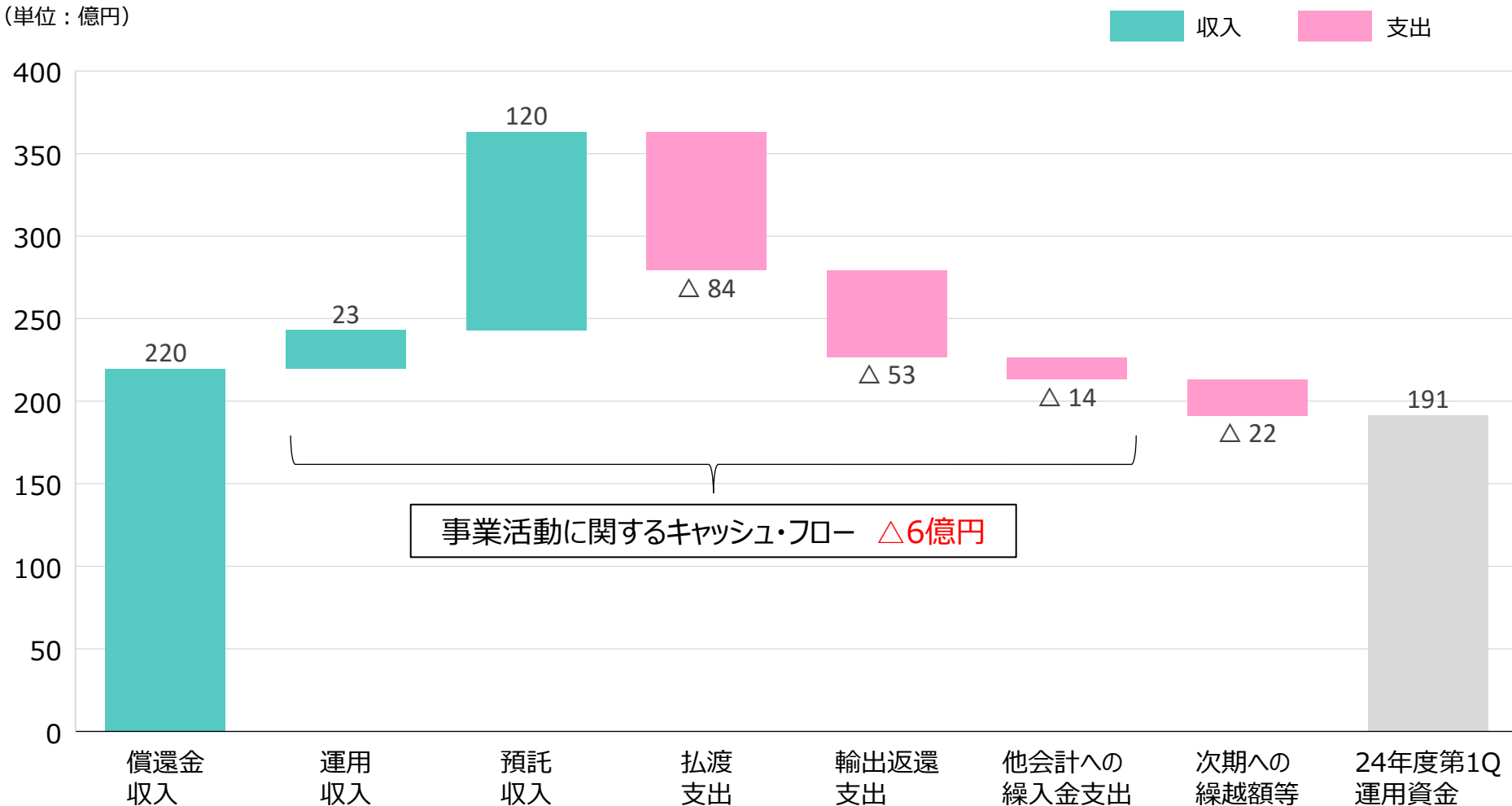


2024年度第1四半期 再資源化預託金等の運用実績 (1) 運用資金

2024年度第1Qの運用資金は191億円（事業活動に関するキャッシュ・フローは6億円のマイナス）。

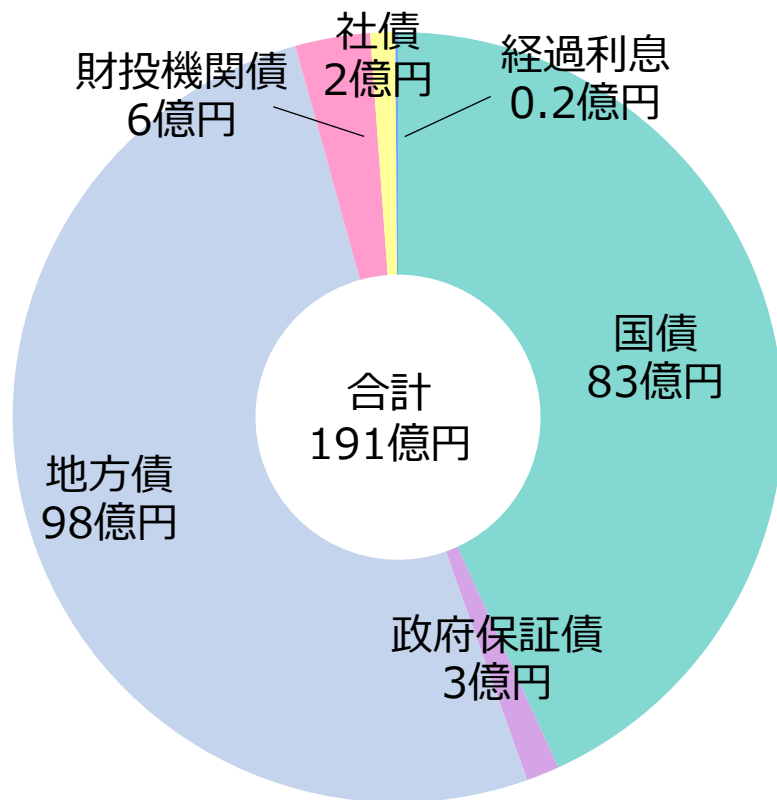
(単位：億円)



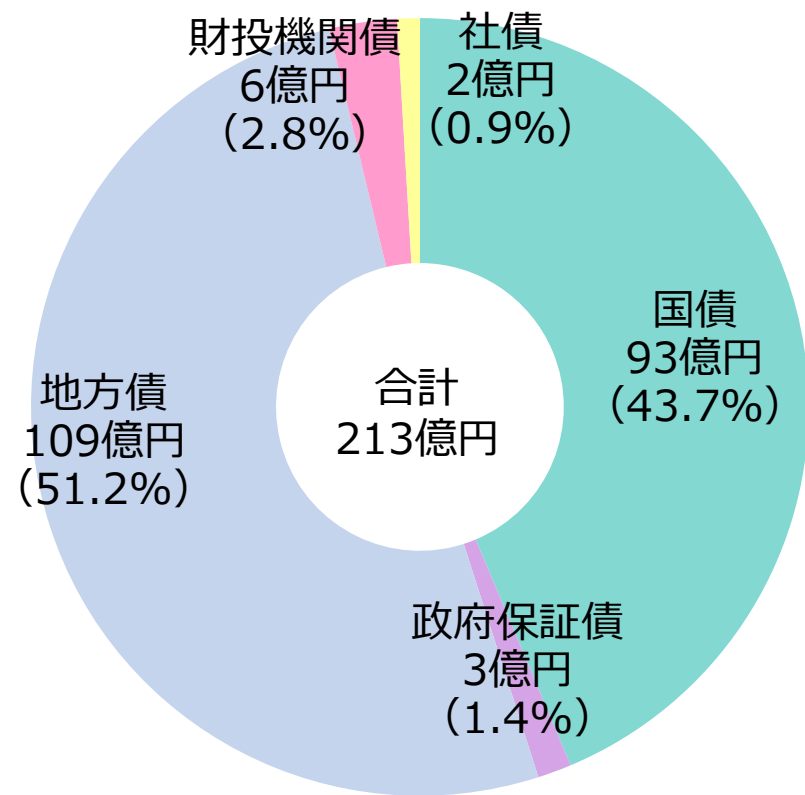
2024年度第1四半期 再資源化預託金等の運用実績 (2) 債券運用の実績

2024年度第1Qは年限5年、10年、14年の債券を新規に取得（簿価ベース191億円、額面ベース213億円）。

簿価ベース



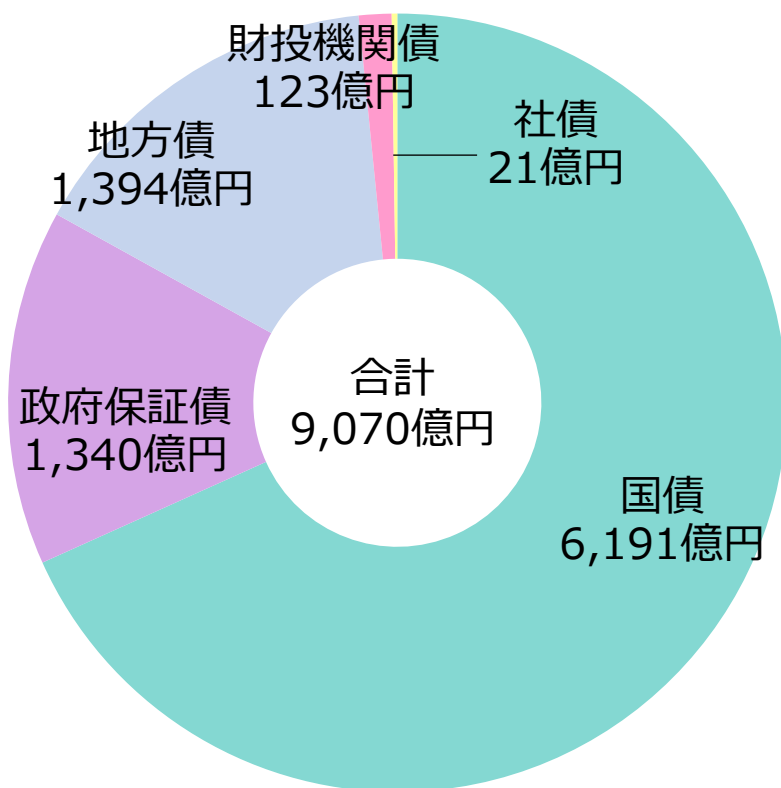
額面ベース



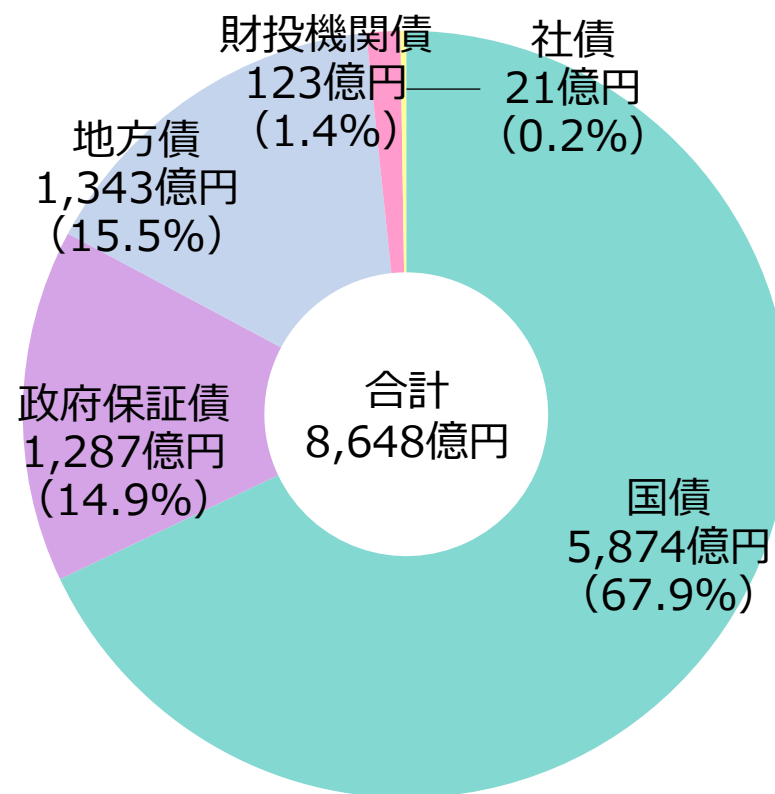
2024年度第1四半期 再資源化預託金等の運用実績 (2) 債券運用の実績

2024年度第1Q末における保有債券は額面残高で8,648億円となった。

簿価残高



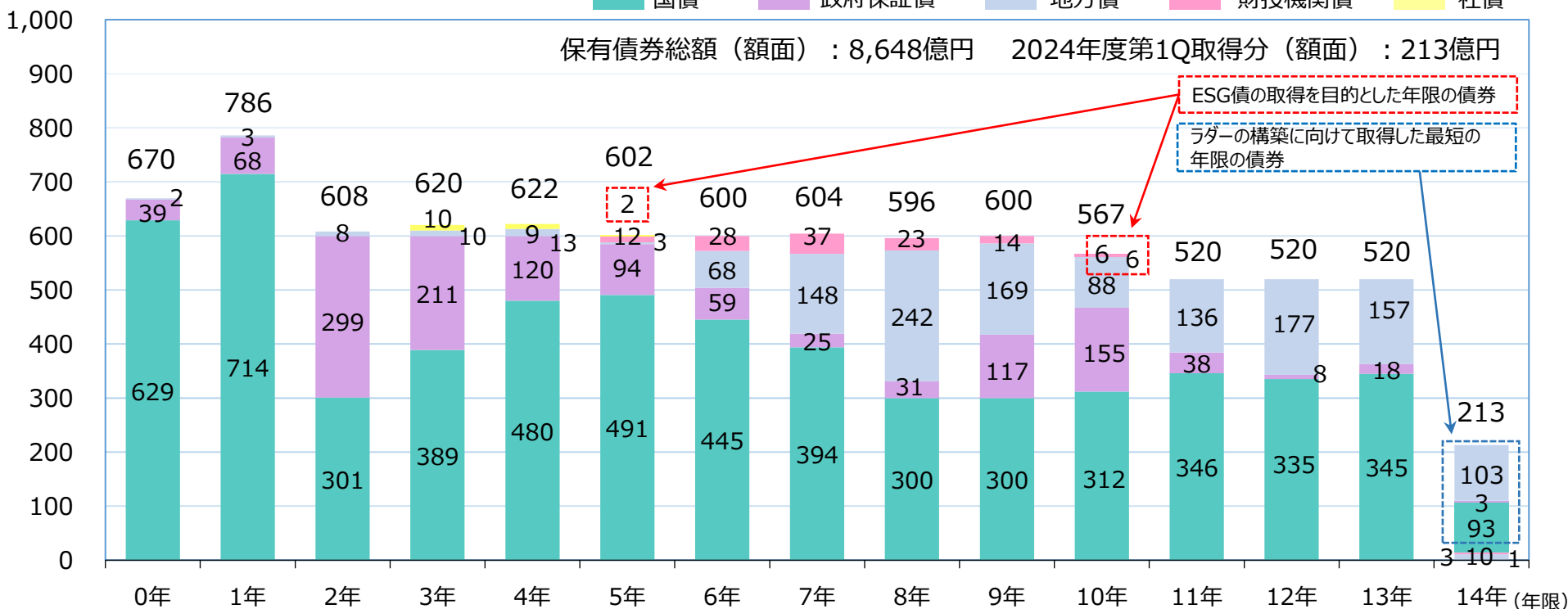
額面残高



2024年度第1四半期 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8,648億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（現在、年限2年以降で15年ラダーを構築中）。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）



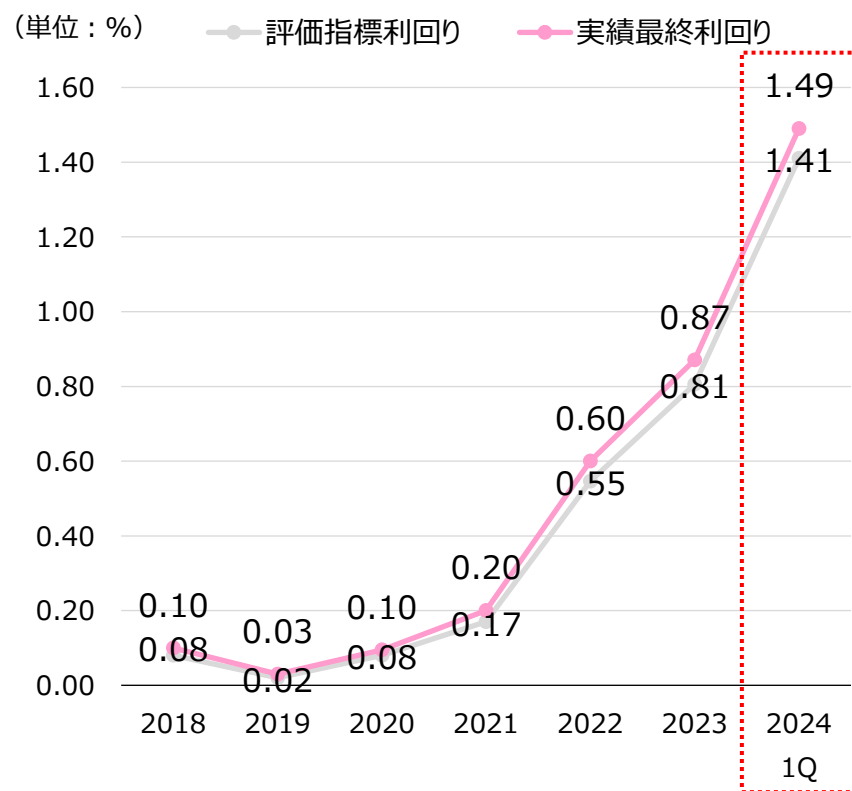
<評価基準>

- 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。

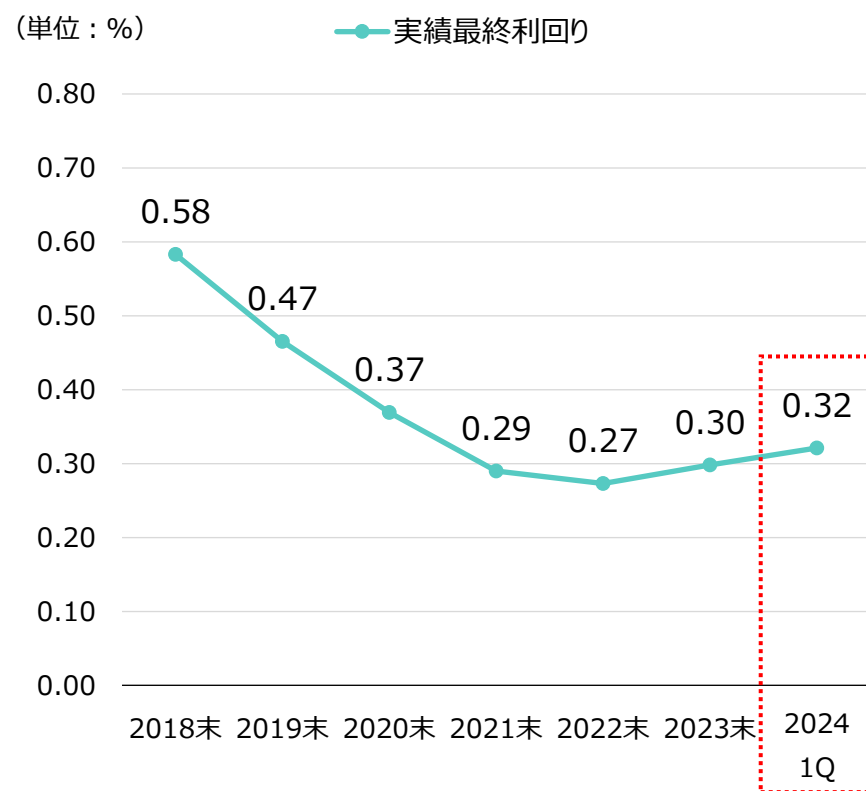
2024年度第1四半期 再資源化預託金等の運用実績 (2) 債券運用の実績

新規取得債券の実績最終利回りは1.49%となり、評価指標利回り1.41%を上回る結果となった。資産全体の利回りは第1Q末時点で0.32%となり、2023年度末の利回りを0.02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年度第1四半期 再資源化預託金等の運用実績 (3) ESG債の取得

2024年度第1QにおいてはESG債を14億円取得。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	鉄道建設・運輸施設整備支援機構	福岡県	都市再生機構
債券種別	財投機関債	地方債	財投機関債
ESG種別	サステナビリティボンド	グリーンボンド	サステナビリティボンド
銘柄名	第168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）	福岡県令和6年度第1回公募公債（グリーンボンド・10年）	第195回都市再生債券
発行総額	130億円	200億円	100億円
利率	年1.019%	年1.004%	年1.043%
期限	10年（償還年月日：2034年5月30日）	10年（償還年月日：2034年5月31日）	10年（償還年月日：2034年6月20日）
格付	AA+ (R&I)、A1 (MDY)	A1 (MDY)	AA+ (R&I)、A1 (MDY)
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) 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、2021) ソーシャルボンドガイドライン (金融庁) 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) 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 都市鉄道利便増進事業、主要幹線及び大都市交通線、民鉄線、都市鉄道線、整備新幹線等の建設 ② 国内旅客船又は国内貨物船の建造について、船舶共有建造業務を通じた低利・長期資金の供給及び建造に関する技術的支援 等	① 新福岡武道館、ワンヘルスセンターなどの整備（ZEB化） ② 久留米総合庁舎、城南高等学校などへの太陽光パネルの設備導入 ③ 八女総合庁舎、農業大学校などへのLED照明等の省エネ性能の高い設備導入 等	① 防災公園街区整備事業における公園整備、植樹等によるCO2削減 ② 市街地再開発事業等における新築物件のZEB・ZEH（ZEH-Mを含む） ③ 既存賃貸住宅における植樹、樹木の移植保存による環境維持型管理 等

2024年度第1四半期 再資源化預託金等の運用実績 (3) ESG債の取得

2024年度第1Q時点における保有債券全体に占めるESG債の割合は、3.6%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）

