

令和2年度における資金運用状況等について

1. 資金運用管理委員会の実施状況

R2.5.11 令和2年度第1回資金運用管理委員会開催

R2.8.31 令和2年度第2回資金運用管理委員会開催

R2.12.3 令和2年度第3回資金運用管理委員会開催

R3.2.17 令和2年度第4回資金運用管理委員会開催

第4回資金運用管理委員会では、令和3年度の資金運用方針を協議し、以下のとおりとしました。この方針に基づき、令和3年度も学外の有識者の意見を取り入れながら、保有通貨の分散及び安定した利息収入の確保を目指します。

<令和3年度 資金運用方針(概要)>

①指定国立大学法人構想における経営力・財務基盤の強化のため、平成30年度より当面の間は、教育研究資金拡大を最優先とし、**安定した利息収入の確保**を主目的とした運用により、機能的なガバナンスによる資源の再配分を実現させる。

②H29.4.1 国立大学法人法改正による「業務上の余裕金」の運用範囲拡大に伴い、**新たに想定される価格変動リスクや為替変動リスク等も考慮**した上で、運用対象商品の検討を行う。

③「業務上の余裕金」の原資には、当面の間寄附金のみを充てるものとし、寄附者による本学への寄附目的等を最大限に尊重するため、リスクの低い商品(外貨建て債券・外貨預金を含む)による運用を行う。

④償還を迎えた商品の再運用については、市場環境を考慮しながら、改めて資金運用管理委員会においてポートフォリオの変更も含めて審議する。

<東京工業大学資金運用管理委員会名簿 > ※令和3年3月31日現在 五十音順、◎は委員長

加藤康之 株式会社お金のデザイン 研究所所長

桑島正治 一般社団法人蔵前工業会 監事 / マネックスグループ株式会社 取締役副会長

永田京子 東京工業大学 工学院 経営工学系 准教授

中山範靖 東京工業大学 財務部 経理課長

林 明夫 東京工業大学 財務部長

◎藤野公之 東京工業大学 理事・副学長(財務担当)・事務局長

2. 運用実績

2-1. 長期(期間1年超)運用実績 (基準日:令和3年3月31日)

<基準日において保有しているもの>

商品種別	金額	平均利回り (※5)	平均残存年数
公共債 ・日本国債 ・関西国際空港株式会社 ・独立行政法人住宅金融支援機構 ・独立行政法人国際協力機構	9億円	1.863% (1.115%~2.079%)	7.19年
外国債券(円建て) ・欧州投資銀行	2億円	1.843% (1.843%~1.843%)	5.80年
外国債券(円建て)(仕組債) ・欧州投資銀行 ・デンマーク地方金融公庫 } (※1) ・フランス国有鉄道 } ・アフリカ開発銀行 } ・L-BANK } (※1)(※2) ・ドイツ復興金融公庫 } ・バークレイズ・バンク・ピーエルシー } ・モルガン・スタンレー・ファイナンス・エルエルシー } (※3) ・シティグループ・グローバル・マーケット・ホールディングス・インク (※4) }	17億円	2.341% (0.100%~3.519%)	16.51年
外貨定期預金(仕組預金)(※2) ・外国銀行	500万米ドル	2.550% (1.715%~3.450%)	4.80年
外国債券 ・米国債	400万米ドル	2.488% (1.821%~3.004%)	4.66年

※1 外国為替相場によって利息額が変動する商品であり、利回りは、令和3年3月31日の為替相場に基づいて計算しています

※2 早期解約条項付きの商品です

※3 指数によって利息額が変動する商品であり、利回りは、令和3年3月31日時点の指数に基づいて計算しています

※4 信託社債として保有している商品です

※5 平均利回りには、償却原価も反映しています

2-2. 短期(期間1年以下)運用実績

商品種別	運用 本数	運用単位	平均利率	平均 運用日数
大口定期預金	35本	2億円～20億円	0.107% (0.070%～0.190%)	162日
合同運用指定金銭信託	6本	5億円	0.052% (0.025%～0.104%)	91日
外貨定期預金	2本	100万米ドル～ 125万米ドル	0.450% (0.450%～0.450%)	91日
外貨定期預金(仕組預金)	1本	125万米ドル	6.520% (6.520%～6.520%)	14日

運用益の全部または一部が令和2年度決算の計上対象となるものを掲載しています