

平成28年2月25日
資金管理センター

資金管理料金特別会計における資金運用の定期見直し(案)

平成27年12月7日開催の第64回資金管理業務諮問委員会において、「資金管理料金特別会計における運用の基本方針」(「別紙」参照)をご承認いただいた。

これを受け、同方針で規定する「運用対象資産および金融機関選択の実務上のルール」を、「資金管理料金特別会計における運用の細則(案)」として規定することについてご審議いただく。

資金管理料金特別会計における運用の細則(案)

資金管理料金特別会計における運用の基本方針で規定する「運用対象資産および金融機関選択の実務上のルール」については次のとおりとする。

1. 引合に参加する金融機関の選定

引合に参加する金融機関については次のとおりとする。

(1) 国債・政府保証債

引合時において再資源化預託金等の債券取引に係る証券会社

(2) 大口定期預金

引合時において2以上の信用格付業者の長期格付けが最上位から二番目以上である銀行^{※1}

※1 2016年1月25日現在で8行が該当（三菱東京 UFJ 銀行、三井住友銀行、みずほ銀行、三菱 UFJ 信託銀行、みずほ信託銀行、横浜銀行、伊予銀行、商工組合中央金庫）

2. 運用対象資産の選定

運用対象資産は、次の2種類の運用ごとに定めるものとする(図1参照)。

(1) 換金性を優先する運用

運用対象資産は大口定期預金。

運用額の総額のうち一定の金額^{※2}は必ず大口定期預金のみで運用することとし、引合に参加した金融機関のうち最も高い利率を提示した者を選定する。

※2 不測の事象に対応するための資金として1～2ヶ月分の支払に相当する金額(約5億円程度)

(2) 収益性を優先する運用

運用対象資産は国債・政府保証債、大口定期預金。

運用額の総額から(1)の運用額を除いた金額については、上記の運用対象資産から運用するものとし、引合に参加した金融機関のうち最も高い利回りを提示した者を選定する。

ただし、(2)の運用先として選定する者は(1)の運用先として選定することはできない。

図1 運用対象資産の構成(イメージ)

(1) 大口定期預金 で運用 5億円	(2) 国債・政府保証債、大口定期預金から選択して運用 20億円(平成28年度)
--------------------------	---

以上