

平成 28 年 9 月 28 日
資金管理センター

平成 28 年度第 1 四半期における債券購入に伴う約定の検証及び購入実績

資金管理業務規程で定める「運用の基本方針」に基づき行う「債券購入に伴う約定の検証」の結果及び取引証券会社債券購入実績を以下のとおり報告する。

1. 債券購入に伴う約定の検証(平成 28 年 4 月～6 月)

個別債券毎に取引証券会社 6 社全てに対して条件の提示を求め、最良の条件を提示した証券会社から購入していることを確認した。

なお、4 月～5 月にかけて取得対象年限の国債の利回りがマイナスであったため、当初年度計画に基づき国債の取得を見送り、6 月には平成 28 年 6 月開催の第 67 回資金管理業務諮問委員会で審議を受けた「平成 28 年度再資源化預託金等運用計画(変更後)」に基づき、投資期間を延伸しプラス利回りでの取得を行っていることを確認した。(表 1 参照)

<表 1 平成 28 年第 1 四半期の月別購入実績>

債券種別	4 月	5 月	6 月
国債	-	-	340 億円(0.004%)
政府保証債	4 億円(0.007%)	10 億円(0.011%)	83 億円(0.004%)

※()内実績最終利回り

2. 証券会社別購入実績(平成 28 年 4 月～6 月)

1 社当たりの購入金額(比率)は、5 億円(1.1%)～121 億円(27.7%)となり、購入金額別の証券会社 6 社(A～F)の分布は下表 2 のとおりである。

<表 2 平成 28 年第 1 四半期の購入金額別証券会社分布>

1 社当たりの購入金額	証券会社
70 億円以上	A B F
50 億円以上 70 億円未満	E
30 億円以上 50 億円未満	-
10 億円以上 30 億円未満	C
10 億円未満	D

以上