

平成27年度 外国為替資金特別会計の外貨建資産の内訳及び運用収入の内訳等

1. 外貨建資産の内訳

(単位:百万円)

	平成27年度末	対前年度末比増減額
円 貨 貸 付 金	805,726	△ 300,442
外 貨 預 け 金	13,804,111	6,997,506
当 座 預 け 金	11,813,379	5,912,016
定 期 預 け 金	1,990,732	1,085,489
外 貨 貸 付 金	6,838,016	914,569
金 地 金	144,718	△ 20,371
外 貨 証 券	120,940,784	△ 7,763,893
特 別 引 出 権 証 券	6,741	2,846
特 別 引 出 権	1,954,098	△ 201,221
合 計	144,494,198	△ 371,005

(注) 時価ベース。円建て換算は、特別会計に関する法律第79条の規定に基づき、年度末の基準外国為替相場等(1ドル=118円等)により行っている。

(参考1) 外貨証券の満期別構成割合

(単位:百万円)

満期	平成27年度末残高	対前年度末比増減額 (シェア変化)
1年以下	21,549,480 (17.8%)	△ 2,020,799 (△ 0.5%)
1年超5年以下	60,790,593 (50.3%)	△ 9,895,947 (△ 4.7%)
5年超	38,600,710 (31.9%)	4,152,853 (5.2%)
合計	120,940,784 (100%)	△ 7,763,893 (-)

(参考2) 外貨証券の国債・非国債の構成割合

(単位:百万円)

銘柄	平成27年度末残高	対前年度末比増減額 (シェア変化)
国債	94,098,114 (77.8%)	△ 8,491,482 (△ 1.9%)
国債以外の証券	26,842,670 (22.2%)	727,589 (1.9%)
合計	120,940,784 (100%)	△ 7,763,893 (-)

(参考3) 外貨建資産の運用に係る外部委託

外貨建資産の運用に係る外部委託は、「外国為替資金特別会計が保有する外貨資産に関する運用について」(平成17年4月4日報道発表)の「外為特会保有外貨資産は安全性及び流動性に最大限留意した運用を行うこととし、この制約の範囲内で可能な限り収益性を追求するものとする」との基本原則に基づいて行っている。民間の資産運用機関が行う取引やリスク管理に関する知見を活用して外貨建資産の運用効率の向上を図っている。平成27年度末の金額は422,801百万円である。これに係る平成27年度の支払手数料の金額は469百万円である。

(参考4) 有価証券保管契約

平成27年度末の有価証券保管契約の金額は120,496,597百万円である。これに係る平成27年度の支払手数料の金額は1,408百万円である。

2. 外貨建運用収入の内訳

(単位:百万円)

	平成27年度	対前年度比増減額
外 貨 預 け 金 利 子	3,286	1,995
当座預け金利子	0	△ 2
定期預け金利子	3,285	1,998
外 貨 証 券 運 用 益	2,438,743	140,792
外貨証券利子	2,362,492	118,150
外貨証券償還益	50,480	12,132
外貨証券貸出収入	25,770	10,508
そ の 他 外 貨 建 収 入	27,455	7,231
合 計	2,469,485	150,019
(参考)償還差額補填金	41,714	△ 12,117

3. 外貨定期預け金及び外貨証券に係る運用資産利回り

(単位:百万円)

	平成27年度	対前年度比増減額
運 用 収 入 (注1)	2,400,314	154,908
運 用 資 産 平 残 (注2)	122,082,385	853,474
運 用 資 産 利 回 り (注3)	1.96%	0.11%

- (注1) 運用収入には、外貨預け金利子のうちの定期預け金利子及び外貨証券運用益の当該年度における合計額から償還差額補填金の金額を控除した金額を掲記している。
- (注2) 運用資産平残には、外貨預け金のうちの定期預け金及び外貨証券の合計の当年度末残高と前年度末残高の平均の金額(簿価ベース)を掲記している。
- (注3) 運用資産利回りには、当年度における運用収入を当年度における運用資産平残で除した数値を掲記している。

連絡・問合せ
財務省国際局為替市場課
資金管理室特別会計係
Tel 03(3581)4111 内線2844