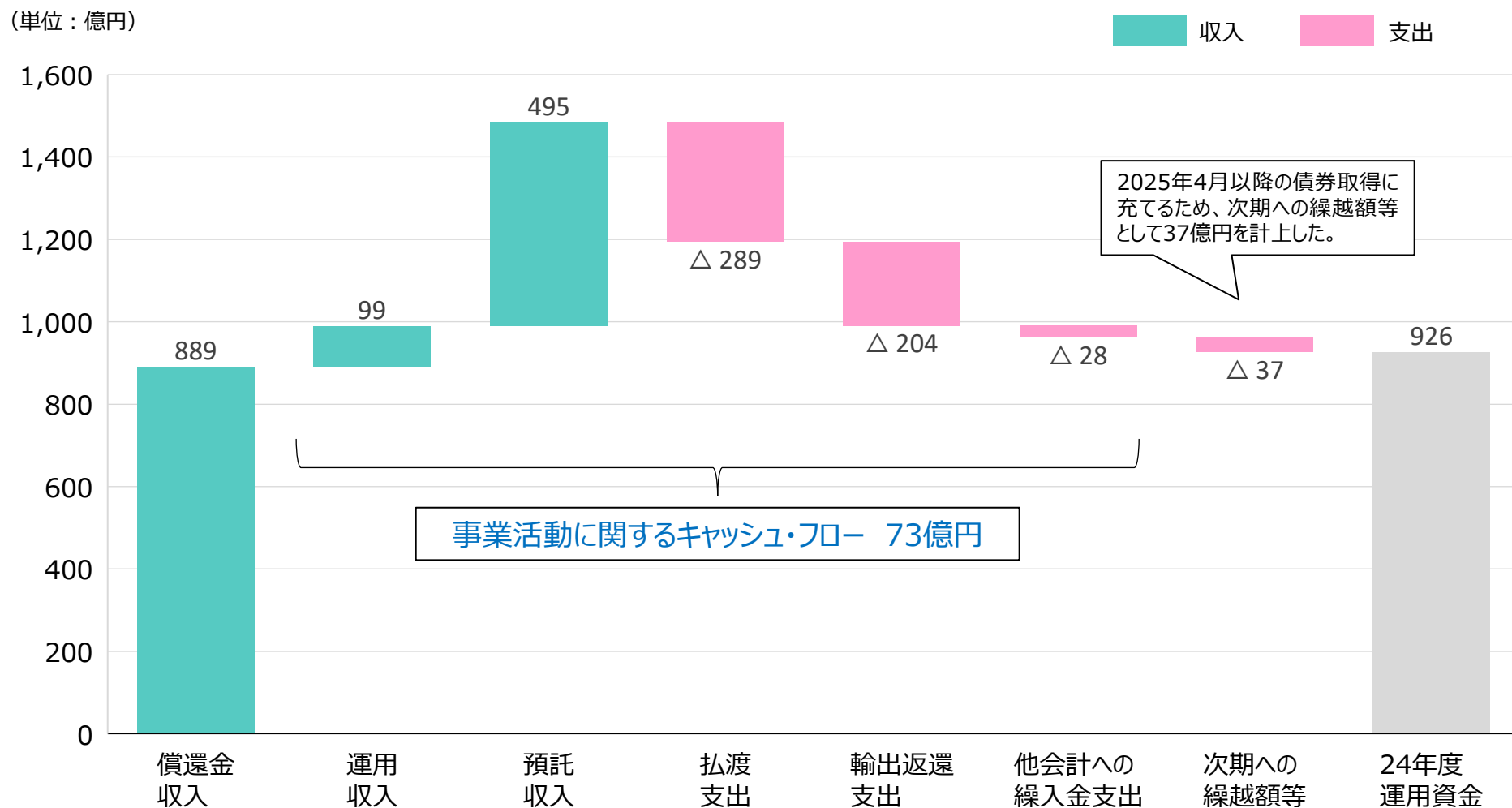


2024年度運用実績 (1) 運用資金

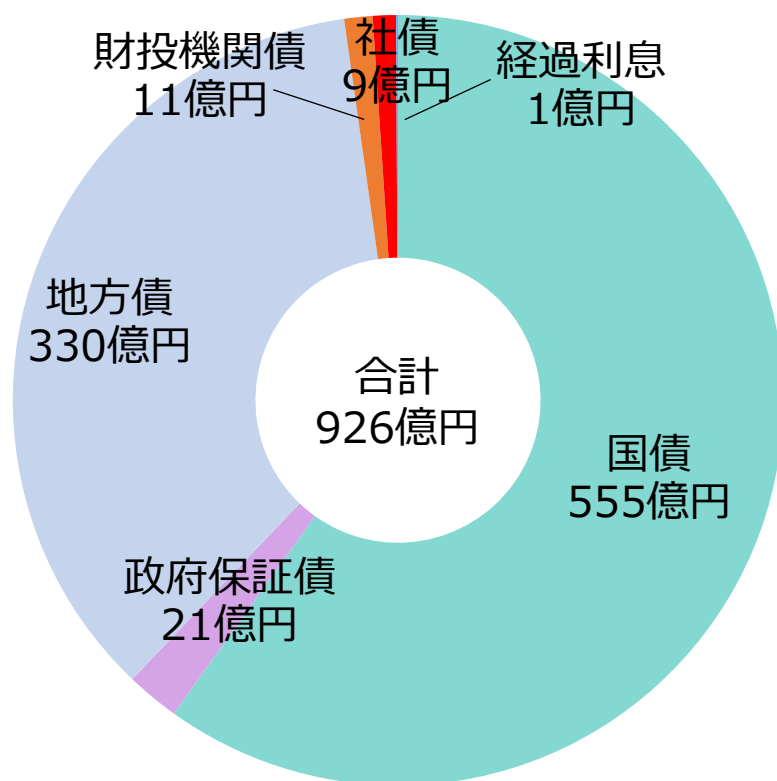
2024年度の運用資金は926億円（事業活動に関するキャッシュ・フローは73億円のプラス）。



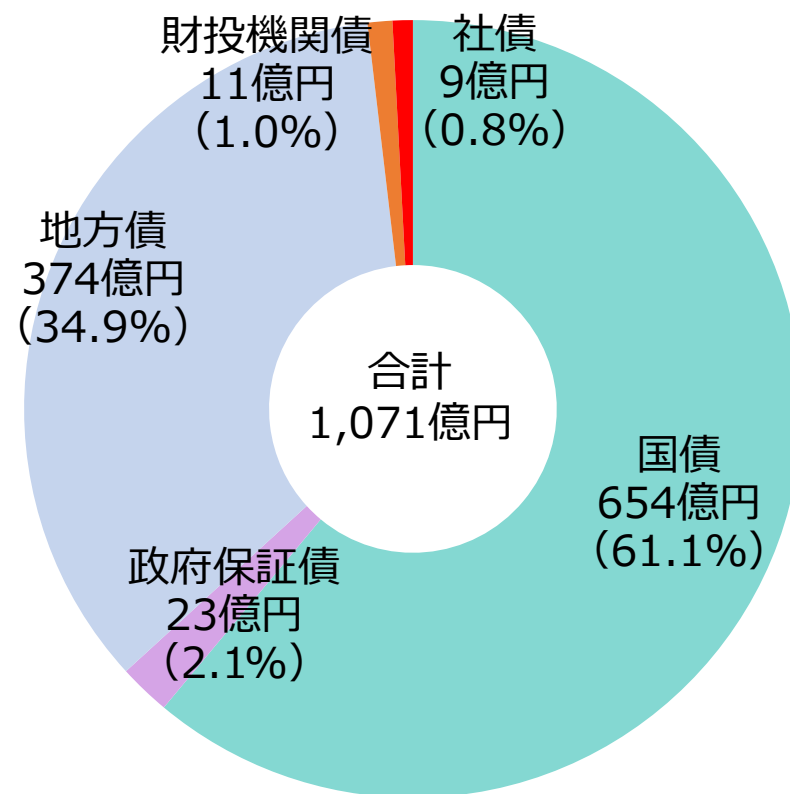
2024年度運用実績 (2) 債券運用の実績

2024年度は年限5年、年限10～15年の債券を新規に取得した（簿価ベース926億円、額面ベース1,071億円）。

簿価ベース



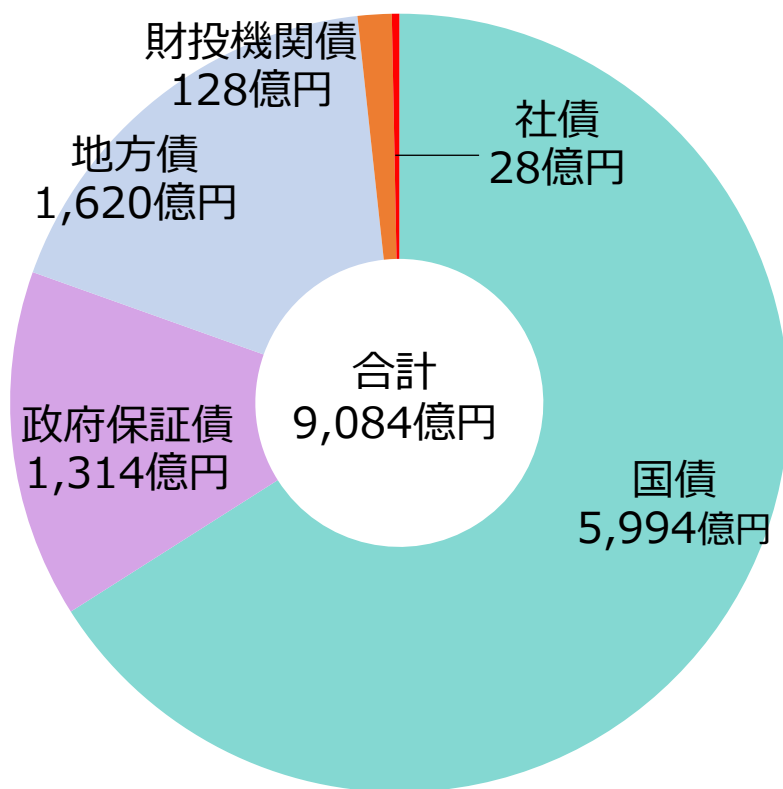
額面ベース



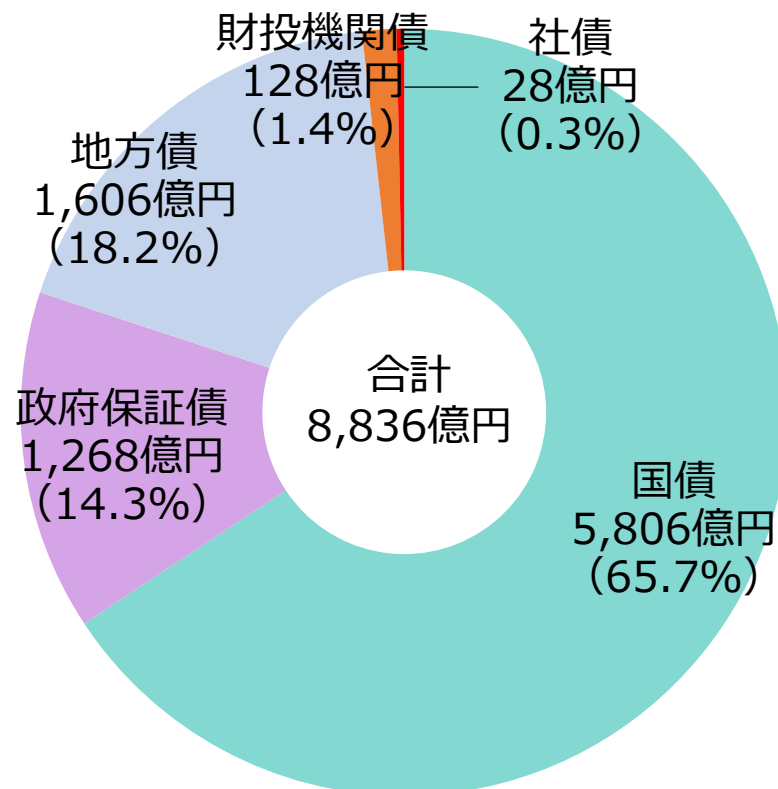
2024年度運用実績 (2) 債券運用の実績

2024年度末における保有債券は額面残高で8,836億円となった。

簿価残高

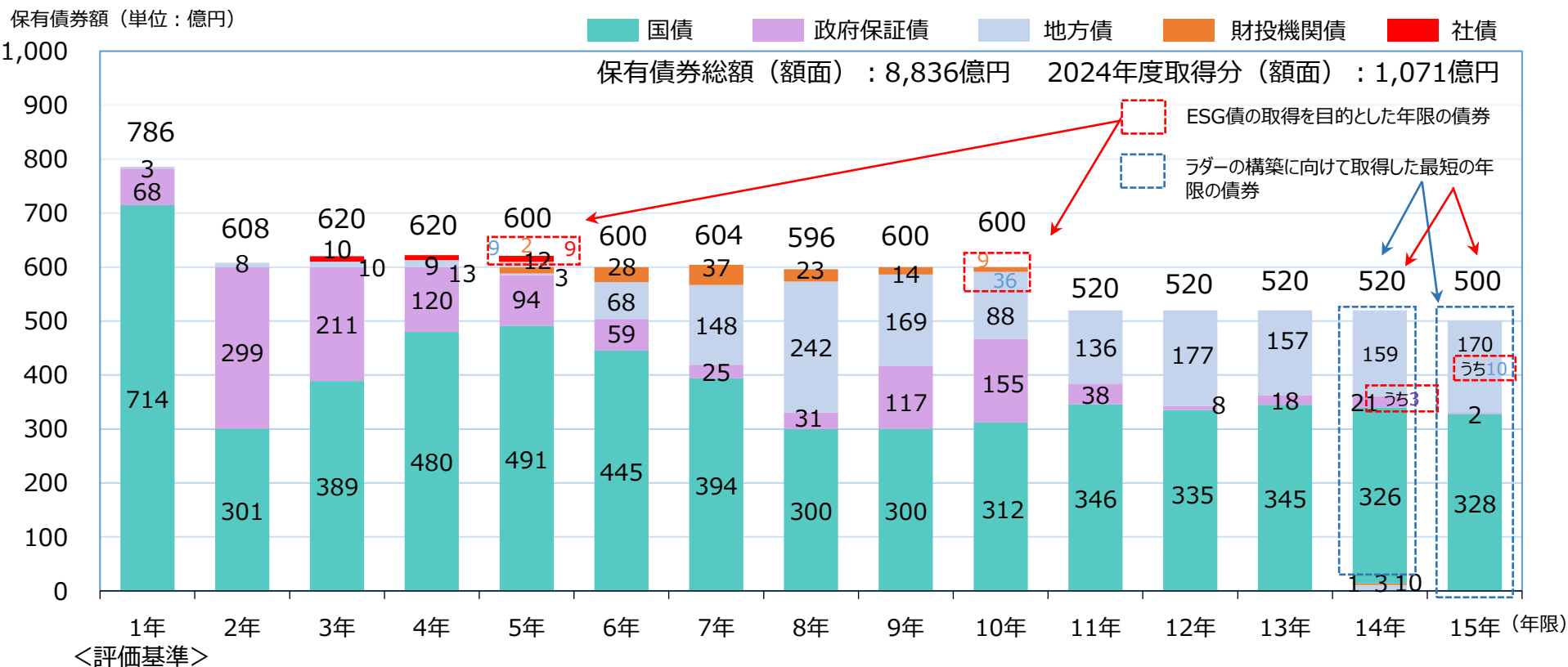


額面残高



2024年度運用実績 (2) 債券運用の実績

額面残高8,836億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、評価基準に合致している。

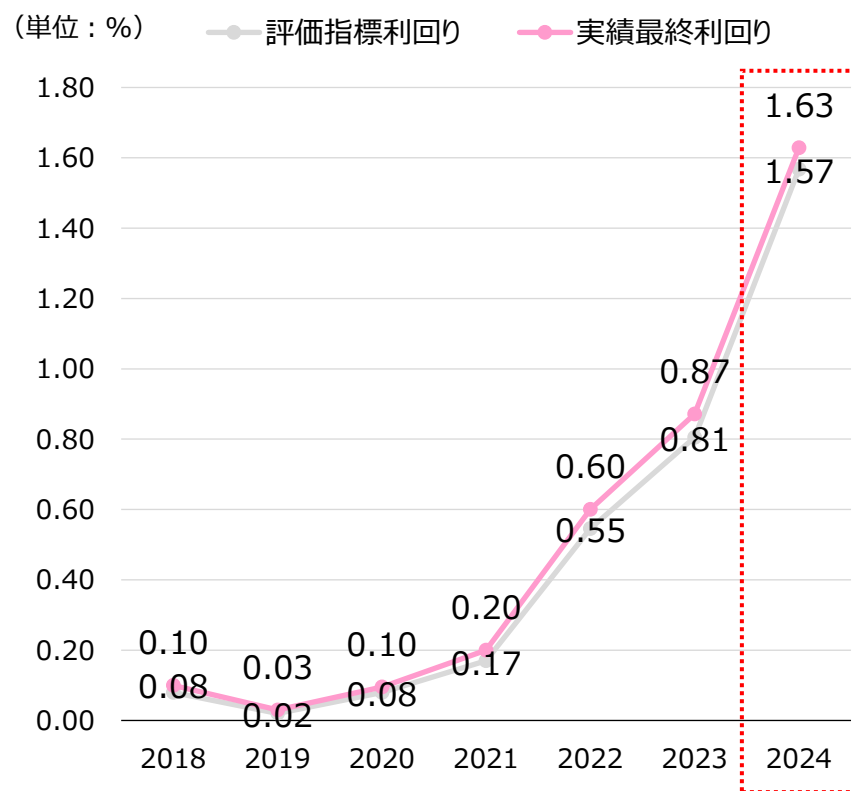


- ① 年限3年以降で額面残高600億円程度まで構築した年限において、許容乖離幅が600億円から±5%の範囲に収まっていること。
- ② 年限3年以降で額面残高600億円程度まで構築した年限において、国債以外の債券の合計額が国債の額を超える場合は、国債の額からの乖離幅が5%以内に収まっていること。
- ③ 財投機関債及び社債の保有上限額（額面ベース）が、ポートフォリオ全体のうち5%を超えていないこと。
- ④ 社債の保有額が財投機関債の保有額を超えていないこと。
- ⑤ 財投機関債の新規取得額面が15億円、社債の新規取得額面が20億円を超えていないこと。

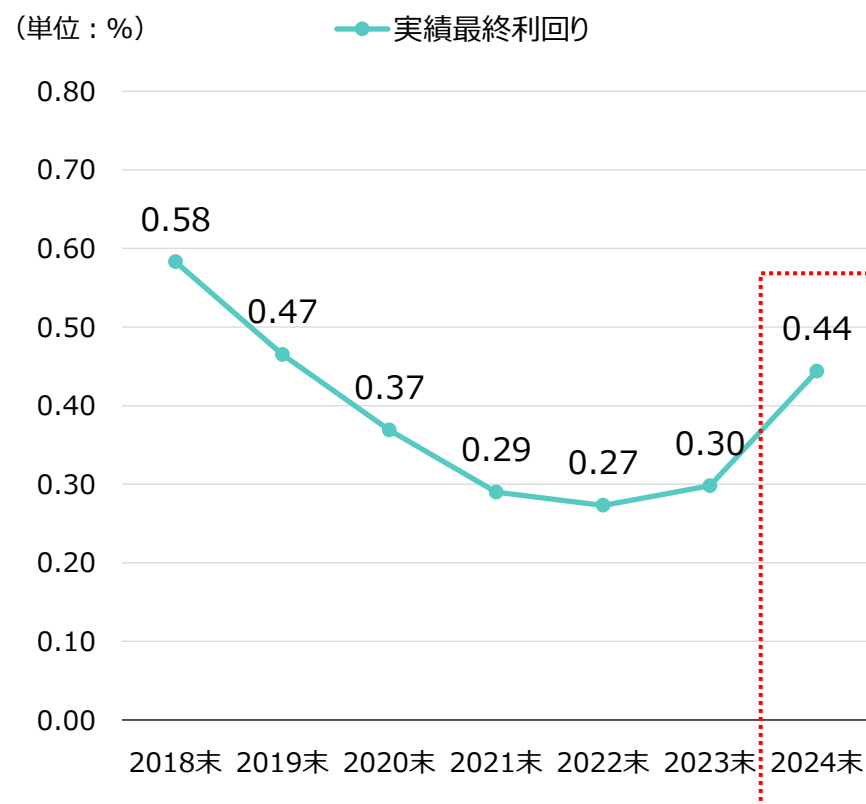
2024年度運用実績 (2) 債券運用の実績

新規取得債券の実績最終利回りは1.63%となり、評価指標利回り1.57%を上回る結果となった。資産全体の利回りは0.44%となり、2023年度末の利回りを0.14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。

2024年度運用実績 (3) ESG債の取得

2024年度においてはESG債を78億円取得。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。

【グリーンボンド】

種別	発行体
地方債	福岡県
	兵庫県
	群馬県
	千葉市
	福井県
	札幌市
	川崎市
	大阪府
	愛知県
	広島県
	大阪市
	共同発行団体

【サステナビリティボンド】

種別	発行体
地方債	埼玉県
	北九州市
	徳島県
財投機関債	独立行政法人 鉄道建設・運輸施設整備支援機構
	独立行政法人都市再生機構
	沖縄振興開発金融公庫

【サステナビリティ・リンク・ボンド】

種別	発行体
地方債	滋賀県

2024年度運用実績 (3) ESG債の取得

2024年度末時点における保有債券全体に占めるESG債の割合は4.2%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）

