	1.18	1.89	1.84	7.82	7.74	7.81	91
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
BBB 格	11	87.71	87.79	11.94	1.32	2.68	2.52	11.00	10.87	10.99	124
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	11	87.71	87.79	11.94	1.32	2.68	2.52	11.00	10.87	10.99	124
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	11	87.71	87.79	11.94	1.32	2.68	2.52	11.00	10.87	10.99	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	3,048	98.80	99.04	3.85	1.11	1.47	1.46	3.65	3.62	3.64	80
短期 (1-3)	1,669	99.29	99.50	2.20	0.97	1.31	1.31	2.17	2.16	2.17	75
中期 (3-7)	1,060	98.28	98.53	4.22	1.06	1.49	1.48	4.12	4.09	4.12	80
長期 (7-)	318	97.98	98.35	11.31	2.03	2.27	2.25	9.90	9.78	9.86	106
長期 (7-11)	177	97.92	98.32	8.82	1.70	2.00	1.98	8.17	8.09	8.16	100
超長期 (11-)	141	98.06	98.38	14.45	2.45	2.61	2.58	12.07	11.92	12.00	115

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12月末、1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	301	99.50	99.81	3.28	1.16	1.30	1.29	3.18	3.16	3.18	67
短期 (1-3)	191	99.74	100.11	2.20	1.11	1.23	1.23	2.18	2.16	2.18	67
中期 (3-7)	101	99.30	99.51	4.67	1.18	1.35	1.34	4.53	4.50	4.53	64
長期 (7-)	9	96.41	96.71	11.06	1.84	2.23	2.20	9.81	9.70	9.78	103
長期 (7-11)	4	97.56	97.57	8.49	1.70	2.03	2.01	7.94	7.86	7.93	106
超長期 (11-)	4	95.21	95.81	13.75	1.99	2.45	2.39	11.82	11.68	11.76	100
AAA~A 格	956	98.68	98.93	3.13	0.99	1.42	1.41	3.05	3.03	3.05	80
短期 (1-3)	556	99.18	99.42	2.17	0.92	1.30	1.30	2.15	2.13	2.15	74
中期 (3-7)	371	98.20	98.46	4.10	1.08	1.55	1.54	4.01	3.97	4.01	87
長期 (7-)	29	95.40	95.76	9.07	1.37	1.99	1.95	8.41	8.33	8.40	95
長期 (7-11)	25	95.43	95.75	8.27	1.27	1.91	1.87	7.84	7.76	7.83	94
超長期 (11-)	4	95.21	95.81	13.75	1.99	2.45	2.39	11.82	11.68	11.76	100
AAA~BBB 格	967	98.55	98.80	3.23	1.00	1.43	1.42	3.13	3.11	3.13	80
短期 (1-3)	556	99.18	99.42	2.17	0.92	1.30	1.30	2.15	2.13	2.15	74
中期 (3-7)	371	98.20	98.46	4.10	1.08	1.55	1.54	4.01	3.97	4.01	87
長期 (7-)	40	93.23	93.51	9.88	1.36	2.17	2.10	9.10	9.00	9.09	103
長期 (7-11)	25	95.43	95.75	8.27	1.27	1.91	1.87	7.84	7.76	7.83	94
超長期 (11-)	16	89.73	89.95	12.43	1.50	2.61	2.48	11.24	11.10	11.21	117
AAA~BB 格	967	98.55	98.80	3.23	1.00	1.43	1.42	3.13	3.11	3.13	80
短期 (1-3)	556	99.18	99.42	2.17	0.92	1.30	1.30	2.15	2.13	2.15	74
中期 (3-7)	371	98.20	98.46	4.10	1.08	1.55	1.54	4.01	3.97	4.01	87
長期 (7-)	40	93.23	93.51	9.88	1.36	2.17	2.10	9.10	9.00	9.09	103
長期 (7-11)	25	95.43	95.75	8.27	1.27	1.91	1.87	7.84	7.76	7.83	94
超長期 (11-)	16	89.73	89.95	12.43	1.50	2.61	2.48	11.24	11.10	11.21	117
AAA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA 格	301	99.50	99.81	3.28	1.16	1.30	1.29	3.18	3.16	3.18	67
短期 (1-3)	191	99.74	100.11	2.20	1.11	1.23	1.23	2.18	2.16	2.18	67
中期 (3-7)	101	99.30	99.51	4.67	1.18	1.35	1.34	4.53	4.50	4.53	64
長期 (7-)	9	96.41	96.71	11.06	1.84	2.23	2.20	9.81	9.70	9.78	103
長期 (7-11)	4	97.56	97.57	8.49	1.70	2.03	2.01	7.94	7.86	7.93	106
超長期 (11-)	4	95.21	95.81	13.75	1.99	2.45	2.39	11.82	11.68	11.76	100
A 格	655	98.31	98.53	3.06	0.92	1.48	1.47	2.99	2.97	2.99	85
短期 (1-3)	365	98.89	99.06	2.15	0.82	1.34	1.34	2.13	2.12	2.13	78
中期 (3-7)	270	97.78	98.06	3.89	1.04	1.63	1.62	3.80	3.77	3.80	96
長期 (7-)	20	94.98	95.36	8.22	1.18	1.89	1.84	7.82	7.74	7.81	91
長期 (7-11)	20	94.98	95.36	8.22	1.18	1.89	1.84	7.82	7.74	7.81	91
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
BBB 格	11	87.71	87.79	11.94	1.32	2.68	2.52	11.00	10.87	10.99	124
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	11	87.71	87.79	11.94	1.32	2.68	2.52	11.00	10.87	10.99	124
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	11	87.71	87.79	11.94	1.32	2.68	2.52	11.00	10.87	10.99	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	3,212	98.85	99.09	3.91	1.16	1.50	1.49	3.68	3.65	3.68	82
短期 (1-3)	1,797	99.33	99.54	2.22	1.04	1.35	1.35	2.19	2.18	2.19	79
中期 (3-7)	1,073	98.30	98.54	4.24	1.07	1.50	1.49	4.13	4.10	4.13	81
長期 (7-)	342	98.07	98.42	11.79	2.07	2.30	2.28	10.17	10.05	10.12	107
長期 (7-11)	186	98.01	98.40	8.87	1.73	2.02	2.00	8.20	8.12	8.20	101
超長期 (11-)	155	98.14	98.46	15.28	2.48	2.64	2.61	12.52	12.36	12.43	113

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12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	325	99.17	99.48	3.09	1.02	1.28	1.27	3.00	2.98	3.00	66
短期 (1-3)	224	99.55	99.90	2.23	0.95	1.17	1.17	2.20	2.19	2.20	61
中期 (3-7)	79	98.98	99.17	3.99	1.11	1.39	1.38	3.90	3.87	3.90	72
長期 (7-)	22	95.98	96.37	8.63	1.36	1.93	1.89	7.98	7.90	7.97	93
長期 (7-11)	18	96.16	96.50	7.44	1.21	1.81	1.78	7.09	7.03	7.09	92
超長期 (11-)	4	95.21	95.81	13.75	1.99	2.45	2.39	11.82	11.68	11.76	100
AAA~A 格	1,206	98.88	99.22	4.19	1.37	1.68	1.67	3.89	3.85	3.88	98
短期 (1-3)	732	99.47	99.79	2.22	1.24	1.48	1.47	2.18	2.17	2.18	91
中期 (3-7)	274	97.84	98.17	4.17	1.15	1.71	1.70	4.06	4.03	4.06	102
長期 (7-)	200	98.16	98.58	11.47	2.17	2.41	2.38	9.96	9.84	9.92	118
長期 (7-11)	82	97.16	97.68	8.20	1.70	2.14	2.11	7.62	7.53	7.61	119
超長期 (11-)	118	98.86	99.21	13.76	2.50	2.59	2.57	11.57	11.42	11.51	118
AAA~BBB 格	1,240	98.88	99.23	4.19	1.40	1.71	1.70	3.88	3.84	3.87	101
短期 (1-3)	754	99.47	99.79	2.23	1.26	1.50	1.50	2.20	2.18	2.20	94
中期 (3-7)	286	97.85	98.20	4.25	1.22	1.78	1.76	4.12	4.08	4.12	108
長期 (7-)	200	98.16	98.58	11.47	2.17	2.41	2.38	9.96	9.84	9.92	118
長期 (7-11)	82	97.16	97.68	8.20	1.70	2.14	2.11	7.62	7.53	7.61	119
超長期 (11-)	118	98.86	99.21	13.76	2.50	2.59	2.57	11.57	11.42	11.51	118
AAA~BB 格	1,240	98.88	99.23	4.19	1.40	1.71	1.70	3.88	3.84	3.87	101
短期 (1-3)	754	99.47	99.79	2.23	1.26	1.50	1.50	2.20	2.18	2.20	94
中期 (3-7)	286	97.85	98.20	4.25	1.22	1.78	1.76	4.12	4.08	4.12	108
長期 (7-)	200	98.16	98.58	11.47	2.17	2.41	2.38	9.96	9.84	9.92	118
長期 (7-11)	82	97.16	97.68	8.20	1.70	2.14	2.11	7.62	7.53	7.61	119
超長期 (11-)	118	98.86	99.21	13.76	2.50	2.59	2.57	11.57	11.42	11.51	118
AAA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA 格	325	99.17	99.48	3.09	1.02	1.28	1.27	3.00	2.98	3.00	66
短期 (1-3)	224	99.55	99.90	2.23	0.95	1.17	1.17	2.20	2.19	2.20	61
中期 (3-7)	79	98.98	99.17	3.99	1.11	1.39	1.38	3.90	3.87	3.90	72
長期 (7-)	22	95.98	96.37	8.63	1.36	1.93	1.89	7.98	7.90	7.97	93
長期 (7-11)	18	96.16	96.50	7.44	1.21	1.81	1.78	7.09	7.03	7.09	92
超長期 (11-)	4	95.21	95.81	13.75	1.99	2.45	2.39	11.82	11.68	11.76	100
A 格	881	98.78	99.12	4.60	1.50	1.83	1.82	4.22	4.17	4.21	110
短期 (1-3)	508	99.43	99.74	2.21	1.36	1.61	1.61	2.18	2.16	2.18	105
中期 (3-7)	196	97.38	97.77	4.25	1.16	1.85	1.83	4.13	4.09	4.13	115
長期 (7-)	178	98.43	98.86	11.83	2.27	2.46	2.44	10.20	10.08	10.16	121
長期 (7-11)	64	97.44	98.01	8.41	1.83	2.23	2.21	7.76	7.67	7.75	126
超長期 (11-)	113	98.99	99.34	13.76	2.52	2.59	2.58	11.56	11.42	11.51	119
BBB 格	34	98.88	99.40	3.91	2.35	2.66	2.65	3.68	3.63	3.68	200
短期 (1-3)	22	99.33	99.79	2.77	2.10	2.36	2.35	2.70	2.66	2.70	176
中期 (3-7)	12	98.06	98.68	6.01	2.81	3.22	3.19	5.50	5.42	5.50	243
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	2,710	98.65	98.85	3.47	0.94	1.36	1.35	3.34	3.32	3.34	71
短期 (1-3)	1,420	99.18	99.34	2.14	0.81	1.21	1.20	2.12	2.11	2.12	65
中期 (3-7)	1,125	98.29	98.52	4.10	1.01	1.45	1.44	4.01	3.98	4.01	77
長期 (7-)	165	96.60	96.89	10.61	1.68	2.07	2.03	9.50	9.41	9.48	91
長期 (7-11)	126	97.92	98.24	9.03	1.61	1.89	1.87	8.38	8.31	8.38	87
超長期 (11-)	39	92.31	92.50	15.73	1.91	2.68	2.59	13.36	13.19	13.27	104

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12月末、1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	325	99.17	99.48	3.09	1.02	1.28	1.27	3.00	2.98	3.00	66
短期 (1-3)	224	99.55	99.90	2.23	0.95	1.17	1.17	2.20	2.19	2.20	61
中期 (3-7)	85	98.90	99.13	4.22	1.15	1.43	1.42	4.11	4.08	4.11	74
長期 (7-)	16	95.18	95.45	9.26	1.27	1.94	1.90	8.53	8.45	8.51	88
長期 (7-11)	12	95.16	95.31	7.64	1.02	1.76	1.72	7.33	7.27	7.33	84
超長期 (11-)	4	95.21	95.81	13.75	1.99	2.45	2.39	11.82	11.68	11.76	100
AAA~A 格	1,370	98.99	99.31	4.30	1.44	1.72	1.71	3.94	3.90	3.93	102
短期 (1-3)	860	99.53	99.83	2.27	1.33	1.54	1.54	2.23	2.22	2.23	97
中期 (3-7)	293	97.92	98.26	4.29	1.19	1.73	1.71	4.17	4.13	4.17	103
長期 (7-)	217	98.28	98.67	12.33	2.24	2.45	2.43	10.48	10.35	10.42	118
長期 (7-11)	85	97.38	97.85	8.47	1.77	2.18	2.15	7.83	7.75	7.83	120
超長期 (11-)	132	98.86	99.20	14.81	2.54	2.63	2.61	12.16	12.00	12.07	116
AAA~BBB 格	1,404	98.99	99.31	4.29	1.46	1.75	1.74	3.93	3.90	3.93	104
短期 (1-3)	882	99.53	99.83	2.28	1.35	1.56	1.56	2.24	2.23	2.24	99
中期 (3-7)	305	97.93	98.28	4.36	1.25	1.78	1.77	4.22	4.18	4.22	108
長期 (7-)	217	98.28	98.67	12.33	2.24	2.45	2.43	10.48	10.35	10.42	118
長期 (7-11)	85	97.38	97.85	8.47	1.77	2.18	2.15	7.83	7.75	7.83	120
超長期 (11-)	132	98.86	99.20	14.81	2.54	2.63	2.61	12.16	12.00	12.07	116
AAA~BB 格	1,404	98.99	99.31	4.29	1.46	1.75	1.74	3.93	3.90	3.93	104
短期 (1-3)	882	99.53	99.83	2.28	1.35	1.56	1.56	2.24	2.23	2.24	99
中期 (3-7)	305	97.93	98.28	4.36	1.25	1.78	1.77	4.22	4.18	4.22	108
長期 (7-)	217	98.28	98.67	12.33	2.24	2.45	2.43	10.48	10.35	10.42	118
長期 (7-11)	85	97.38	97.85	8.47	1.77	2.18	2.15	7.83	7.75	7.83	120
超長期 (11-)	132	98.86	99.20	14.81	2.54	2.63	2.61	12.16	12.00	12.07	116
AAA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA 格	325	99.17	99.48	3.09	1.02	1.28	1.27	3.00	2.98	3.00	66
短期 (1-3)	224	99.55	99.90	2.23	0.95	1.17	1.17	2.20	2.19	2.20	61
中期 (3-7)	85	98.90	99.13	4.22	1.15	1.43	1.42	4.11	4.08	4.11	74
長期 (7-)	16	95.18	95.45	9.26	1.27	1.94	1.90	8.53	8.45	8.51	88
長期 (7-11)	12	95.16	95.31	7.64	1.02	1.76	1.72	7.33	7.27	7.33	84
超長期 (11-)	4	95.21	95.81	13.75	1.99	2.45	2.39	11.82	11.68	11.76	100
A 格	1,045	98.93	99.26	4.67	1.57	1.86	1.85	4.23	4.19	4.22	113
短期 (1-3)	636	99.53	99.81	2.28	1.46	1.67	1.67	2.24	2.22	2.24	110
中期 (3-7)	208	97.52	97.90	4.32	1.21	1.85	1.83	4.19	4.15	4.19	115
長期 (7-)	201	98.53	98.93	12.57	2.31	2.49	2.47	10.62	10.49	10.56	120
長期 (7-11)	74	97.73	98.26	8.60	1.89	2.24	2.22	7.91	7.82	7.90	126
超長期 (11-)	128	98.98	99.31	14.85	2.56	2.63	2.61	12.17	12.01	12.08	117
BBB 格	34	98.88	99.40	3.91	2.35	2.66	2.65	3.68	3.63	3.68	200
短期 (1-3)	22	99.33	99.79	2.77	2.10	2.36	2.35	2.70	2.66	2.70	176
中期 (3-7)	12	98.06	98.68	6.01	2.81	3.22	3.19	5.50	5.42	5.50	243
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	2,775	98.68	98.88	3.49	0.95	1.35	1.34	3.36	3.34	3.36	71
短期 (1-3)	1,471	99.16	99.32	2.17	0.81	1.21	1.20	2.15	2.13	2.15	65
中期 (3-7)	1,139	98.36	98.59	4.16	1.02	1.44	1.43	4.07	4.04	4.07	75
長期 (7-)	165	96.60	96.89	10.61	1.68	2.07	2.03	9.50	9.41	9.48	91
長期 (7-11)	126	97.92	98.24	9.03	1.61	1.89	1.87	8.38	8.31	8.38	87
超長期 (11-)	39	92.31	92.50	15.73	1.91	2.68	2.59	13.36	13.19	13.27	104

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12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	1,414	98.82	99.02	3.24	0.83	1.22	1.22	3.17	3.15	3.17	59
短期 (1-3)	784	99.16	99.33	2.23	0.72	1.12	1.12	2.21	2.20	2.21	55
中期 (3-7)	573	98.48	98.71	4.08	0.94	1.32	1.31	3.99	3.97	3.99	64
長期 (7-)	58	97.56	97.89	8.72	1.31	1.65	1.63	8.22	8.15	8.22	65
長期 (7-11)	58	97.56	97.89	8.72	1.31	1.65	1.63	8.22	8.15	8.22	65
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AAA~A 格	2,335	99.05	99.25	3.38	0.97	1.30	1.30	3.27	3.24	3.26	66
短期 (1-3)	1,392	99.35	99.53	2.17	0.87	1.18	1.17	2.15	2.14	2.15	61
中期 (3-7)	783	98.30	98.52	4.05	0.94	1.38	1.36	3.96	3.94	3.96	70
長期 (7-)	161	100.00	100.35	10.65	1.94	2.01	2.01	9.50	9.40	9.48	87
長期 (7-11)	103	97.51	97.88	8.87	1.48	1.83	1.81	8.28	8.20	8.27	82
超長期 (11-)	59	104.36	104.68	13.77	2.75	2.30	2.34	11.50	11.37	11.44	96
AAA~BBB 格	3,796	98.74	98.98	3.73	1.06	1.44	1.43	3.55	3.52	3.54	77
短期 (1-3)	2,061	99.30	99.52	2.18	0.93	1.26	1.26	2.15	2.14	2.15	70
中期 (3-7)	1,370	98.22	98.48	4.12	1.04	1.49	1.48	4.02	4.00	4.02	81
長期 (7-)	365	97.45	97.82	11.08	1.95	2.25	2.23	9.76	9.65	9.72	106
長期 (7-11)	208	97.62	98.02	8.70	1.64	1.99	1.97	8.08	8.00	8.08	99
超長期 (11-)	157	97.23	97.54	14.25	2.35	2.61	2.57	11.99	11.84	11.93	115
AAA~BB 格	3,796	98.74	98.98	3.73	1.06	1.44	1.43	3.55	3.52	3.54	77
短期 (1-3)	2,061	99.30	99.52	2.18	0.93	1.26	1.26	2.15	2.14	2.15	70
中期 (3-7)	1,370	98.22	98.48	4.12	1.04	1.49	1.48	4.02	4.00	4.02	81
長期 (7-)	365	97.45	97.82	11.08	1.95	2.25	2.23	9.76	9.65	9.72	106
長期 (7-11)	208	97.62	98.02	8.70	1.64	1.99	1.97	8.08	8.00	8.08	99
超長期 (11-)	157	97.23	97.54	14.25	2.35	2.61	2.57	11.99	11.84	11.93	115
AAA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA 格	1,414	98.82	99.02	3.24	0.83	1.22	1.22	3.17	3.15	3.17	59
短期 (1-3)	784	99.16	99.33	2.23	0.72	1.12	1.12	2.21	2.20	2.21	55
中期 (3-7)	573	98.48	98.71	4.08	0.94	1.32	1.31	3.99	3.97	3.99	64
長期 (7-)	58	97.56	97.89	8.72	1.31	1.65	1.63	8.22	8.15	8.22	65
長期 (7-11)	58	97.56	97.89	8.72	1.31	1.65	1.63	8.22	8.15	8.22	65
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
A 格	921	99.39	99.60	3.60	1.17	1.42	1.41	3.41	3.38	3.40	76
短期 (1-3)	608	99.60	99.79	2.09	1.06	1.25	1.25	2.07	2.06	2.07	69
中期 (3-7)	210	97.81	97.99	3.96	0.95	1.52	1.50	3.88	3.85	3.88	84
長期 (7-)	103	101.37	101.73	11.73	2.29	2.20	2.22	10.19	10.08	10.15	99
長期 (7-11)	45	97.45	97.86	9.06	1.69	2.07	2.05	8.35	8.26	8.34	104
超長期 (11-)	59	104.36	104.68	13.77	2.75	2.30	2.34	11.50	11.37	11.44	96
BBB 格	1,460	98.24	98.55	4.29	1.22	1.66	1.65	4.00	3.96	3.99	96
短期 (1-3)	670	99.20	99.50	2.19	1.05	1.44	1.44	2.16	2.14	2.16	88
中期 (3-7)	587	98.13	98.42	4.22	1.16	1.65	1.64	4.11	4.07	4.11	96
長期 (7-)	204	95.44	95.80	11.42	1.95	2.46	2.41	9.97	9.85	9.93	122
長期 (7-11)	106	97.73	98.16	8.54	1.80	2.14	2.12	7.89	7.81	7.89	116
超長期 (11-)	98	92.96	93.26	14.54	2.11	2.82	2.73	12.33	12.16	12.26	128
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	154	98.41	98.63	2.70	1.63	2.23	2.22	2.62	2.59	2.62	164
短期 (1-3)	113	98.83	99.00	2.08	1.63	2.19	2.18	2.05	2.03	2.05	163
中期 (3-7)	41	97.27	97.62	4.41	1.61	2.36	2.33	4.21	4.16	4.21	165
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
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12月末、1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	538	99.16	99.35	3.22	0.82	1.10	1.09	3.16	3.15	3.16	47
短期 (1-3)	329	99.44	99.62	2.30	0.77	1.04	1.04	2.28	2.27	2.28	47
中期 (3-7)	195	98.86	99.06	4.46	0.88	1.17	1.17	4.37	4.34	4.37	48
長期 (7-)	14	96.95	97.26	7.87	0.94	1.42	1.39	7.58	7.53	7.58	49
長期 (7-11)	14	96.95	97.26	7.87	0.94	1.42	1.39	7.58	7.53	7.58	49
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AAA~A 格	2,498	99.09	99.29	3.54	0.99	1.31	1.30	3.38	3.36	3.38	66
短期 (1-3)	1,485	99.39	99.56	2.22	0.89	1.18	1.17	2.19	2.18	2.19	61
中期 (3-7)	830	98.39	98.60	4.12	0.96	1.36	1.35	4.03	4.00	4.03	68
長期 (7-)	183	99.91	100.24	11.63	2.01	2.08	2.08	10.06	9.95	10.01	88
長期 (7-11)	110	97.66	98.01	8.93	1.51	1.84	1.82	8.33	8.25	8.32	83
超長期 (11-)	73	103.27	103.59	15.67	2.77	2.41	2.45	12.52	12.37	12.41	96
AAA~BBB 格	3,958	98.78	99.02	3.81	1.08	1.44	1.43	3.61	3.58	3.60	77
短期 (1-3)	2,179	99.31	99.52	2.22	0.94	1.26	1.26	2.19	2.18	2.19	70
中期 (3-7)	1,399	98.30	98.54	4.19	1.05	1.48	1.47	4.09	4.06	4.09	80
長期 (7-)	380	97.54	97.89	11.60	1.99	2.28	2.25	10.07	9.95	10.03	105
長期 (7-11)	209	97.69	98.07	8.79	1.65	1.99	1.97	8.16	8.08	8.15	99
超長期 (11-)	171	97.37	97.68	15.02	2.39	2.64	2.60	12.42	12.25	12.33	114
AAA~BB 格	3,958	98.78	99.02	3.81	1.08	1.44	1.43	3.61	3.58	3.60	77
短期 (1-3)	2,179	99.31	99.52	2.22	0.94	1.26	1.26	2.19	2.18	2.19	70
中期 (3-7)	1,399	98.30	98.54	4.19	1.05	1.48	1.47	4.09	4.06	4.09	80
長期 (7-)	380	97.54	97.89	11.60	1.99	2.28	2.25	10.07	9.95	10.03	105
長期 (7-11)	209	97.69	98.07	8.79	1.65	1.99	1.97	8.16	8.08	8.15	99
超長期 (11-)	171	97.37	97.68	15.02	2.39	2.64	2.60	12.42	12.25	12.33	114
AAA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA 格	538	99.16	99.35	3.22	0.82	1.10	1.09	3.16	3.15	3.16	47
短期 (1-3)	329	99.44	99.62	2.30	0.77	1.04	1.04	2.28	2.27	2.28	47
中期 (3-7)	195	98.86	99.06	4.46	0.88	1.17	1.17	4.37	4.34	4.37	48
長期 (7-)	14	96.95	97.26	7.87	0.94	1.42	1.39	7.58	7.53	7.58	49
長期 (7-11)	14	96.95	97.26	7.87	0.94	1.42	1.39	7.58	7.53	7.58	49
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
A 格	1,960	99.08	99.28	3.62	1.04	1.36	1.36	3.44	3.41	3.44	71
短期 (1-3)	1,156	99.37	99.54	2.19	0.92	1.22	1.21	2.17	2.16	2.17	65
中期 (3-7)	635	98.25	98.47	4.01	0.98	1.42	1.41	3.93	3.90	3.93	75
長期 (7-)	169	100.15	100.49	11.94	2.10	2.13	2.13	10.26	10.14	10.20	91
長期 (7-11)	96	97.76	98.12	9.09	1.59	1.90	1.88	8.43	8.35	8.43	87
超長期 (11-)	73	103.27	103.59	15.67	2.77	2.41	2.45	12.52	12.37	12.41	96
BBB 格	1,460	98.24	98.55	4.29	1.22	1.66	1.65	4.00	3.96	3.99	96
短期 (1-3)	694	99.14	99.44	2.22	1.04	1.45	1.44	2.19	2.17	2.19	88
中期 (3-7)	570	98.15	98.46	4.30	1.18	1.66	1.64	4.18	4.15	4.18	96
長期 (7-)	197	95.35	95.71	11.56	1.96	2.48	2.42	10.08	9.95	10.04	122
長期 (7-11)	99	97.71	98.13	8.63	1.81	2.15	2.13	7.97	7.89	7.97	117
超長期 (11-)	98	92.96	93.26	14.54	2.11	2.82	2.73	12.33	12.16	12.26	128
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	221	98.84	99.08	2.70	1.89	2.34	2.33	2.60	2.57	2.60	174
短期 (1-3)	174	99.19	99.40	2.12	1.92	2.31	2.30	2.08	2.05	2.08	175
中期 (3-7)	44	97.44	97.79	4.59	1.72	2.41	2.39	4.37	4.32	4.37	169
長期 (7-)	2	99.48	99.84	9.89	3.29	3.36	3.35	8.49	8.35	8.47	229
長期 (7-11)	2	99.48	99.84	9.89	3.29	3.36	3.35	8.49	8.35	8.47	229
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

出所:NFRC

- 格付は、Moody's の格付をもとに NFRC で分類

円建外債 S&P 格付別・ポートフォリオ指標 (2024年12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	491	99.13	99.35	3.08	0.78	1.07	1.06	3.03	3.02	3.03	45
短期 (1-3)	323	99.44	99.65	2.34	0.76	1.01	1.01	2.32	2.31	2.32	44
中期 (3-7)	154	98.67	98.90	4.21	0.81	1.16	1.16	4.13	4.11	4.13	48
長期 (7-)	14	96.95	97.26	7.87	0.94	1.42	1.39	7.58	7.53	7.58	49
長期 (7-11)	14	96.95	97.26	7.87	0.94	1.42	1.39	7.58	7.53	7.58	49
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AAA~A 格	2,281	99.06	99.26	3.35	0.96	1.29	1.29	3.24	3.21	3.24	66
短期 (1-3)	1,367	99.34	99.53	2.18	0.87	1.18	1.18	2.16	2.15	2.16	62
中期 (3-7)	770	98.31	98.53	4.04	0.94	1.37	1.36	3.96	3.93	3.96	69
長期 (7-)	143	100.35	100.69	10.79	1.94	1.97	1.97	9.61	9.51	9.58	82
長期 (7-11)	85	97.57	97.91	8.72	1.39	1.72	1.70	8.20	8.13	8.19	73
超長期 (11-)	59	104.36	104.68	13.77	2.75	2.30	2.34	11.50	11.37	11.44	96
AAA~BBB 格	3,890	98.72	98.97	3.72	1.08	1.46	1.45	3.53	3.50	3.53	80
短期 (1-3)	2,123	99.28	99.50	2.18	0.95	1.29	1.29	2.16	2.14	2.16	73
中期 (3-7)	1,405	98.20	98.46	4.13	1.05	1.52	1.51	4.03	4.00	4.03	84
長期 (7-)	363	97.48	97.84	11.11	1.96	2.26	2.23	9.77	9.66	9.74	106
長期 (7-11)	206	97.67	98.07	8.72	1.65	1.99	1.97	8.09	8.01	8.09	100
超長期 (11-)	157	97.23	97.54	14.25	2.35	2.61	2.57	11.99	11.84	11.93	115
AAA~BB 格	3,890	98.72	98.97	3.72	1.08	1.46	1.45	3.53	3.50	3.53	80
短期 (1-3)	2,123	99.28	99.50	2.18	0.95	1.29	1.29	2.16	2.14	2.16	73
中期 (3-7)	1,405	98.20	98.46	4.13	1.05	1.52	1.51	4.03	4.00	4.03	84
長期 (7-)	363	97.48	97.84	11.11	1.96	2.26	2.23	9.77	9.66	9.74	106
長期 (7-11)	206	97.67	98.07	8.72	1.65	1.99	1.97	8.09	8.01	8.09	100
超長期 (11-)	157	97.23	97.54	14.25	2.35	2.61	2.57	11.99	11.84	11.93	115
AAA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA 格	491	99.13	99.35	3.08	0.78	1.07	1.06	3.03	3.02	3.03	45
短期 (1-3)	323	99.44	99.65	2.34	0.76	1.01	1.01	2.32	2.31	2.32	44
中期 (3-7)	154	98.67	98.90	4.21	0.81	1.16	1.16	4.13	4.11	4.13	48
長期 (7-)	14	96.95	97.26	7.87	0.94	1.42	1.39	7.58	7.53	7.58	49
長期 (7-11)	14	96.95	97.26	7.87	0.94	1.42	1.39	7.58	7.53	7.58	49
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
A 格	1,790	99.04	99.24	3.42	1.01	1.36	1.35	3.29	3.27	3.29	71
短期 (1-3)	1,044	99.31	99.49	2.13	0.91	1.23	1.23	2.11	2.10	2.11	67
中期 (3-7)	616	98.22	98.44	4.00	0.97	1.42	1.41	3.91	3.89	3.91	74
長期 (7-)	130	100.71	101.05	11.10	2.05	2.02	2.03	9.81	9.71	9.78	86
長期 (7-11)	71	97.69	98.04	8.89	1.47	1.78	1.76	8.32	8.25	8.31	77
超長期 (11-)	59	104.36	104.68	13.77	2.75	2.30	2.34	11.50	11.37	11.44	96
BBB 格	1,610	98.25	98.55	4.23	1.25	1.70	1.69	3.95	3.91	3.95	100
短期 (1-3)	756	99.16	99.44	2.18	1.09	1.49	1.49	2.15	2.14	2.15	93
中期 (3-7)	635	98.08	98.38	4.23	1.20	1.70	1.69	4.12	4.08	4.12	101
長期 (7-)	219	95.61	95.99	11.31	1.96	2.46	2.40	9.89	9.77	9.85	122
長期 (7-11)	122	97.74	98.19	8.71	1.84	2.18	2.15	8.02	7.93	8.01	118
超長期 (11-)	98	92.96	93.26	14.54	2.11	2.82	2.73	12.33	12.16	12.26	128
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	59	98.76	98.94	2.17	1.52	2.02	2.01	2.12	2.10	2.12	146
短期 (1-3)	51	99.31	99.50	1.70	1.68	2.10	2.09	1.67	1.66	1.67	156
中期 (3-7)	6	96.31	96.37	4.39	0.58	1.48	1.45	4.34	4.31	4.34	76
長期 (7-)	2	92.76	92.97	7.10	0.51	1.65	1.59	6.96	6.90	6.96	76
長期 (7-11)	2	92.76	92.97	7.10	0.51	1.65	1.59	6.96	6.90	6.96	76
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

出所:NFRC

- 格付は、S&P の格付をもとに NFRC で分類

円建外債 S&P 格付別・ポートフォリオ指標 (2024年12月末、1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	556	99.21	99.42	3.23	0.80	1.06	1.06	3.17	3.16	3.17	44
短期 (1-3)	348	99.47	99.67	2.38	0.76	1.00	1.00	2.36	2.35	2.36	43
中期 (3-7)	194	98.91	99.12	4.42	0.87	1.15	1.15	4.33	4.31	4.33	46
長期 (7-)	14	96.95	97.26	7.87	0.94	1.42	1.39	7.58	7.53	7.58	49
長期 (7-11)	14	96.95	97.26	7.87	0.94	1.42	1.39	7.58	7.53	7.58	49
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AAA~A 格	2,443	99.11	99.31	3.51	0.99	1.30	1.29	3.36	3.33	3.35	65
短期 (1-3)	1,461	99.38	99.56	2.23	0.89	1.18	1.18	2.21	2.19	2.21	62
中期 (3-7)	817	98.40	98.62	4.11	0.95	1.36	1.35	4.03	4.00	4.03	68
長期 (7-)	165	100.20	100.52	11.86	2.02	2.05	2.06	10.21	10.10	10.16	84
長期 (7-11)	92	97.75	98.07	8.82	1.43	1.74	1.73	8.27	8.19	8.26	74
超長期 (11-)	73	103.27	103.59	15.67	2.77	2.41	2.45	12.52	12.37	12.41	96
AAA~BBB 格	4,053	98.77	99.01	3.80	1.09	1.46	1.45	3.59	3.56	3.59	79
短期 (1-3)	2,241	99.28	99.50	2.22	0.95	1.29	1.29	2.20	2.18	2.20	73
中期 (3-7)	1,434	98.27	98.53	4.20	1.07	1.51	1.50	4.09	4.06	4.09	82
長期 (7-)	378	97.57	97.92	11.62	2.00	2.28	2.26	10.09	9.97	10.04	106
長期 (7-11)	207	97.74	98.12	8.81	1.67	1.99	1.97	8.17	8.09	8.16	99
超長期 (11-)	171	97.37	97.68	15.02	2.39	2.64	2.60	12.42	12.25	12.33	114
AAA~BB 格	4,053	98.77	99.01	3.80	1.09	1.46	1.45	3.59	3.56	3.59	79
短期 (1-3)	2,241	99.28	99.50	2.22	0.95	1.29	1.29	2.20	2.18	2.20	73
中期 (3-7)	1,434	98.27	98.53	4.20	1.07	1.51	1.50	4.09	4.06	4.09	82
長期 (7-)	378	97.57	97.92	11.62	2.00	2.28	2.26	10.09	9.97	10.04	106
長期 (7-11)	207	97.74	98.12	8.81	1.67	1.99	1.97	8.17	8.09	8.16	99
超長期 (11-)	171	97.37	97.68	15.02	2.39	2.64	2.60	12.42	12.25	12.33	114
AAA 格	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期 (1-3)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中期 (3-7)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
長期 (7-11)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AA 格	556	99.21	99.42	3.23	0.80	1.06	1.06	3.17	3.16	3.17	44
短期 (1-3)	348	99.47	99.67	2.38	0.76	1.00	1.00	2.36	2.35	2.36	43
中期 (3-7)	194	98.91	99.12	4.42	0.87	1.15	1.15	4.33	4.31	4.33	46
長期 (7-)	14	96.95	97.26	7.87	0.94	1.42	1.39	7.58	7.53	7.58	49
長期 (7-11)	14	96.95	97.26	7.87	0.94	1.42	1.39	7.58	7.53	7.58	49
超長期 (11-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
A 格	1,887	99.07	99.28	3.59	1.04	1.37	1.36	3.41	3.39	3.41	71
短期 (1-3)	1,113	99.35	99.52	2.18	0.93	1.24	1.24	2.16	2.14	2.16	68
中期 (3-7)	623	98.24	98.46	4.01	0.98	1.42	1.41	3.93	3.90	3.93	75
長期 (7-)	151	100.50	100.82	12.22	2.12	2.11	2.11	10.44	10.33	10.39	87
長期 (7-11)	78	97.89	98.22	8.98	1.52	1.80	1.78	8.39	8.31	8.38	79
超長期 (11-)	73	103.27	103.59	15.67	2.77	2.41	2.45	12.52	12.37	12.41	96
BBB 格	1,610	98.25	98.55	4.23	1.25	1.70	1.69	3.95	3.91	3.95	100
短期 (1-3)	780	99.11	99.39	2.21	1.08	1.50	1.49	2.18	2.16	2.18	93
中期 (3-7)	617	98.11	98.40	4.31	1.22	1.71	1.69	4.18	4.15	4.18	101
長期 (7-)	213	95.54	95.91	11.44	1.97	2.47	2.42	9.99	9.86	9.95	123
長期 (7-11)	115	97.73	98.16	8.80	1.86	2.19	2.17	8.09	8.01	8.09	119
超長期 (11-)	98	92.96	93.26	14.54	2.11	2.82	2.73	12.33	12.16	12.26	128
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	126	99.33	99.56	2.44	2.04	2.31	2.31	2.35	2.32	2.35	174
短期 (1-3)	112	99.61	99.84	1.96	2.10	2.33	2.32	1.92	1.90	1.92	178
中期 (3-7)	9	97.47	97.63	5.28	1.44	2.06	2.04	5.03	4.98	5.03	131
長期 (7-)	5	96.20	96.48	8.53	1.93	2.55	2.52	7.77	7.67	7.76	157
長期 (7-11)	5	96.20	96.48	8.53	1.93	2.55	2.52	7.77	7.67	7.76	157
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12月末
銘柄数	14,003	14,825	15,436	15,639	16,113	16,212
額面(10億円)	972,326	1,018,210	1,056,757	1,085,263	1,124,834	1,144,227
時価単価(円)	108.39	106.48	104.19	101.51	98.40	95.32
利含単価(円)	108.52	106.59	104.30	101.61	98.50	95.47
残存年数(年)	9.84	9.89	10.01	10.16	10.21	10.25
利率(%)	0.89	0.83	0.79	0.77	0.78	0.83
単利(%)	0.08	0.14	0.27	0.43	0.73	1.14
複利(%)	0.08	0.14	0.27	0.43	0.72	1.10
Dur(年)	9.47	9.36	9.31	9.18	8.93	8.70
M-Dur	9.46	9.34	9.29	9.15	8.88	8.64
E-Dur	9.45	9.33	9.29	9.15	8.89	8.66
Tspd(bp)	5	4	3	6	4	5

出所:NFRC

NOMURA-BPI/Extended の定義

NOMURA-BPI/Extended の銘柄組入基準

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

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

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

累積投資収益指数の計算方法

ある時点における投資収益指数は以下の計算式から算出される。

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

$BPIE_{today}$: 当日累積投資収益指数

$BPIE_{e.l.m.}$: 前月末累積投資収益指数

$MVLt_{today}$: 当日経過利子込み時価総額

$MVLt_{e.l.m.}$: 前月末経過利子込み時価総額

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

各ポートフォリオの累積投資収益指数は以下の基準日を 100 としている。

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

ただし、

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

投資収益率の計算方法

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

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

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

レポートの表記等について

投資収益率 投資収益指数

- 「前月末からの投資収益率」は、「2024 年 11 月の月末営業日から 2024 年 12 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 12 月の月末営業日までの投資収益率（年率換算、%）」を指す。
- 「前年からの投資収益率」は、「2023 年 12 月の月末営業日から 2024 年 12 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 11 月の月末営業日から 2024 年 12 月の月末営業日までの投資収益率（年率換算、%）。
- 2024 年 11 月の月末営業日において、12 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 12 月ポートフォリオの、右ページには 1 月ポートフォリオの、2024 年 12 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 12 月末（暦上）における残存年数（至最終償還日）で区分。ただし 1 月ポートフォリオでは、2025 年 1 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