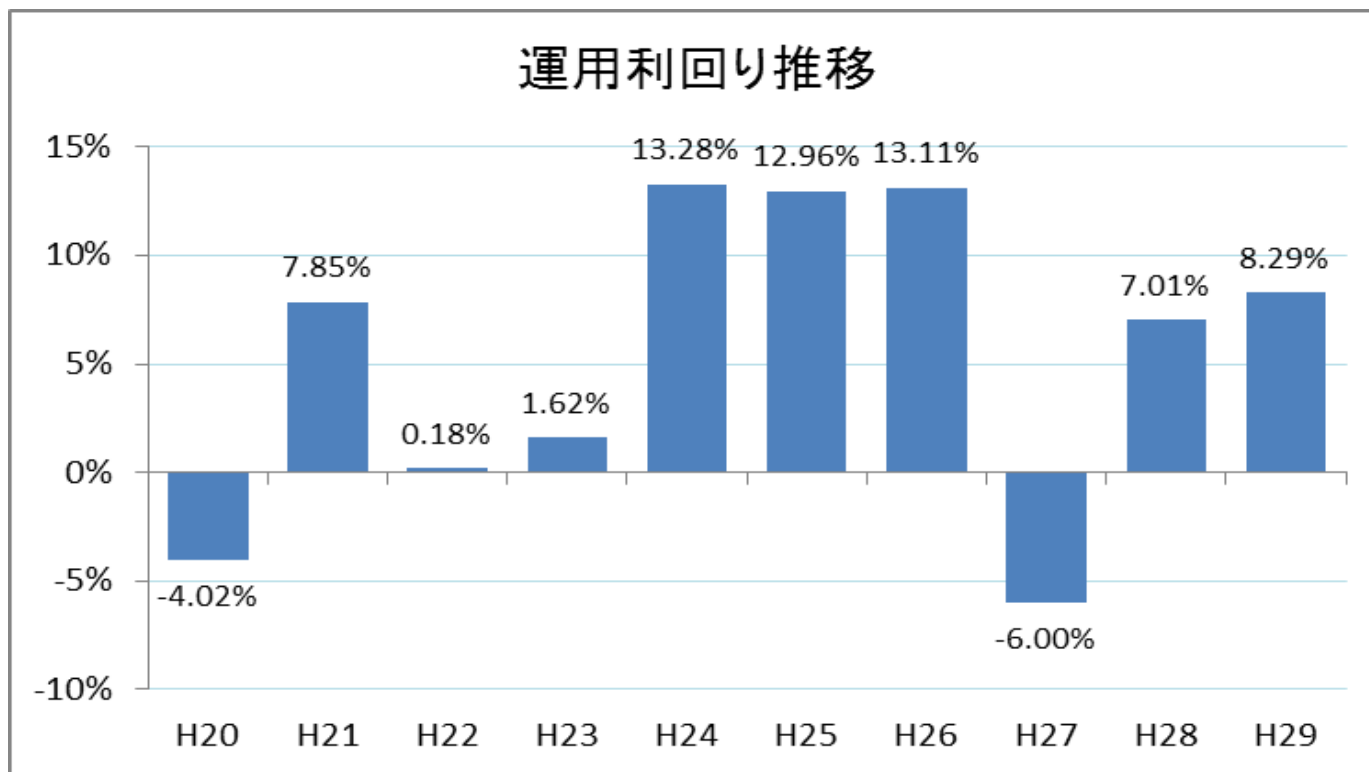


平成29年度特定事業推進資金の運用 状況について

2018年6月19日

特定事業推進資金の運用利回り推移



* 投資有価証券を含む。

平成29年度のパフォーマンス

平成29年度の特定事業推進資金の運用利回りは+8.29%となりました

国内株式と外国株式は、市場価格が高かった時点においてリバランスを実施した効果によりベンチマークを上回りました

国内債券は、短期債中心の運用のためベンチマークをやや下回りました

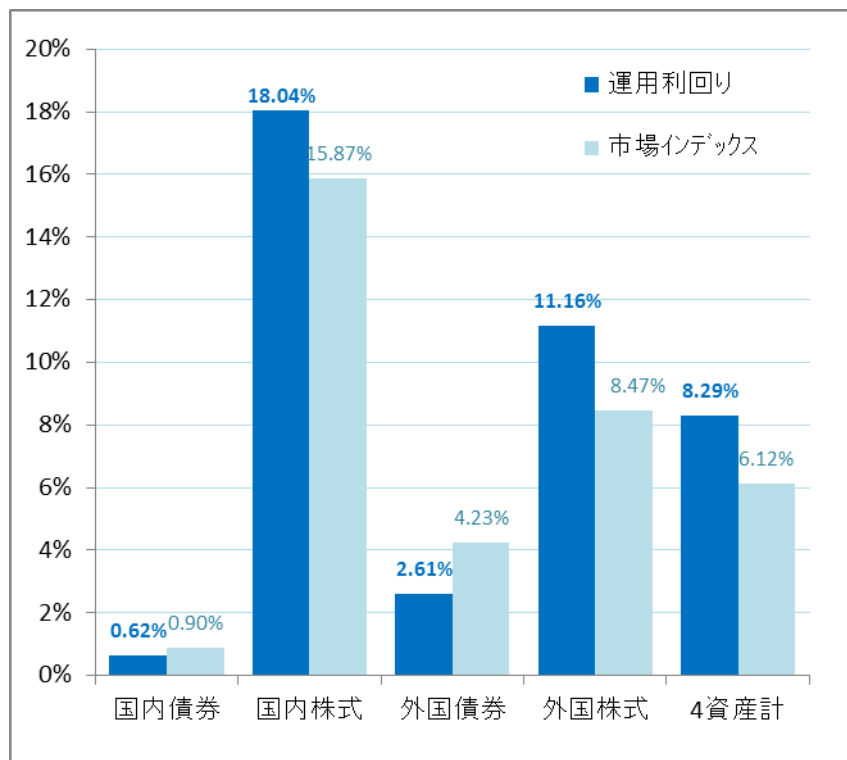
外国債券は、前年度末のETF価格がやや高い価格で終了したことに伴いベンチマークを下回りました

当機構では配当金を再投資していないため複利効果は得られていません

	運用利回り	市場インデックス	差異
国内債券	0.62%	0.90%	0.28%
国内株式	18.04%	15.87%	2.17%
外国債券	2.61%	4.23%	1.62%
外国株式	11.16%	8.47%	2.69%
4資産計	8.29%	6.12%	2.17%

* 投資有価証券を含む。

平成29年度のパフォーマンス



* 投資有価証券を含む。

ベンチマーク

国内債券：NOMURA-BPI総合

国内株式：TOPIX（配当込み）

外国債券：シティグループ世界国債インデックス
（日本を除く・円換算）

外国株式：MSCI-Kokusai
（円換算・配当再投資・GROSS）

収益率計算式

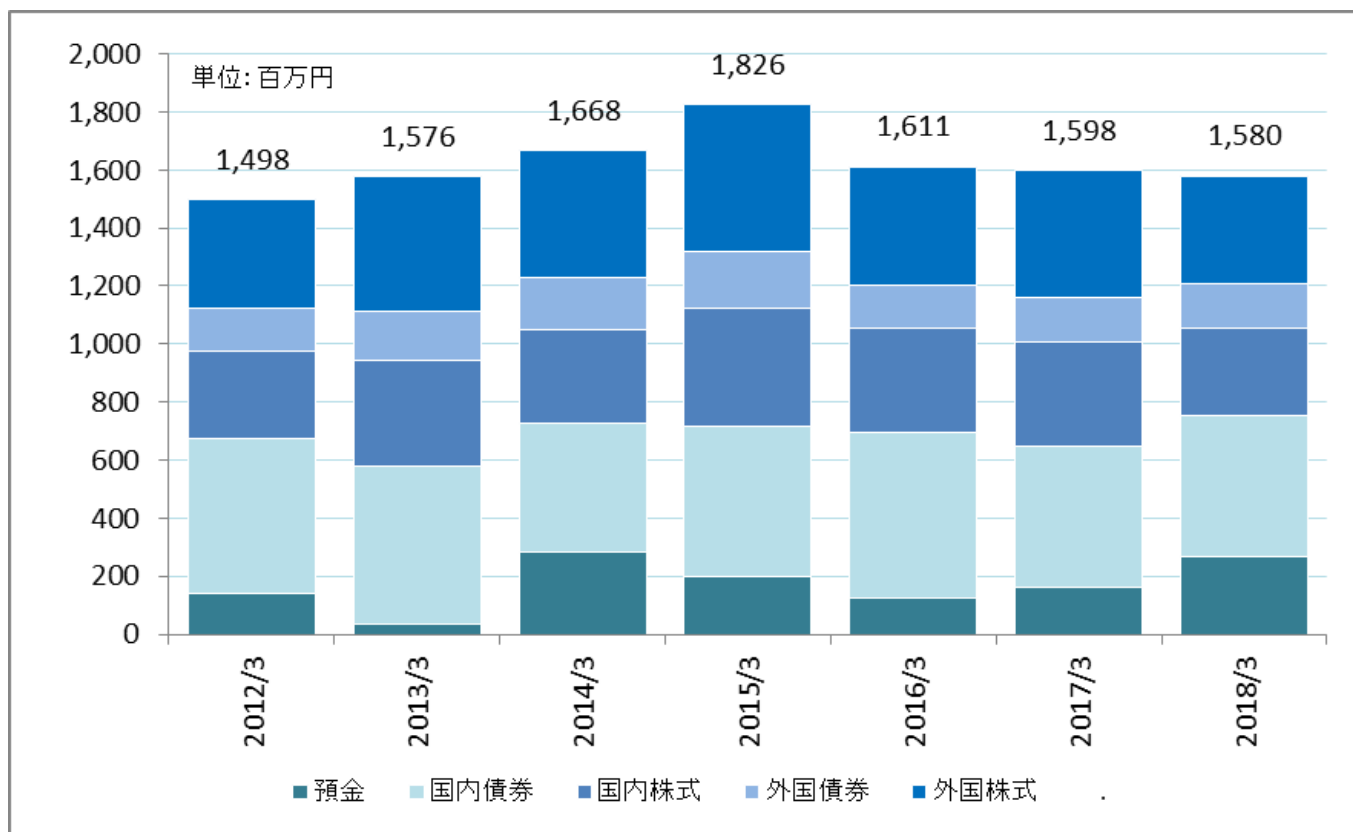
$$\text{収益率} = \frac{\text{当期利息配当収入} + \text{当期実現損益} + \text{当期評価損益}}{\text{期中平均元本}} \times 100$$

期中平均元本 = 積数の総計 ÷ 365

積数 = 前期末時価(新規購入の場合は"取得時の時価") × 保有日数

運用資産残高推移

運用資産残高は、運営資金の取り崩し後においても残高は相応に維持できている状況です



* 投資有価証券を含む。

特定事業推進資金の資産構成の推移

(単位:百万円)

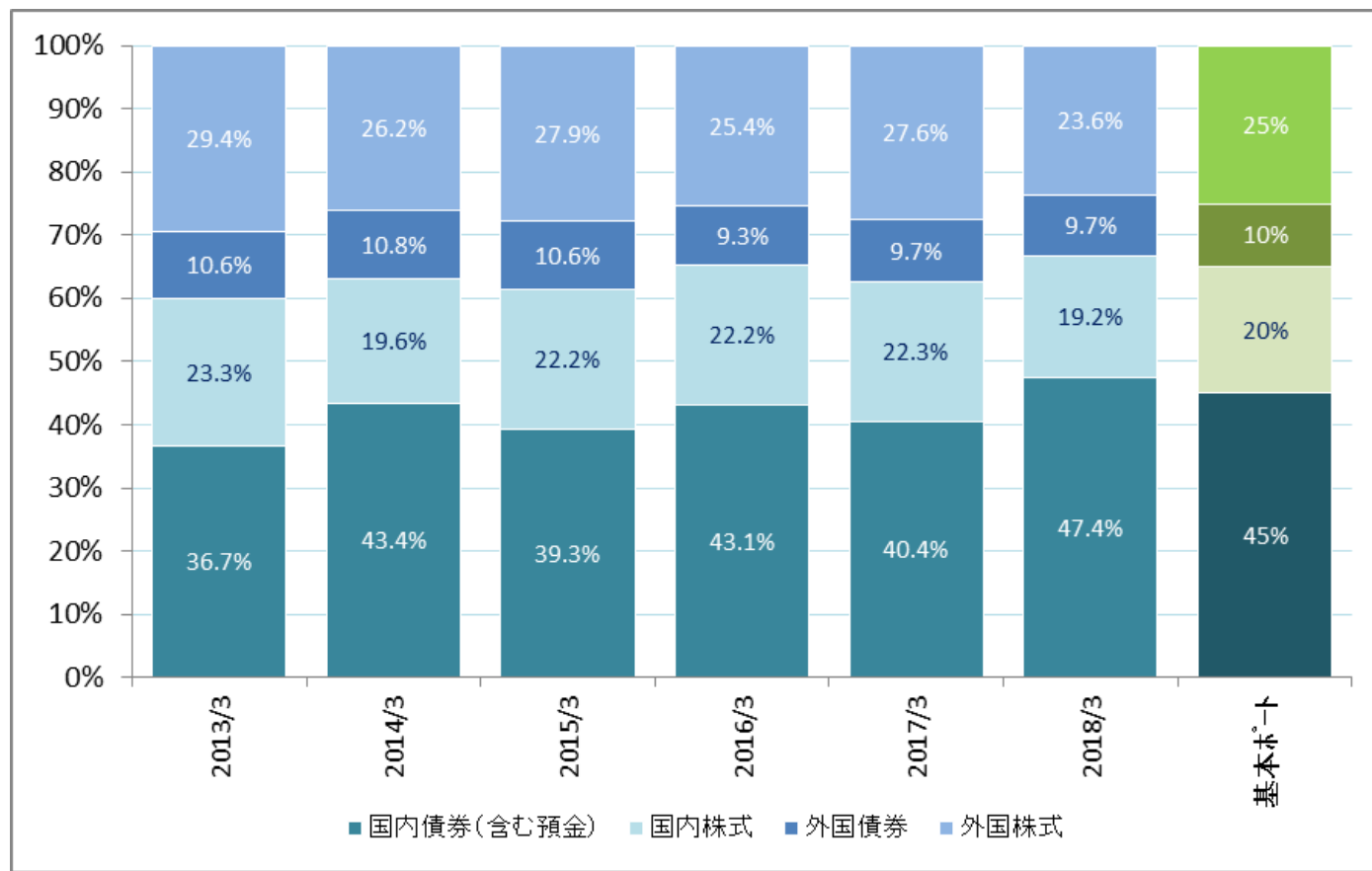
	H20	H21	H22	H23	H24	H25	H26	H27	H28	H29
特定事業推進資金	1,728	1,712	1,596	1,498	1,575	1,697	1,826	1,611	1,598	1,580
国内債券	1,614	1,273	705	638	544	442	521	569	487	486
国内株式	35	162	244	301	367	326	405	357	337	302
外国債券	-	-	140	147	167	180	194	150	154	153
外国株式	29	250	229	374	464	437	509	409	457	372
預貯金	49	27	278	38	33	311	197	125	161	265

* 投資有価証券を含む。

* 端数処理の関係上、合計と一致しないことがある。

運用資産残高構成比推移 (除く基本財産)

ほぼ基本ポートフォリオの中心値に沿った資産配分を継続



* 投資有価証券を含む。

平成29年度の有価証券異動状況

n 国内債券

< 償還 >

2017年 9月	埼玉県債	額面5,000万円 (基本財産)
" 12月	第144回オリックス	額面1億円
2018年 2月	大阪府債	額面2,000万円 (基本財産)

< 購入 >

2017年10月	静岡県平成28年度第3回公債	額面5,000万円、 利率0.170%、償還2027年3月 (基本財産)
2018年 3月	第39回日本郵船	額面1億円、利率0.53%、償還2024年5月

n 国内株式

< 売却 >

2017年10月	国内株式ETF	(10,600口、約1,800万円)	* リバランスのため
" 12月	"	(10,600口、約2,000万円)	"
2018年 1月	"	(35,490口、約6,900万円)	"

平成29年度の有価証券異動状況

n 外国債券

なし

n 外国株式

< 売却 >

2017年10月	外国株式ETF (1,725口、約1,200万円)	* リバランスのため
" 12月	" (3,126口、約2,300万円)	"
2018年 1月	" (9,100口、約 6,800万円)	"

資産区分別・勘定別残高（参考）

（単位：円）

	国内債券	国内株式	外国債券	外国株式	預金	合計
基本財産	315,992,071				20,150,929	336,143,000
公益目的保有財産	71,025,000	302,889,843	143,420,000	372,592,736	160,248,224	1,050,175,803
特定研究事業等	153,953,500				36,046,500	190,000,000
特定年金ライフプラン事業					50,000,000	50,000,000
2020年代前半調査研究	261,292,400				14,707,600	276,000,000
投資有価証券			10,100,000		4,175,952	14,275,952
合計	802,262,971	302,889,843	153,520,000	372,592,736	285,329,205	1,916,594,755

有価証券保有明細 (参考)

< 公益目的保有財産 >

< 特定調査研究等事業 >

特定事業推進資金 (公益目的保有財産)					
資産区分	銘柄	口数 / 額面	単価	為替	残高 (円)
国内債券	第51回ソフトバンクグループ	50,000,000	101.95	1.00	50,975,000
国内債券	第39回日本郵船	20,000,000	100.25	1.00	20,050,000
国内株式	TOPIX連動型上場投資信託ETF(野村)	158,680	1,785.00	1.00	302,889,843
外国債券	上場外債ETF	2,840	50,500.00	1.00	143,420,000
外国株式	アイシェアズMSCIコクサイETF	21,000	64.62	106.48	144,495,490
外国株式	アイシェアズACWI	32,450	71.70	106.48	228,097,246
有価証券	有価証券計				889,927,579
その他	預金				160,248,224
公益目的保有財産計					1,050,175,803
特定事業推進資金 (特定調査研究等事業)					
資産区分	銘柄	口数 / 額面	単価	為替	残高 (円)
国内債券	第3回オリエント・コーポレーション	50,000,000	101.0070	1.00	50,503,500
国内債券	福岡県22年度第8回	100,000,000	103.4500	1.00	103,450,000
有価証券	有価証券計				153,953,500
その他	預金				36,046,500
特定調査研究等事業計					190,000,000

有価証券保有明細 (参考)

< 特定年金ライフプラン事業 >

< 2020年代前半調査研究事業 > < 投資有価証券 >

特定事業推進資金 (特定年金シニアプラン事業)					
資産区分	銘柄	口数 / 額面	単価	為替	残高 (円)
	該当なし				
有価証券	有価証券計				0
その他	預金				50,000,000
特定年金ライフプラン事業計					50,000,000
特定事業推進資金 (2020年代前半特定調査研究事業)					
資産区分	銘柄	口数 / 額面	単価	為替	残高 (円)
国内債券	772回農林債	80,000,000	100.3400	1.00	80,272,000
国内債券	第39回日本郵船	80,000,000	100.2500	1.00	80,200,000
国内債券	第46回ソフトバンクグループ	50,000,000	100.6338	1.00	50,316,900
国内債券	第3回オリエン特・コーポレーション	50,000,000	101.0070	1.00	50,503,500
有価証券	有価証券計				261,292,400
その他	預金				14,707,600
2020年代前半特定調査研究事業計					276,000,000
その他の固定資産 (投資有価証券)					
資産区分	銘柄	口数 / 額面	単価	為替	残高 (円)
外国債券	上場外債ETF	200	50,500	1.00	10,100,000
有価証券	有価証券計				10,100,000
その他	預金				4,175,952
投資有価証券計					14,275,952

有価証券保有明細 (参考)

< 基本財産 > (簿価評価)

銘柄	額面(千円)	簿価(円)	簿価単価	利率	償還日	年間利息(円)
第10回財形住宅債券	20,000	20,005,041	100.025	0.20%	2019/3/28	40,000
い第777号農林債	70,000	70,033,600	100.048	0.25%	2020/2/27	175,000
い第782号農林債	30,000	30,000,000	100.000	0.27%	2020/7/27	81,000
33回ANAホールディングス社債	50,000	50,000,000	100.000	0.26%	2020/9/11	130,000
利付国庫債券(10年)第312回	70,000	69,874,700	99.821	1.20%	2020/12/20	840,000
第398回大阪府公募公債	25,000	26,073,840	104.295	0.56%	2025/7/30	140,000
静岡県平成28年度第3回公債	50,000	50,004,890	100.010	0.17%	2027/3/19	85,000
債券合計・平均	315,000	315,992,071	100.315	0.47%		1,491,000
預金		20,150,929				
基本財産計		336,143,000				

基本財産：平成29年度の有価証券異動明細（参考）

n 国内債券

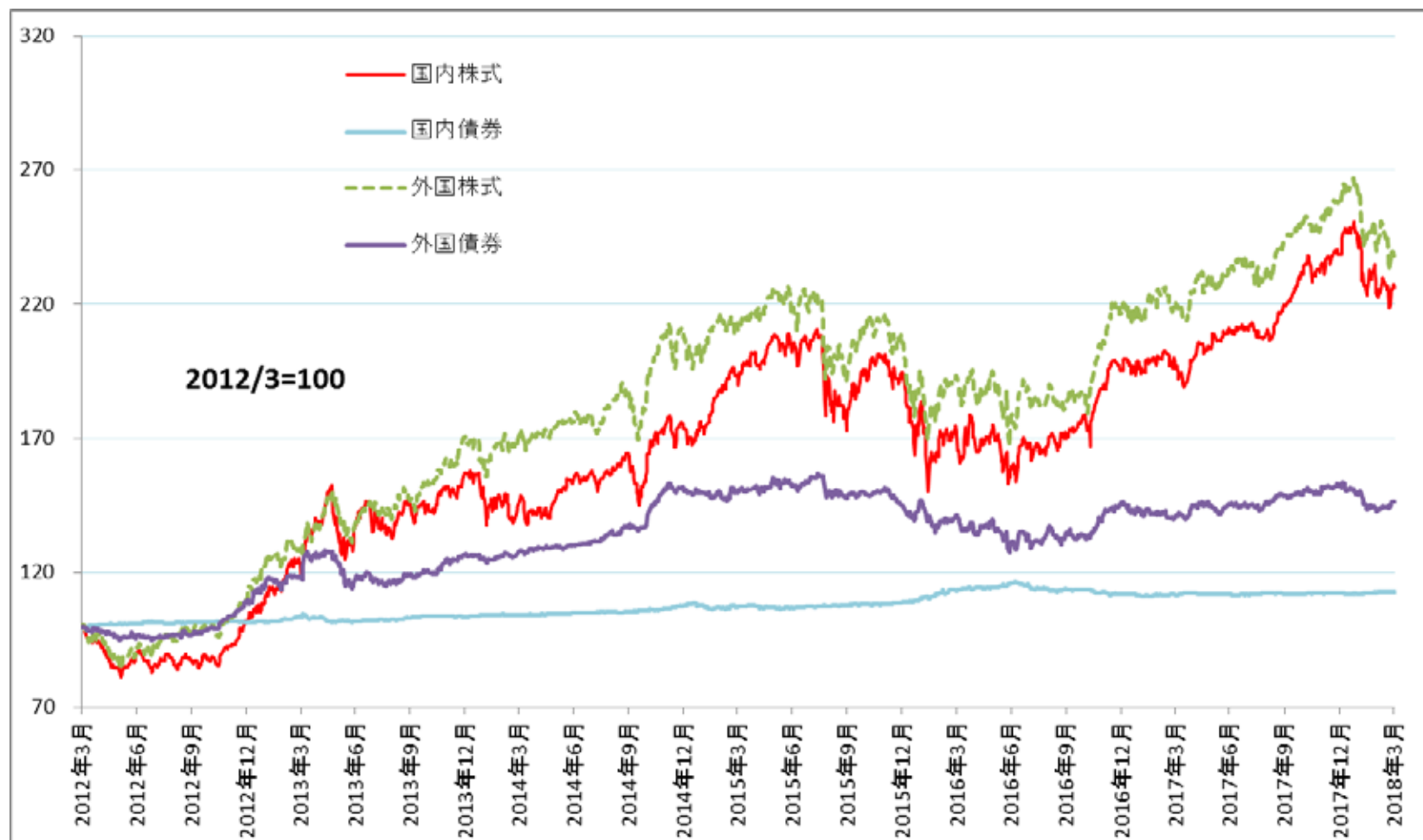
< 償還 >

2017年 9月	地方債	埼玉県19年度第4回公募公債	額面50百万円
2018年 2月	地方債	311回大阪府公募公債	額面20百万円

< 購入 >

2017年10月	地方債	静岡県平成28年度第3回公債	額面50百万円
----------	-----	----------------	---------

資産価格の動き 2012/3末 = 100



資産価格の動き 2017/3末 = 100

