

# 令和3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

R3.5.28 令和3年度第1回資金運用管理委員会開催

R3.8.26 令和3年度第2回資金運用管理委員会開催

R3.12.15 令和3年度第3回資金運用管理委員会開催

R4.2.16 令和3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4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4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4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、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つつ、一部攻めの運用を行うことにより、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寄附金の運用にあたっては、寄附者による本学への寄附目的等を最大限に尊重し、リスクの低い商品(外貨建て債券・外貨預金を含む)による運用を基本とするが、奨学寄附金の一部について、以下の通りの運用を行う。

(1)新たな運用財源として、奨学寄附金の長期運用による利息を再運用

(2)新たな運用方法として、(1)の利息を含め奨学寄附金の一部について元本毀損リスクのある運用

④長期預り金の運用にあたっては、元本毀損リスクが低い安全資産による運用を行う。

⑤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4年3月31日現在 五十音順、◎は委員長

加藤康之 京都先端科学大学 教授

城戸 陽 東京工業大学 財務部 経理課長

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 取締役副会長兼執行役

コインチェック株式会社 取締役

永田京子 東京工業大学 工学院 経営工学系 准教授

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4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 (※4)                | 平均残存年数 |
|--|---------|---------------------------|--------|
| 仕組預金(※1)(※2)<br>・国内銀行  | 1億円     | 0.900%                    | 29.67年 |
| 公共債<br>・日本国債<br>・東京都債<br>・独立行政法人住宅金融支援機構<br>・独立行政法人国際協力機構<br>・独立行政法人都市再生機構<br>・地方公共団体金融機構  | 21億円    | 1.250%<br>(0.724%~2.079%) | 23.25年 |
| 事業債<br>・東京電力パワーグリッド社債<br>・東日本高速道路社債  | 9億円     | 0.513%<br>(0.185%~1.050%) | 10.51年 |
| 外国債券(円建て)<br>・欧州投資銀行   | 2億円     | 1.843%                    | 4.80年  |
| 外国債券(円建て)(仕組債)<br>・欧州投資銀行<br>・デンマーク地方金融公庫 } (※1)<br>・フランス国有鉄道 }<br>・アフリカ開発銀行 }<br>・L-BANK } (※1)(※2)<br>・ドイツ復興金融公庫 }<br>・パークレイズ・バンク・ピーエルシー } (※3)<br>・モルガン・スタンレー・ファイナンス・エルエルシー }<br>・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 }<br>・ゴールドマン・サックス・ファイナンス・コーポ・インターナショナル } | 19億円    | 2.319%<br>(0.000%~3.811%) | 15.91年 |
| 外貨定期預金(仕組預金)(※2)<br>・国内銀行<br>・外国銀行   | 500万米ドル | 2.342%<br>(1.715%~3.450%) | 5.81年  |
| 外国債券<br>・米国債<br>・地方公共団体金融機構  | 500万米ドル | 2.337%<br>(1.733%~3.004%) | 4.70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4年3月31日時点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4年3月31日時点の指数に基づいて計算しています

※4 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<br>本数 | 運用単位     | 平均利率                      | 平均<br>運用日数 |
|------------|----------|----------|---------------------------|------------|
| 大口定期預金     | 40本      | 2億円～20億円 | 0.106%<br>(0.010%～0.190%) | 192日       |
| 合同運用指定金銭信託 | 17本      | 1億円～9億円  | 0.079%<br>(0.028%～0.200%) | 86日        |
| 外貨定期預金     | 1本       | 100万米ドル  | 0.430%                    | 92日        |

運用益の全部または一部が令和3年度決算の計上対象となるものを掲載しています