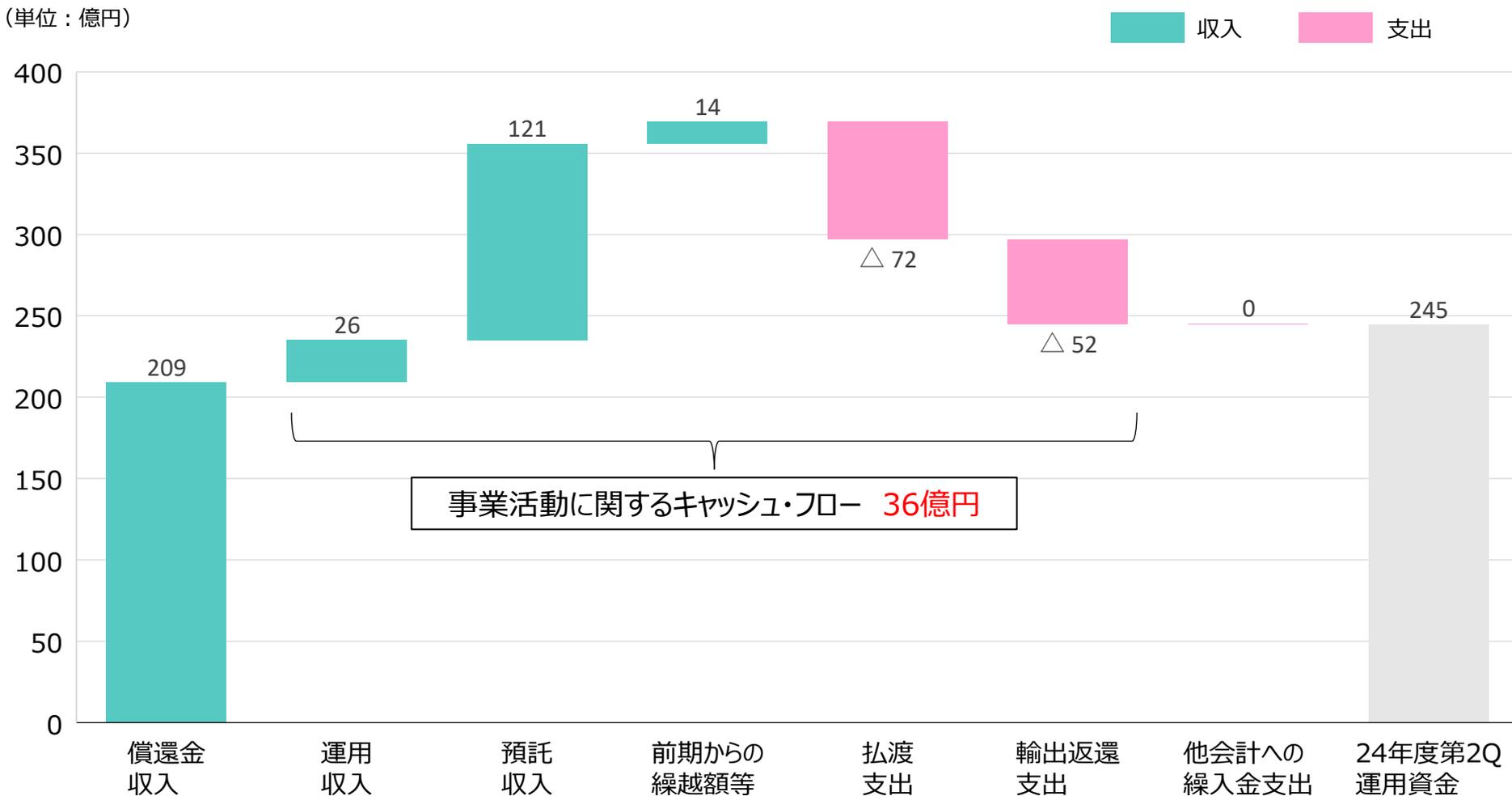


2024年度第2四半期 再資源化預託金等の運用実績 (1) 運用資金

2024年度第2Qの運用資金は245億円（事業活動に関するキャッシュ・フローは36億円のプラス）。

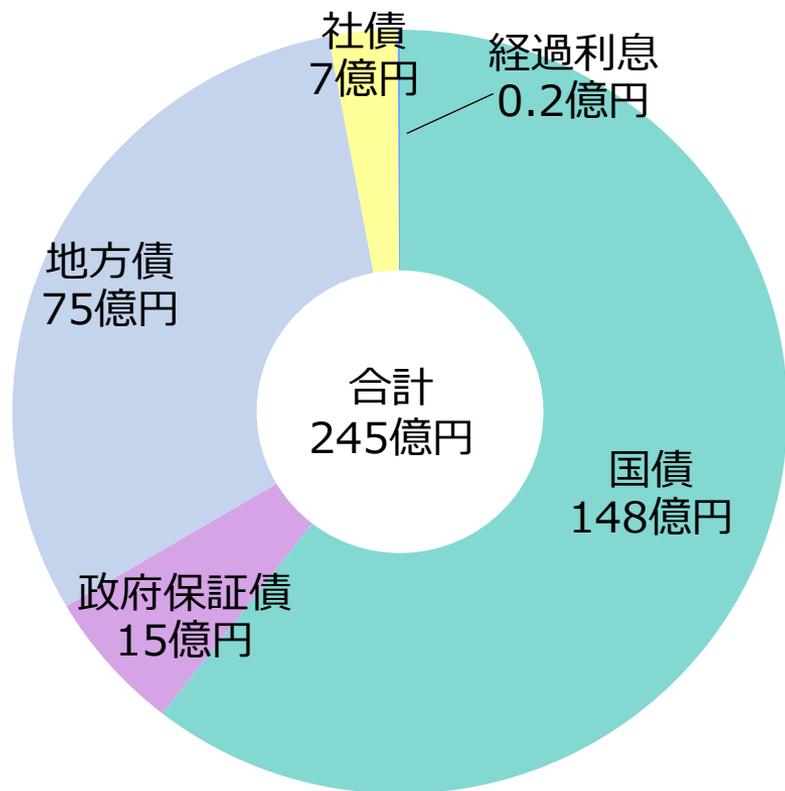
(単位：億円)



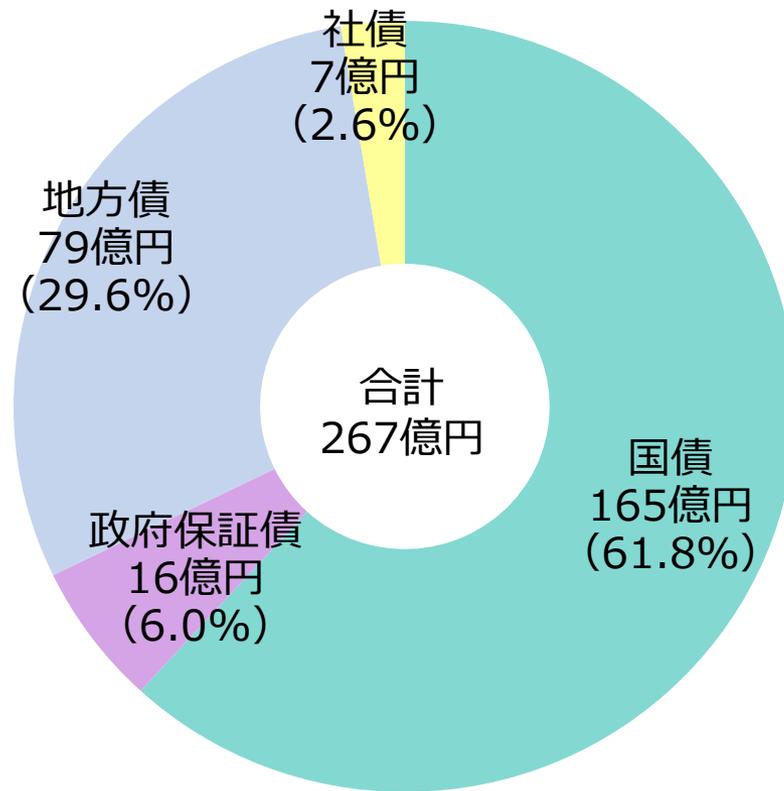
2024年度第2四半期 再資源化預託金等の運用実績 (2) 債券運用の実績

2024年度第2Q（7月～9月）は、年限5年、10年、14年の債券を新規に取得（簿価ベース245億円、額面ベース267億円）。

簿価ベース



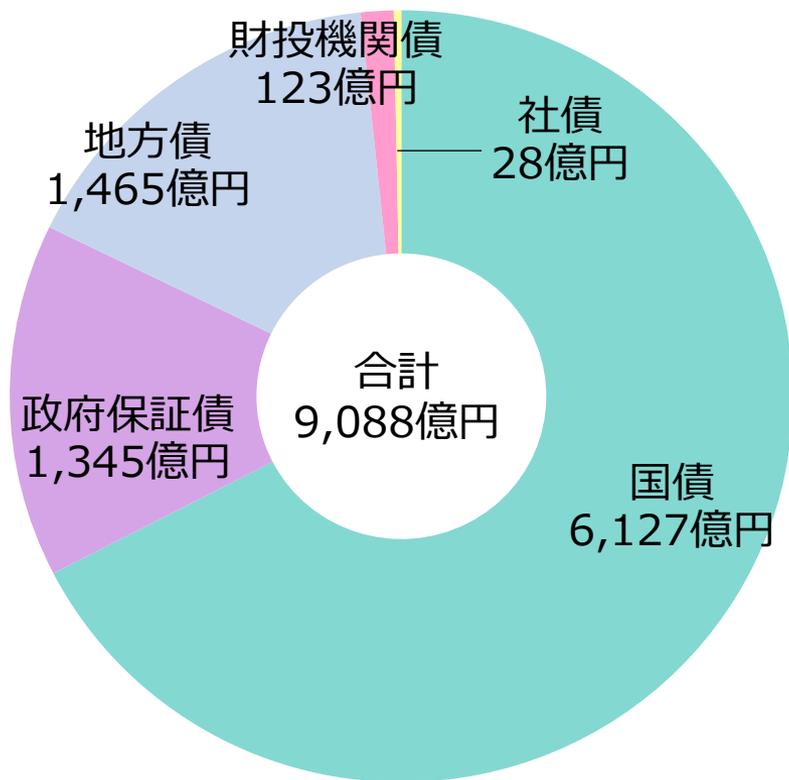
額面ベース



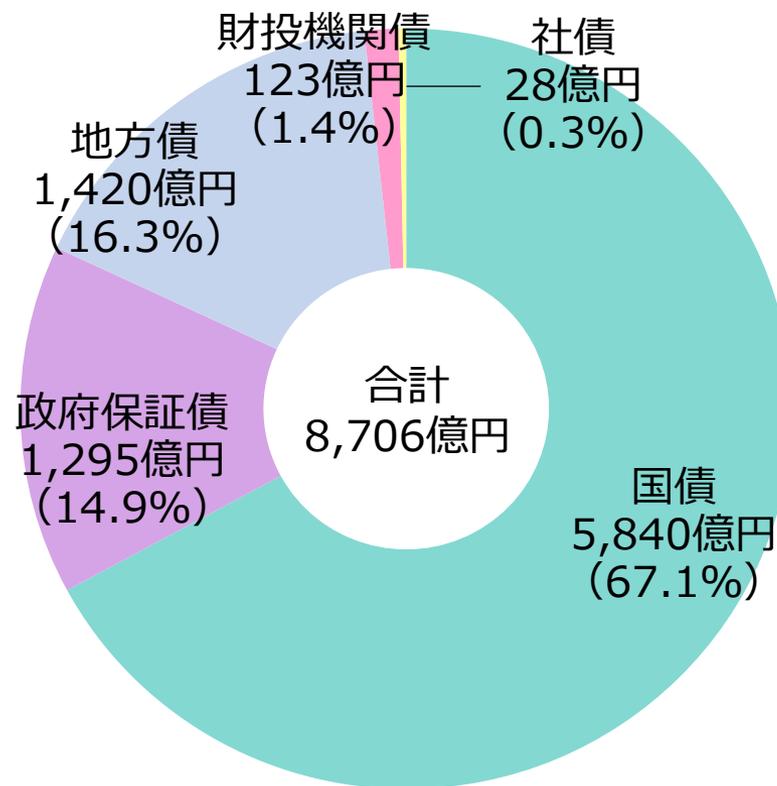
2024年度第2四半期 再資源化預託金等の運用実績 (2) 債券運用の実績

2024年度第2Q末における保有債券は額面残高で8,706億円となった。

簿価残高



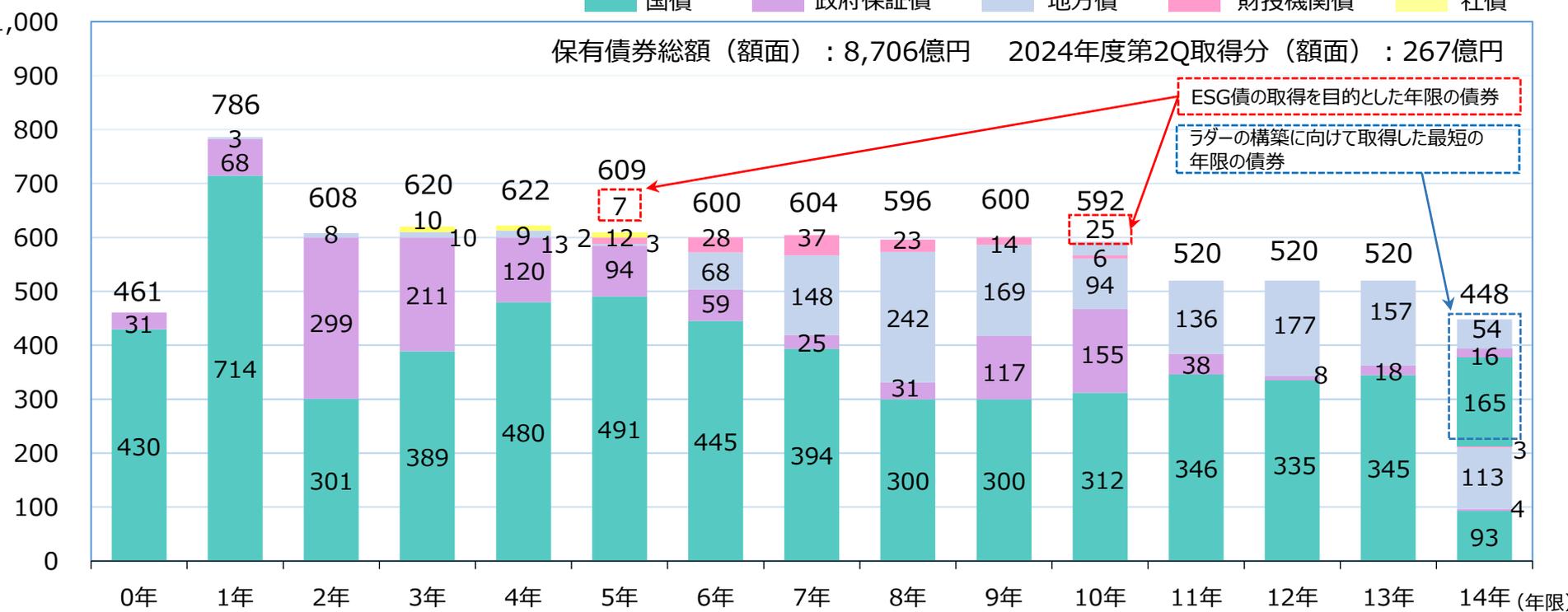
額面残高



2024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

額面残高8,706億円分の保有債券のラダー型ポートフォリオは、下図のとおり。新規に取得した債券を含め、評価基準に合致。

保有債券額 (単位: 億円)



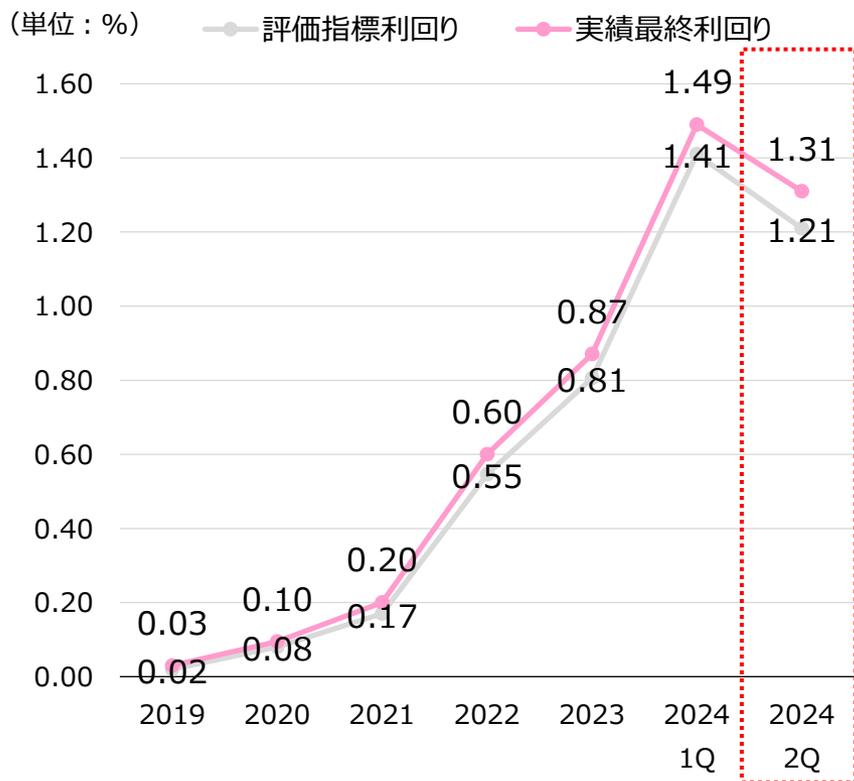
<評価基準>

- ① 年限2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2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15億円、社債の新規取得額面が20億円を超えていないこと。

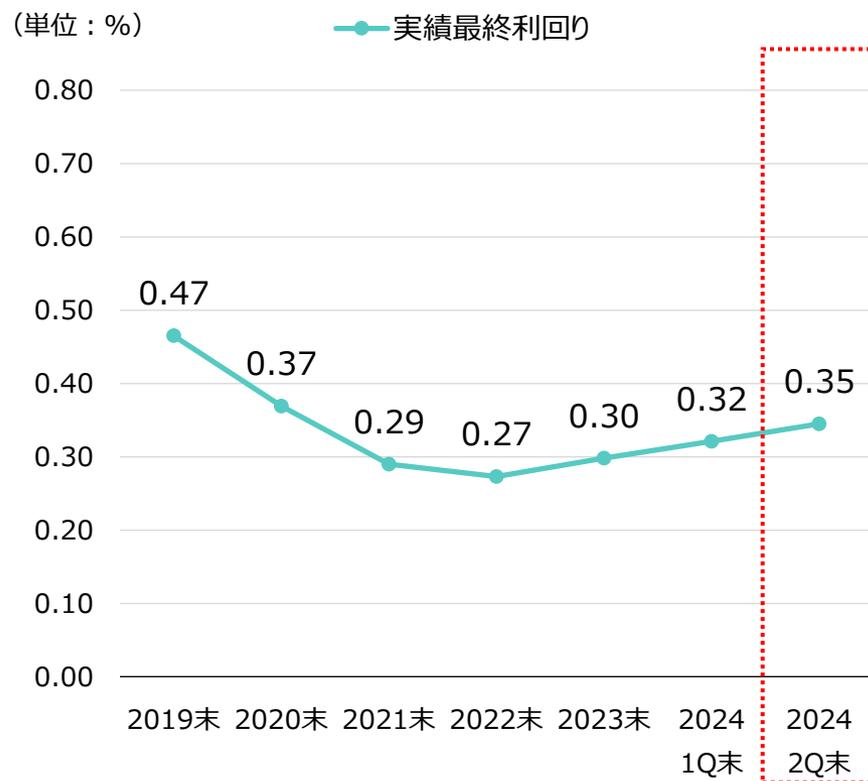
2024年度第2四半期 再資源化預託金等の運用実績 (2) 債券運用の実績

新規取得債券の実績最終利回りは、1.31%となり、評価指標利回り1.21%を上回る結果となった。資産全体の利回りは、第2Q末時点で0.35%となり、2023年度末の利回りを0.05ポイント上回る結果となった。

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の。

2024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

2024年度第2QにおいてはESG債を35億円取得。本財団のWebサイトにて投資表明をした債券は下表のとおり。

発行体	群馬県	兵庫県	北九州市
債券種別	地方債	地方債	地方債
ESG種別	グリーンボンド	グリーンボンド	サステナビリティボンド
銘柄名	群馬県公募公債 (10年・グリーンボンド) 第2回	兵庫県令和6年度第4回公募公債 (グリーンボンド・10年)	第4回北九州市サステナビリティボンド 10年公募公債(北九州市SDGs未来債)
発行総額	100億円	100億円	79億円
利率	年1.130%	年1.130%	年0.933%
期限	10年(償還日:34年7月14日)	10年(償還日:34年7月14日)	10年(償還日:34年8月23日)
格付	—	—	—
適合する原則等	グリーンボンド原則(ICMA、2021) グリーンボンドガイドライン(環境省、2022)	グリーンボンド原則(ICMA、2021) グリーンボンドガイドライン(環境省、2022)	グリーンボンド原則(ICMA、2021) グリーンボンドガイドライン(環境省、2022) ソーシャルボンド原則(ICMA、2023) ソーシャルボンドガイドライン(金融庁、2021) サステナビリティボンド・ガイドライン(ICMA、2021)
資金使途(例)	①【エネルギー効率】県有施設の省エネ化 ②【生物自然資源及び土地利用に係る環境維持型管理】林道整備 ③【陸上及び水生生物の多様性の保全】河川内緩衝帯の整備等 ④【気候変動への適応】河川改修やため池整備等の水害対策 等	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 河川改修 ④ 森林整備 ⑤ コウノトリの生息環境整備 等	① 風力発電関連産業の総合拠点化 ② 風水害・高潮災害の予防 ③ 災害廃棄物処理への対応 ④ 自然環境の保全 ⑤ 環境性能の高い公共施設の新築・改修 ⑥ 子育て・教育環境の整備 等

2024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	埼玉県	千葉市	滋賀県	徳島県
債券種別	地方債	地方債	地方債	地方債
ESG種別	サステナビリティボンド	グリーンボンド	サステナビリティ・リンク・ボンド	サステナビリティボンド
銘柄名	埼玉県第3回公募公債 (サステナビリティボンド・10年)	千葉市令和6年度第4回 公募公債 (グリーンボンド)	滋賀県第3回サステナビリティ・ リンク・ボンド公募公債	徳島県令和6年度第1回公募公 債(サステナビリティボンド・10年)
発行総額	100億円	50億円	36億円	45億円
利率	年0.933%	年0.913%	年0.969%	年0.969%
期限	10年 (償還日: 34年8月30日)	10年 (償還日: 34年6月20日)	10年 (償還日: 34年9月29日)	10年 (償還日: 34年9月29日)
格付	AAA(JCR)	AA(R&I)	—	AA(R&I)
適合する 原則等	グリーンボンド原則(ICMA、 2021) グリーンボンドガイドライン (環境省、 2022) ソーシャルボンド原則(ICMA、 2021) ソーシャルボンドガイドライン (金 融庁、2021) サステナビリティボンド・ガイドライン (ICMA、2021)	グリーンボンド原則(ICMA、 2021) グリーンボンドガイドライン (環境省、 2022) ソーシャルボンド原則(ICMA、 2023) ソーシャルボンドガイドライン (金 融庁、2021) サステナビリティボンド・ガイドライン (ICMA、2022)	サステナビリティリンクボンド原則 (ICMA、2020)	グリーンボンド原則(ICMA、 2021) グリーンボンドガイドライン (環境省、 2022) ソーシャルボンド原則(ICMA、 2023) ソーシャルボンドガイドライン (金 融庁、2021) サステナビリティボンド・ガイドライン (ICMA、2021)
資金使途 (例)	① 河川改修や調節池の整備・ 質的改良 ② 身近な緑の保全 ③ 防災ヘリコプターの更新による 消防防災力の充実 ④ 朝霞児童相談所 (仮称) の 新設 等	① 新清掃工場と北清掃工場の 整備 (新規) ② 自転車走行環境の整備 (新 規) ③ 河川の浚渫 (継続) 等	【KPI (評価指標)】 温室効果ガス排出量の削減 【SPTs】 県庁にて、2030年度に2014年 度比で温室効果ガス排出量を 50%削減 【主な取組の例】 省エネルギーの推進、再生可能エ ネルギーの利用促進、3Rの推進 及びその他資源の有効利用 等	① 県有施設のZEB化省エネ化 ② 森林整備、林道整備 ③ 浸水、高潮対策 (河川改修、 海岸保全施設整備など) ④ ・土砂災害対策 (地すべり防 止対策) など ⑤ 県有施設の老朽化・防災対 策 ⑥ 県立支援学校における施設 整備 等

2024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

2024年度第2Q末時点における保有債券全体に占めるESG債の割合は、4.0%となった。

保有債券全体に占める ESG債の割合 (額面)

ESG債の種別構成 (額面)

