

令和元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

R1.6.17 令和元年度第1回資金運用管理委員会開催

R1.10.2 令和元年度第2回資金運用管理委員会開催

R1.11.19 令和元年度第3回資金運用管理委員会開催

R2.2.18 令和元年度第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2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、今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2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2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2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
定期預金(仕組預金)(※1)(※2) ・国内銀行	4億円	0.010% (0.010%~0.010%)	25.90年
公共債 ・日本国債 ・大阪府 ・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	11億円	1.777% (1.115%~2.079%)	6.87年
外国債券(円建て) ・欧州投資銀行	2億円	1.843% (1.843%~1.843%)	6.80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 } ・パークレイズ・バンク・ピーエルシー } (※3) ・モルガン・スタンレー・ファイナンス・エルエルシー } ・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 }	17億円	1.342% (-0.217%~2.745%)	17.51年
外貨定期預金(仕組預金)(※2) ・外国銀行	400万米ドル	2.759% (2.010%~3.450%)	4.76年
外国債券 ・米国債	500万米ドル	2.438% (1.821%~3.004%)	4.71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2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2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	運用本数	運用単位	平均利率	平均 運用日数
大口定期預金	35本	1億円～19億円	0.118% (0.065%～0.250%)	155日
合同運用指定金銭信託	5本	5億円	0.052% (0.025%～0.104%)	91日
外貨定期預金	4本	約35万米ドル～ 100万米ドル	2.738% (2.460%～2.900%)	132日

運用益の全部または一部が令和元年度決算の計上対象となるものを掲載しています