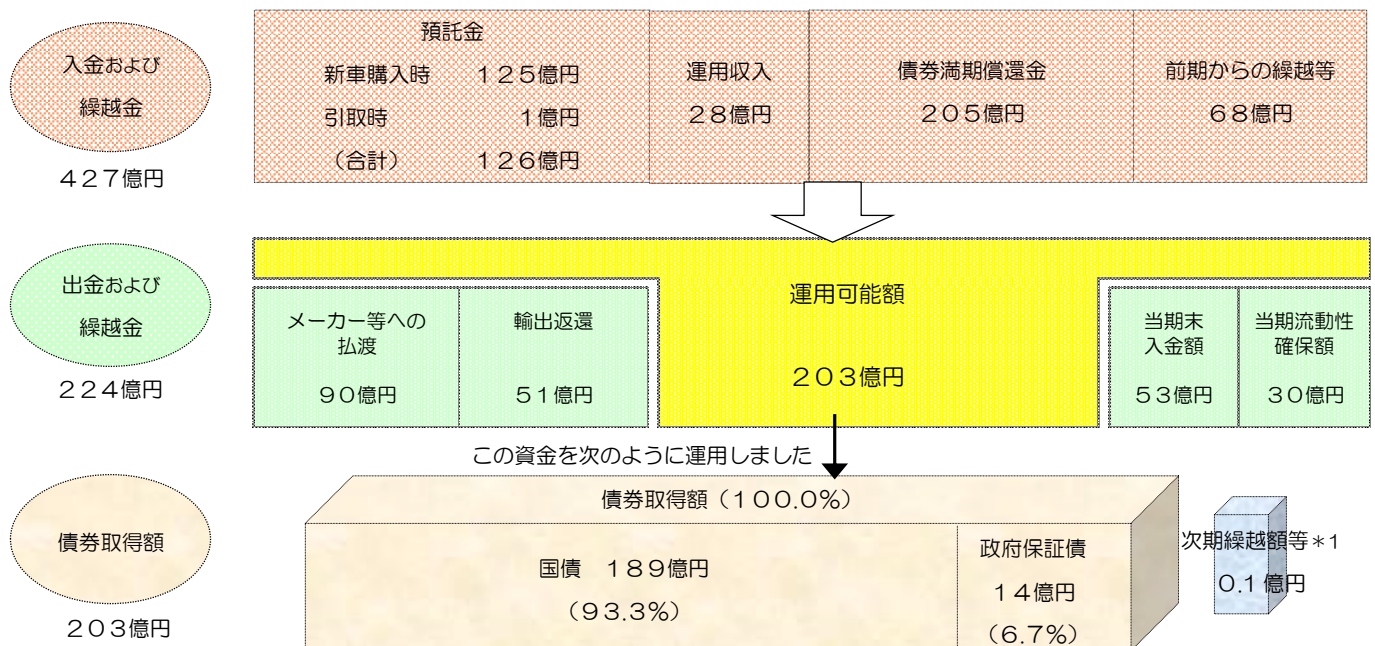


平成27年度第2四半期（平成27年7月～平成27年9月）再資源化預託金等の運用の実績

■平成27年度第2四半期（平成27年7月から平成27年9月まで）に資金管理法人の口座に入金となった預託金額は126億円でした。これに前期からの繰越金68億円（前期末入金38億円、流動性確保額30億円）、運用収入28億円及び債券満期償還金205億円を加えた427億円から、メーカー等へ払渡した金額90億円及び輸出返還の金額51億円と、当期末の入金分53億円及び流動性確保額の30億円の合計224億円を差引いた203億円が運用可能な金額でした。この資金にて、国債189億円、政府保証債14億円の合計203億円の債券を取得しました。



■平成27年度における新規取得債券（平成27年4月から平成27年9月まで）の種別構成比は、国債93.3%、政府保証債6.7%となり、計画通り市場の構成比に準じたものとなりました。

■平成27年度第2四半期の新規取得債券の実績最終利回りは、次のとおり市場の金利を概ね反映したものとなりました。

実績最終利回り(A)*2	評価指標利回り(B)*3	(A)-(B)
0.33%	0.36%	△0.03

■平成27年9月末の保有債券の残高の年限別構成は次のようになりました。

年限(27年度末基準)	償還年度	保有債券簿価残高	構成比	年度末目標
1以下	～平成28年度	1,336億円	—	—
2	平成29年度	895億円	11.7%	11.1%
3	平成30年度	895億円	11.7%	11.1%
4	平成31年度	895億円	11.7%	11.1%
5	平成32年度	895億円	11.7%	11.1%
6	平成33年度	895億円	11.7%	11.1%
7	平成34年度	896億円	11.7%	11.1%
8	平成35年度	896億円	11.7%	11.1%
9	平成36年度	895億円	11.7%	11.1%
10	平成37年度	509億円	6.6%	11.1%
	合計	9,009億円	100.0%	100.0%

■各年度末の保有債券全体の最終利回りの推移は次のようになっています。

18年度	19年度	20年度	21年度	22年度	23年度	24年度	25年度	26年度	27年度2Q
1.15%	1.24%	1.32%	1.37%	1.37%	1.35%	1.29%	1.21%	1.11%	1.06%

*1 債券の運用を次期に繰越した額及び支払経過利息の合計額。支払経過利息とは、債券を購入する際に売り手に支払った前回利払日翌日から購入の受渡日までの日数分の利息相当額のこと。

*2 当期に取得した債券の加重平均利回り

*3 当期における市場での日々の10年利付国債の2年から10年までの各年限の最終利回りを、当期における各年限の債券の取得比率実績により加重平均したもの。

※ 四捨五入の関係で合計が合わない場合があります。

※ 詳細は「資金管理業務諮問委員会の報告 第64回（平成27年12月7日開催）資料4-1」をご参照ください。

以上