


5バリュアセット株式会社がご提案する基本的な運用方針は「債券を中心に据えた運用」です。お客さまのリスク許容度に合わせてリスクをコントロールし、安定的に利息収入を得ながら債券銘柄の割安・割高を見極め、市場変動に対しても機敏に対応します。

5バリュアセット(5VA)の調査部は、国内の主要外部評価でも長年の実績のあるストラテジストを中心に、様々な専門性を有するスタッフにより構成されています。


5VAでは気軽に相談ができる場として、無料個別相談や無料セミナーを開催しておりますので、右記より詳細をご確認ください。



無料個別相談
資産運用などへの疑問・お悩みを解決します。無料相談をご希望の方はこちらからお問い合わせください。5VAのプロが親身に相談に乗ります。



無料セミナー申込み
豊富なテーマで、経済・市場・資産運用などの解説をしています。まずは近日開催予定の5VAの無料セミナーをチェックしてみてください。



リサーチ情報
5VAで作成した債券投資関連情報の調査レポートや市場ニュースをご紹介します。閲覧するにはログインが必要です。ログインしてご覧ください。

米国発行 ドル建米国国債

(残存期間 1.5~3年、利回り順)



(1) 残存期間が 1.5~3年							d1 : 2024年09月04日時点			d2 : 2024年08月06日時点			d2→d1	
位	銘柄区分	債券区分	残高 (百万 米ドル)	発行日	満期日	クーポン (%)	単価	利回り (%)*	直利 (%)	単価	利回り (%)*	直利 (%)	利回り△ 変化(%)	
1	米国中期・長期国債	政府	ソブリン	65,989	2024/04/01	2026/03/31	4.50	100.88	3.91	4.46	100.62	4.10	4.47	-0.19
2	米国中期・長期国債	政府	ソブリン	40,000	2023/03/15	2026/03/15	4.63	101.05	3.91	4.58	100.78	4.12	4.59	-0.21
3	米国中期・長期国債	政府	ソブリン	71,954	2021/03/31	2026/03/31	0.75	95.24	3.91	0.79	94.72	4.10	0.79	-0.19
4	米国中期・長期国債	政府	ソブリン	32,000	2019/04/01	2026/03/31	2.25	97.50	3.91	2.31	97.07	4.11	2.32	-0.20
5	米国中期・長期国債	政府	ソブリン	42,519	2023/04/17	2026/04/15	3.75	99.80	3.88	3.76	99.46	4.09	3.77	-0.21
6	米国中期・長期国債	政府	ソブリン	69,310	2024/04/30	2026/04/30	4.88	101.58	3.88	4.80	101.32	4.07	4.81	-0.19
7	米国中期・長期国債	政府	ソブリン	72,648	2021/04/30	2026/04/30	0.75	95.05	3.87	0.79	94.51	4.07	0.79	-0.20
8	米国中期・長期国債	政府	ソブリン	32,407	2019/04/30	2026/04/30	2.38	97.63	3.87	2.43	97.19	4.07	2.44	-0.20
9	米国中期・長期国債	政府	ソブリン	50,588	2023/05/15	2026/05/15	3.63	99.62	3.86	3.64	99.27	4.05	3.65	-0.19
10	米国中期・長期国債	政府	ソブリン	69,496	2016/05/16	2026/05/15	1.63	96.38	3.85	1.69	95.88	4.06	1.69	-0.20
11	米国中期・長期国債	政府	ソブリン	73,094	2024/05/31	2026/05/31	4.88	101.70	3.85	4.79	101.43	4.05	4.81	-0.20
12	米国中期・長期国債	政府	ソブリン	72,840	2021/06/01	2026/05/31	0.75	94.85	3.85	0.79	94.30	4.04	0.80	-0.19
13	米国中期・長期国債	政府	ソブリン	35,362	2019/05/31	2026/05/31	2.13	97.15	3.84	2.19	96.70	4.03	2.20	-0.19
14	米国中期・長期国債	政府	ソブリン	39,999	2023/06/15	2026/06/15	4.13	100.50	3.83	4.10	100.18	4.02	4.12	-0.20
15	米国中期・長期国債	政府	ソブリン	71,392	2024/07/01	2026/06/30	4.63	101.39	3.82	4.56	101.10	4.02	4.57	-0.19
16	米国中期・長期国債	政府	ソブリン	70,259	2021/06/30	2026/06/30	0.88	94.88	3.81	0.92	94.35	4.00	0.93	-0.18
17	米国中期・長期国債	政府	ソブリン	33,828	2019/07/01	2026/06/30	1.88	96.63	3.81	1.94	96.14	4.01	1.95	-0.20
18	米国中期・長期国債	政府	ソブリン	40,000	2023/07/17	2026/07/15	4.50	101.24	3.80	4.44	100.94	3.99	4.46	-0.19
19	米国中期・長期国債	政府	ソブリン	66,827	2021/08/02	2026/07/31	0.63	94.24	3.79	0.66	93.67	3.98	0.67	-0.19
20	米国中期・長期国債	政府	ソブリン	32,599	2019/07/31	2026/07/31	1.88	96.52	3.79	1.94	96.02	3.98	1.95	-0.19
21	米国中期・長期国債	政府	ソブリン	72,805	2024/07/31	2026/07/31	4.38	101.06	3.79	4.33	-	-	-	-
22	米国中期・長期国債	政府	ソブリン	65,324	2016/08/15	2026/08/15	1.50	95.79	3.77	1.57	95.23	3.98	1.58	-0.21
23	米国中期・長期国債	政府	ソブリン	57,702	2023/08/15	2026/08/15	4.38	101.13	3.76	4.33	100.75	3.98	4.34	-0.22
24	米国中期・長期国債	政府	ソブリン	68,664	2021/08/31	2026/08/31	0.75	94.29	3.76	0.80	93.70	3.96	0.80	-0.20
25	米国中期・長期国債	政府	ソブリン	74,487	2024/09/03	2026/08/31	3.75	99.99	3.76	3.75	-	-	-	-
26	米国中期・長期国債	政府	ソブリン	44,000	2023/09/15	2026/09/15	4.63	101.68	3.76	4.55	101.34	3.96	4.56	-0.20
27	米国中期・長期国債	政府	ソブリン	36,155	2019/09/03	2026/08/31	1.38	95.49	3.75	1.44	94.90	3.97	1.45	-0.22
28	米国中期・長期国債	政府	ソブリン	46,000	2023/10/16	2026/10/15	4.63	101.79	3.74	4.54	101.42	3.94	4.56	-0.21
29	米国中期・長期国債	政府	ソブリン	67,202	2021/11/01	2026/10/31	1.13	94.66	3.73	1.19	94.07	3.93	1.20	-0.20
30	米国中期・長期国債	政府	ソブリン	35,324	2019/09/30	2026/09/30	1.63	95.84	3.73	1.70	95.27	3.94	1.71	-0.21
31	米国中期・長期国債	政府	ソブリン	35,346	2019/10/31	2026/10/31	1.63	95.68	3.73	1.70	95.12	3.93	1.71	-0.20
32	米国中期・長期国債	政府	ソブリン	68,346	2021/09/30	2026/09/30	0.88	94.38	3.73	0.93	93.80	3.91	0.93	-0.19
33	米国中期・長期国債	政府	ソブリン	48,910	2023/11/15	2026/11/15	4.63	101.88	3.72	4.54	101.51	3.92	4.56	-0.20
34	米国中期・長期国債	政府	ソブリン	68,953	2016/11/15	2026/11/15	2.00	96.41	3.72	2.07	95.88	3.91	2.09	-0.20
35	米国中期・長期国債	政府	ソブリン	34,054	2019/12/02	2026/11/30	1.63	95.55	3.72	1.70	94.97	3.92	1.71	-0.20
36	米国中期・長期国債	政府	ソブリン	63,863	2021/11/30	2026/11/30	1.25	94.77	3.71	1.32	94.16	3.91	1.33	-0.20
37	米国中期・長期国債	政府	ソブリン	49,999	2023/12/15	2026/12/15	4.38	101.46	3.70	4.31	101.04	3.91	4.33	-0.21
38	米国中期・長期国債	政府	ソブリン	51,998	2024/01/16	2027/01/15	4.00	100.69	3.69	3.97	100.22	3.90	3.99	-0.21
39	米国中期・長期国債	政府	ソブリン	35,012	2019/12/31	2026/12/31	1.75	95.73	3.69	1.83	95.15	3.89	1.84	-0.20
40	米国中期・長期国債	政府	ソブリン	64,538	2017/02/15	2027/02/15	2.25	96.67	3.69	2.33	96.13	3.88	2.34	-0.19
41	米国中期・長期国債	政府	ソブリン	57,993	2024/02/15	2027/02/15	4.13	101.01	3.69	4.08	100.55	3.89	4.10	-0.21
42	米国中期・長期国債	政府	ソブリン	98,525	2020/01/31	2027/01/31	1.50	95.02	3.68	1.58	94.43	3.88	1.59	-0.19
43	米国中期・長期国債	政府	ソブリン	64,744	2021/12/31	2026/12/31	1.25	94.66	3.67	1.32	94.05	3.87	1.33	-0.20
44	米国中期・長期国債	政府	ソブリン	36,836	2020/03/02	2027/02/28	1.13	94.00	3.67	1.20	93.37	3.87	1.20	-0.20
45	米国中期・長期国債	政府	ソブリン	36,303	2020/03/31	2027/03/31	0.63	92.61	3.67	0.67	91.95	3.85	0.68	-0.18

出所：Bloomberg データより、5バリュアセットで作成。

* 外貨ベース（米ドル）、税引前の利回りで表示している。

米国発行 ドル建米国国債

(残存期間 4~6年、利回り順)

5 Value Asset

(2) 残存期間が 4~6年						d1 : 2024年09月04日時点			d2 : 2024年08月06日時点			d2→d1	
位	銘柄区分	債券区分	残高 (百万 米ドル)	発行日	満期日	クーポン (%)	単価	利回り (%)*	直利 (%)	単価	利回り (%)*	直利 (%)	利回り△ 変化(%)
1	米国中期・長期国債	政府 ソブリン	37,000	2023/10/02	2030/09/30	4.63	105.42	3.62	4.39	104.61	3.78	4.42	-0.16
2	米国中期・長期国債	政府 ソブリン	39,737	2023/08/31	2030/08/31	4.13	102.70	3.62	4.02	101.88	3.78	4.05	-0.16
3	米国中期・長期国債	政府 ソブリン	34,890	2023/07/31	2030/07/31	4.00	102.02	3.62	3.92	101.21	3.77	3.95	-0.16
4	米国中期・長期国債	政府 ソブリン	34,964	2023/06/30	2030/06/30	3.75	100.69	3.62	3.72	99.89	3.77	3.75	-0.15
5	米国中期・長期国債	政府 ソブリン	41,413	2023/05/31	2030/05/31	3.75	100.71	3.61	3.72	99.89	3.77	3.75	-0.16
6	米国中期・長期国債	政府 ソブリン	132,834	2020/08/17	2030/08/15	0.63	84.16	3.61	0.74	83.20	3.77	0.75	-0.16
7	米国中期・長期国債	政府 ソブリン	38,231	2023/05/01	2030/04/30	3.50	99.45	3.61	3.52	98.64	3.77	3.55	-0.16
8	米国中期・長期国債	政府 ソブリン	34,900	2023/03/31	2030/03/31	3.63	100.09	3.61	3.62	99.27	3.77	3.65	-0.16
9	米国中期・長期国債	政府 ソブリン	35,000	2023/01/31	2030/01/31	3.50	99.49	3.60	3.52	98.70	3.77	3.55	-0.16
10	米国中期・長期国債	政府 ソブリン	42,952	2023/02/28	2030/02/28	4.00	101.96	3.60	3.92	101.18	3.76	3.95	-0.16
11	米国中期・長期国債	政府 ソブリン	35,000	2023/01/03	2029/12/31	3.88	101.31	3.60	3.82	100.54	3.76	3.85	-0.16
12	米国中期・長期国債	政府 ソブリン	17,043	2000/02/15	2030/05/15	6.25	113.53	3.60	5.51	112.84	3.75	5.54	-0.15
13	米国中期・長期国債	政府 ソブリン	35,000	2022/10/31	2029/10/31	4.00	101.88	3.60	3.93	101.14	3.76	3.95	-0.16
14	米国中期・長期国債	政府 ソブリン	80,504	2018/11/15	2028/11/15	3.13	98.18	3.60	3.18	97.50	3.76	3.21	-0.17
15	米国中期・長期国債	政府 ソブリン	88,006	2020/02/18	2030/02/15	1.50	89.71	3.60	1.67	88.80	3.77	1.69	-0.17
16	米国中期・長期国債	政府 ソブリン	109,880	2020/05/15	2030/05/15	0.63	84.82	3.60	0.74	83.83	3.77	0.75	-0.17
17	米国中期・長期国債	政府 ソブリン	38,745	2022/11/30	2029/11/30	3.88	101.32	3.60	3.82	100.57	3.76	3.85	-0.16
18	米国中期・長期国債	政府 ソブリン	35,885	2022/09/30	2029/09/30	3.88	101.29	3.59	3.83	100.56	3.75	3.85	-0.16
19	米国中期・長期国債	政府 ソブリン	68,190	2021/11/01	2028/10/31	1.38	91.52	3.59	1.50	90.75	3.76	1.52	-0.17
20	米国中期・長期国債	政府 ソブリン	60,918	2022/01/31	2029/01/31	1.75	92.57	3.59	1.89	91.79	3.76	1.91	-0.17
21	米国中期・長期国債	政府 ソブリン	41,779	2022/08/31	2029/08/31	3.13	97.90	3.59	3.19	97.11	3.76	3.22	-0.17
22	米国中期・長期国債	政府 ソブリン	55,675	2022/03/31	2029/03/31	2.38	94.93	3.59	2.50	94.13	3.76	2.52	-0.17
23	米国中期・長期国債	政府 ソブリン	63,858	2021/11/30	2028/11/30	1.50	91.86	3.59	1.63	91.10	3.75	1.65	-0.17
24	米国中期・長期国債	政府 ソブリン	48,314	2022/05/31	2029/05/31	2.75	96.38	3.59	2.85	95.60	3.76	2.88	-0.17
25	米国中期・長期国債	政府 ソブリン	49,900	2022/05/02	2029/04/30	2.88	96.97	3.59	2.96	96.21	3.76	2.99	-0.17
26	米国中期・長期国債	政府 ソブリン	41,106	2022/08/01	2029/07/31	2.63	95.71	3.59	2.74	94.91	3.76	2.77	-0.17
27	米国中期・長期国債	政府 ソブリン	42,974	2022/06/30	2029/06/30	3.25	98.52	3.59	3.30	97.74	3.76	3.33	-0.17
28	米国中期・長期国債	政府 ソブリン	69,467	2021/09/30	2028/09/30	1.25	91.23	3.59	1.37	90.43	3.77	1.38	-0.18
29	米国中期・長期国債	政府 ソブリン	81,505	2019/02/15	2029/02/15	2.63	96.09	3.59	2.73	95.32	3.76	2.75	-0.17
30	米国中期・長期国債	政府 ソブリン	58,546	2022/02/28	2029/02/28	1.88	92.97	3.59	2.02	92.20	3.75	2.03	-0.17
31	米国中期・長期国債	政府 ソブリン	49,000	2023/10/02	2028/09/30	4.63	103.91	3.58	4.45	103.29	3.76	4.48	-0.18
32	米国中期・長期国債	政府 ソブリン	51,999	2023/10/31	2028/10/31	4.88	104.94	3.58	4.65	104.33	3.76	4.67	-0.18
33	米国中期・長期国債	政府 ソブリン	84,377	2019/05/15	2029/05/15	2.38	94.84	3.58	2.50	94.03	3.75	2.53	-0.17
34	米国中期・長期国債	政府 ソブリン	55,622	2023/11/30	2028/11/30	4.38	103.10	3.58	4.24	102.49	3.74	4.27	-0.17
35	米国中期・長期国債	政府 ソブリン	57,996	2024/01/02	2028/12/31	3.75	100.68	3.58	3.72	99.99	3.75	3.75	-0.17
36	米国中期・長期国債	政府 ソブリン	63,608	2021/12/31	2028/12/31	1.38	91.26	3.58	1.51	90.42	3.76	1.52	-0.18
37	米国中期・長期国債	政府 ソブリン	61,000	2024/01/31	2029/01/31	4.00	101.72	3.57	3.93	101.04	3.75	3.96	-0.17
38	米国中期・長期国債	政府 ソブリン	72,437	2024/07/01	2029/06/30	4.25	102.97	3.57	4.13	102.24	3.74	4.16	-0.17
39	米国中期・長期国債	政府 ソブリン	67,000	2024/04/01	2029/03/31	4.13	102.31	3.57	4.03	101.61	3.74	4.06	-0.17
40	米国中期・長期国債	政府 ソブリン	88,553	2019/11/15	2029/11/15	1.75	91.44	3.57	1.91	90.65	3.72	1.93	-0.15
41	米国中期・長期国債	政府 ソブリン	11,179	1999/08/16	2029/08/15	6.13	111.48	3.57	5.49	110.82	3.74	5.53	-0.17
42	米国中期・長期国債	政府 ソブリン	70,332	2024/04/30	2029/04/30	4.63	104.49	3.57	4.43	103.80	3.74	4.46	-0.17
43	米国中期・長期国債	政府 ソブリン	73,860	2024/07/31	2029/07/31	4.00	101.93	3.57	3.92	-	-	-	-
44	米国中期・長期国債	政府 ソブリン	66,769	2024/02/29	2029/02/28	4.25	102.83	3.56	4.13	102.16	3.73	4.16	-0.17
45	米国中期・長期国債	政府 ソブリン	74,156	2024/05/31	2029/05/31	4.50	104.05	3.56	4.32	103.36	3.73	4.35	-0.17

出所：Bloomberg データより、5バリュースセットで作成。

* 外貨ベース（米ドル）、税引前の利回りで表示している。

<データソースについて>

Bloombergデータより、5バリューアセットでスクリーニング・加工している。スクリーニング対象は下記の通り。

- ① 米国国債（重複債券を統合）
- ② 米ドルで発行
- ③ 残高が1,000百万米ドル以上。
- ④ 発行体はアメリカ合衆国。
- ⑤ 銘柄は米国国債のうち米国中期・長期国債のみ。
- ⑥ 同一の年限レンジに含まれる同一の米国国債のうち、最も残高の高い銘柄を参照した。
- ⑦ 直利の計算方法は、クーポン(%) ÷ 債券の単価格となる。
(この価格・利回りは売り気配・買い気配の参考仲値であり、この価格・利回りによる売買取引等の約定を保証するものではありません。)

<ご注意事項>

債券は、債券の価格が市場の金利水準の変化に対応して変動するため、償還前に換金すると損失が生じるおそれがあります。また、債券を発行する組織（発行体）が債務返済不能状態に陥った場合、元本や利子の支払いが滞ったり、不能となったりすることがあります。外国債券（外貨建て債券）は為替相場の変動等により損失（為替差損）が生じたり、債券を発行する組織（発行体）が所属する国や地域、取引がおこなわれる通貨を発行している国や地域の政治・経済・社会情勢に大きな影響を受けたりするおそれがあります。

- 本資料は、投資判断の参考となる情報の提供を目的としたもので、投資勧誘を目的としたものではありません。投資判断の最終決定は、お客様ご自身の判断でなさるようお願いいたします。
- 本資料は、信頼できると考えられる情報に基づいて作成されておりますが、弊社は、その正確性及び完全性に関して責任を負うものではありません。
- 本資料に記載された内容は、2024年09月05日におけるものであり、予告なく変わる場合があります。
- 資料はある特定の投資目的や金融ポジション、あるいは特定のニーズに応えたものでもありません。将来的に予想通りの結果とならない可能性があります。本資料で取り上げられている投資対象や投資戦略の適正については投資アドバイスを受けることをお勧めします。
- 投資利益あるいは投資対象の価格・価値は変動する可能性があり、投資収益が投資額を下回る場合もあります。
- 投資に関する最終決定は、お客様ご自身の判断でなされますようお願い申し上げます。
- 外国債券を購入する場合は、購入対価のみお支払いいただきます（委託手数料はかかりません）。
- また、売買における売付け適用為替レートと買付け適用為替レートの差（スプレッド）は債券の起債通貨によって異なります。
- また、本資料は将来の結果をお約束するものではなく、お取引をなさる際に実際に用いられる価格または数値を表すものでもございませんので、予めご了承くださいようお願いいたします。

5バリューアセット株式会社
金融商品仲介業者 近畿財務局長（金仲）第437号