

外郭団体が保有する仕組債について

1 趣旨

公益財団法人横浜市国際交流協会の23年度決算における仕組債の保有状況についてご報告いたします。

2 団体の仕組債の保有状況

<公益財団法人横浜市国際交流協会>

発行体等	格付※	購入年月日	期間	貸借対照表価額 (千円)		当初金利	利率変動 要因	備考
	H24.3			H23.3末	H24.3末			
ルウェー輸 出金融 公社	BB+	H14.11.14	20年	100,000	100,000	3% (1年)	円/米ド ル為替 連動	
ルウェー輸 出金融 公社	BB+	H15.8.27	20年	100,000	100,000	3% (1年)	円/米ド ル為替 連動	H24.8.28 早期償還済
フィンランド 地方金 融公社	AAA	H20.1.22	30年	100,000	100,000	5% (1年)	円/豪ド ル為替 連動	
小 計				300,000	300,000	※H24.8末 200,000千円		
【参考値】時価 (千円)				254,824	202,294			

※格付けはすべてスタンダード&プアーズを記載

3 今後の対応

(1) 団体の対応

- ・今後も、発行体の決算状況等を注視するとともに、定期的に資産運用委員会を開催するなどして、運用について継続的に検討を行います。

(2) 財産運用規程等の見直し

- ・仕組債等の購入禁止規定を追加しました。
- ・運用対象の条件を「A」以上とし、格付を明記しました。