

2021年度インターネット基盤整備基金資産運用状況の報告

資産運用規程に基づき、下記の通り、インターネット基盤整備基金資産の2021年度の運用状況報告を行う。

(1) 運用実績 (単位百万円、数値毎に小数点以下第2位・万円の位を四捨五入)

	2020年度実績	2021年度予算	2021年度実績	備考
運用収入(a)	17.8	17.1	20.1	円安により外貨建債券からの収入増
償還損益(b)	△3.6	0	0	為替要因 +35.0百万円
評価損益(c)	53.5	0	6.3	価格要因 ▲28.7百万円
トータル収支(d)	67.5	17.1	26.3	
期首残高(e)	1,193.9	1,243.8	1,243.8	
期末残高(f)	1,243.8	1,243.8	1,250.1	

(d)=(a)+(b)+(c) , (f)=(e)+(b)+(c)

(2) 償還損益・評価損益の内容

① 為替要因 +35.0百万円

～¥/US\$レート 2021/3末@110.71→2022/3末@122.39、@11.68円の円安

② 価格要因 ▲28.7百万円

・金利要因；日米での金利上昇(米国債10年の金利は過去1年間で0.8%上昇、日本国債10年の金利は過去1年間で0.1%上昇)により債券価格が低下した

・信用リスク要因；2021/3末はコロナ禍からの経済の回復を先取りして債券価格が大きく上昇していたものが、ロシア-ウクライナ問題等による不透明感で債券の価格調整が行われた

⇒保有債券の価格は額面100に対して96.1～102.3(加重平均価格100.2)と、ほぼ償還予定金額と同水準となっている。

(3) 資産内訳(単位百万円、数値毎に小数点以下第2位・万円の位を四捨五入/各年度決算値、期末評価後)

		2021年3月		2022年3月	
		残高	%	残高	%
債券	外貨建	355.4	28.6	366.3	29.3
	円建	503.8	40.5	599.2	47.9
現金預金		384.6	30.9	284.6	22.8
資産計		1,243.8	100.0	1,250.1	100.0

2022/3末債券残高966百万円については、各銘柄の、リスク・パーティーの格付は全て運用規程の基準を充足しており、保有債券の信用リスクに現時点では著変無し。

以上