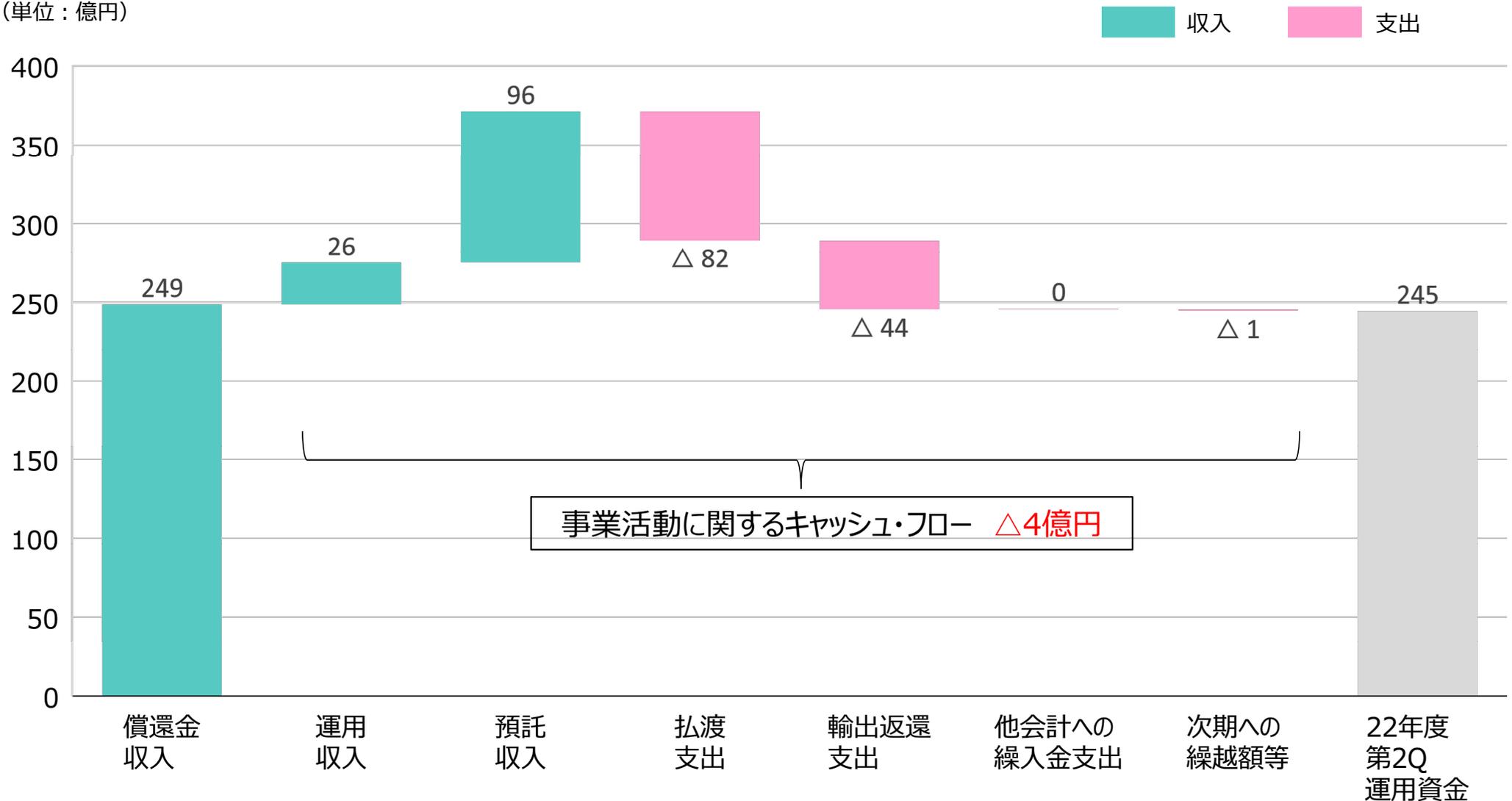


2022年度第2四半期 再資源化預託金等の運用実績 (1) 運用資金

第2Qの運用資金は245億円。事業活動に関するキャッシュ・フローが4億円のマイナスとなったため、償還金収入249億円を下回る。

(単位：億円)

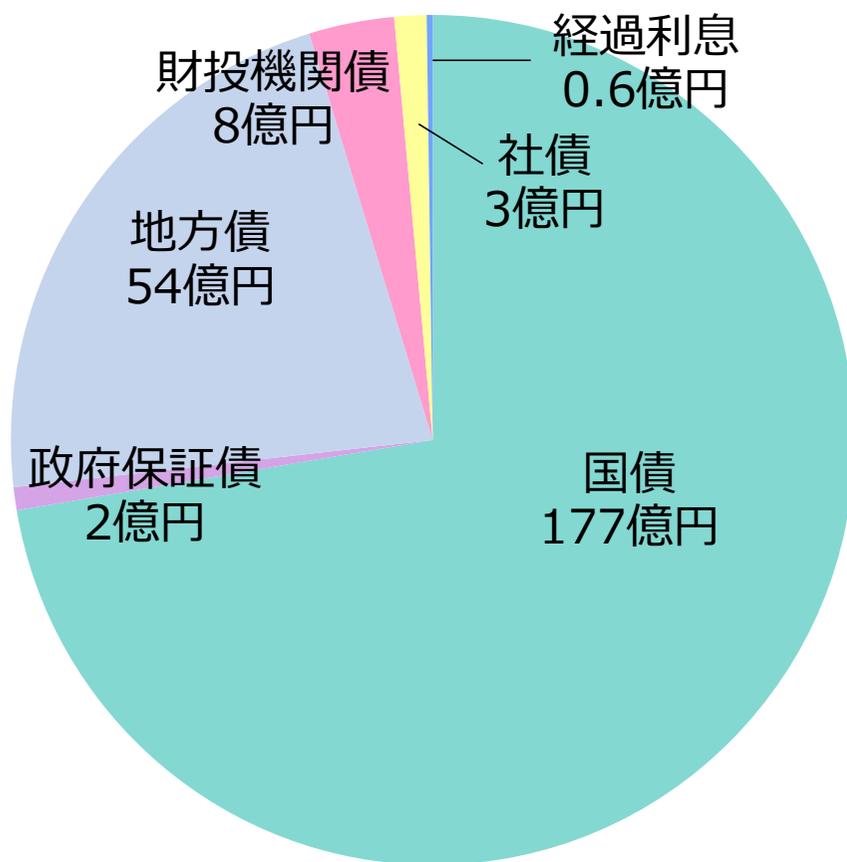


2022年度第2四半期 再資源化預託金等の運用実績（2）債券運用の実績

第2Qは年限5年、年限10年、年限12年及び年限13年の債券を額面227億円取得。

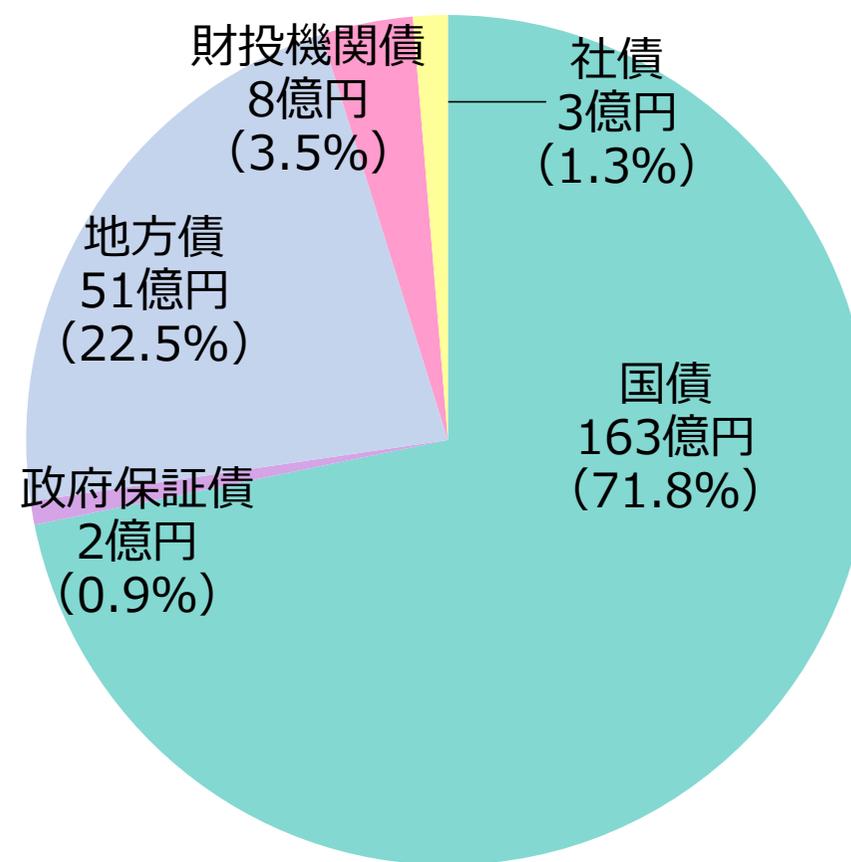
簿価ベース

合計245億円



額面ベース

合計227億円



2022年度第2四半期 再資源化預託金等の運用実績（3） ESG債の取得

第2QにおいてはESG債を24億円取得（内訳：グリーンボンドを10億円、ソーシャルボンドを4億円、サステナビリティボンドを11億円）。本財団が投資表明をした債券は下表のとおり。

発行体	東日本高速道路株式会社	川崎市	鉄道建設・運輸施設整備支援機構
債券種別	財投機関債	地方債	財投機関債
ESG種別	ソーシャルボンド	グリーンボンド	サステナビリティボンド
銘柄名	東日本高速道路株式会社第 97 回社債	第 2 回川崎市グリーンボンド 1 0 年公募公債	第156回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券（サステナビリティボンド）
発行総額	240億円	100億円	100億円
利率	年0.434%	年0.290%	年0.350%
期限	10年（償還年月日：2032年7月29日）	10年（償還年月日：2032年6月18日）	10年（償還年月日：2032年8月30日）
格付	AA+(R&I)、AAA（JCR） A1(Moody's)	—	AA+（R&I）、A1（Moody's）
適合する原則等	ソーシャルボンド原則2021	グリーンボンド原則2021 環境省グリーンボンドガイドライン2020 年版	グリーンボンド原則2018 ソーシャルボンド原則2018 サステナビリティボンドガイドライン2018
資金使途（例）	①地方圏の産業・観光投資を誘発する都市・地域づくりの推進 ②切迫する巨大地震・津波や激甚化する気象災害へのリスク軽減 ③交通安全の確保 ④環境保全の推進 ⑤インフラの老朽化対策	①橋処理センター整備事業（バイオマス発電設備の建設等） ②本庁舎等建替事業（グリーンビルディング化） ③環境配慮技術導入事業（高効率照明機器の整備等） ④五反田川放水路整備事業	①CO2排出量が少ない等、環境負荷低減に資する鉄道の建設 ②海洋汚染防止に配慮した船舶の建造 ③離島航路の整備

2022年度第2四半期 再資源化預託金等の運用実績（3） ESG債の取得

発行体	仙台市	北九州市	埼玉県
債券種別	地方債	地方債	地方債
ESG種別	グリーンボンド	サステナビリティボンド	サステナビリティボンド
銘柄名	仙台市第1回グリーンボンド公募公債（5年）	第2回北九州市サステナビリティボンド10年公募公債	埼玉県第1回公募公債（サステナビリティボンド・10年）
発行総額	50億円	100億円	150億円
利率	年0.120%	年0.379%	年0.379%
期限	5年（償還年月日：2027年9月13日）	10年（償還年月日：2032年9月15日）	10年（償還年月日：2032年9月17日）
格付	—	—	—
適合する原則等	グリーンボンド原則2021 環境省グリーンボンドガイドライン2022年版	グリーンボンド原則2021 ソーシャルボンド原則2021 サステナビリティボンドガイドライン2021	グリーンボンド原則2021 ソーシャルボンド原則2021 サステナビリティボンドガイドライン2021
資金使途（例）	①市有施設への再生可能エネルギー設備導入 ②市有施設のエネルギー効率改善を含む長寿命化改修 ③ごみ処理施設整備 ④環境性能の高い市有施設の新築、改修 ⑤防災対策	①【再生可能エネルギー】響灘地区の充実した港湾インフラと広大な産業用地を活用した、風力発電関連産業の総合拠点の形成 ②【気候変動適応】河川整備、上下水道整備、港湾整備 ③【気候変動適応】災害時の情報収集・伝達体制の整備（総合防災情報システム構築） ④【エネルギー効率】公共施設のエネルギー消費量の削減 など	【グリーンプロジェクト】 ①治水・治山対策の推進 ②みどりの保全と創出 ③林業の生産性向上と県産木材の利用拡大 【ソーシャルプロジェクト】 ①災害・危機に強い埼玉の構築 ②県民の暮らしの安心確保 ③介護・医療体制の充実

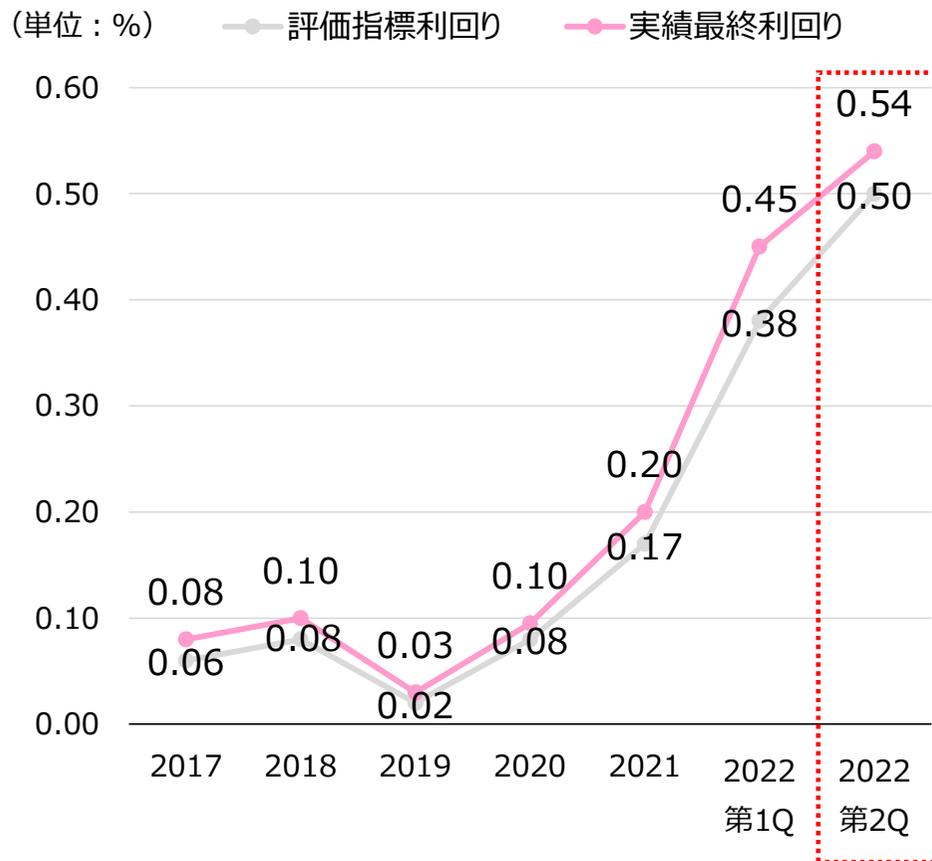
2022年度第2四半期 再資源化預託金等の運用実績（3） ESG債の取得

発行体	兵庫県
債券種別	地方債
ESG種別	グリーンボンド
銘柄名	兵庫県令和4年度第4回公募公債（グリーンボンド・10年）
発行総額	100億円
利率	年0.384%
期限	10年（償還年月日：2032年9月17日）
格付	—
適合する原則等	グリーンボンド原則2021
資金使途（例）	<ul style="list-style-type: none"> ① 下水汚泥広域処理場整備事業 ② 県有施設の照明のLED化、空調設備の更新、太陽光発電設備の導入 ③ 治水対策の推進を目的とした河川改修 ④ 土砂災害防止や温室効果ガスの吸収に資する森林整備 ⑤ コウノトリの生息環境整備

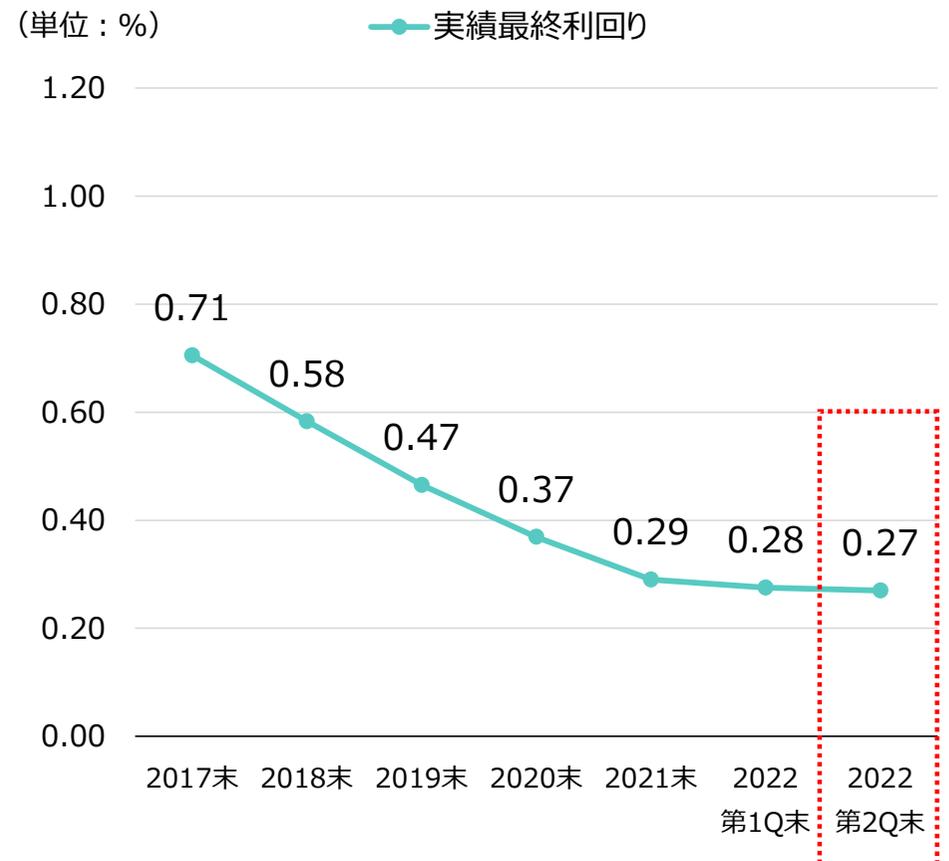
2022年度第2四半期 再資源化預託金等の運用実績（4）債券運用の成果

実績最終利回りは0.54%となり、評価指標利回り0.50%を上回る結果となった。また、継続的な低金利環境下にあるため、資産全体の利回りは低下傾向にあり、第2Q末時点では0.27%となった。

新規取得債券の利回り



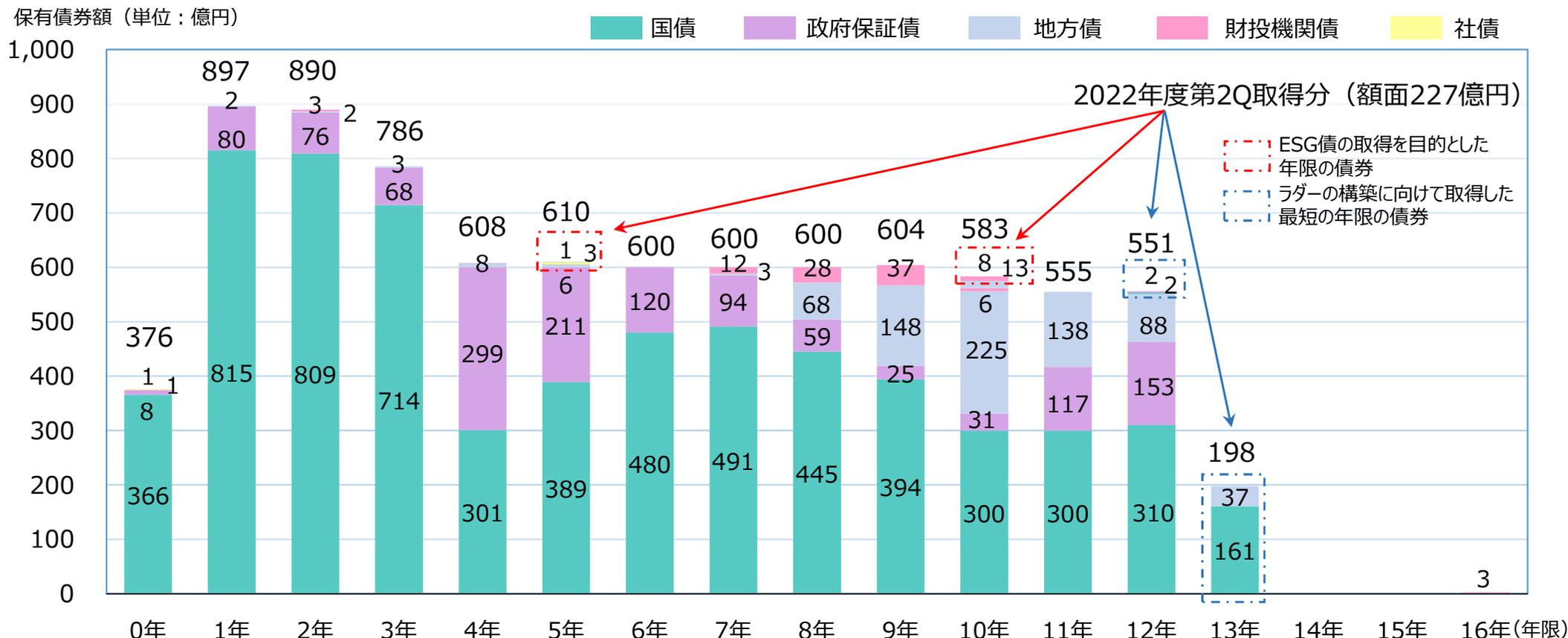
資産全体の利回り



* 「評価指標利回り」とは債券を取得した年限の日々の市場における利付国債の最終利回り（単利）を、年限ごとの債券の取得比率実績により加重平均したもの。

2022年度第2四半期 再資源化預託金等の運用実績（5）ラダー型資産構成

第2Qは年限5年の地方債を1億円、社債を3億円、年限10年の地方債を13億円、財投機関債を8億円、年限12年の国債を2億円、政府保証債を2億円、年限13年の国債を161億円、地方債を37億円を取得し、順調にラダーを構築している。また、評価基準に合致した実績となった。



<評価基準>

- ① 年限4年以降で額面残高600億円程度まで構築した年限において、許容乖離幅が600億円から±5%の範囲に収まっていること。
- ② 年限4年以降で額面残高600億円程度まで構築した年限において、国債以外の債券の合計額が国債の額を超える場合は、国債の額からの乖離幅が5%以内に収まっていること。
- ③ 財投機関債及び社債の保有上限額（額面ベース）が、ポートフォリオ全体のうち5%を超えていないこと。
- ④ 社債の保有額が財投機関債の保有額を超えていないこと。
- ⑤ 財投機関債の新規取得額面が45億円、社債の新規取得額面が8億円を超えていないこと。