

平成23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23年度末	対前年度末比増減額
円 貨 貸 付 金	956,882	40,316
外 貨 預 け 金	1,255,022	274,500
当 座 預 け 金	96,919	△ 382,110
定 期 預 け 金	1,158,103	656,610
外 貨 貸 付 金	1,445,999	△ 48,000
金 地 金	142,528	16,686
外 貨 証 券	86,416,816	6,993,823
特 別 引 出 権	1,651,554	△ 85,713
合 計	91,868,804	7,191,612

(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=77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23年度末残高	対前年度末比増減額 (シェア変化)
1年以下	11,133,920 (12.9%)	2,367,829 (1.9%)
1年超5年以下	50,841,433 (58.8%)	3,444,227 (△ 0.9%)
5年超	24,441,463 (28.3%)	1,181,766 (△ 1.0%)
合計	86,416,816 (100%)	6,993,823 (－)

(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23年度末残高	対前年度末比増減額 (シェア変化)
国債	64,433,913 (74.6%)	9,724,503 (5.7%)
国債以外の証券	21,982,903 (25.4%)	△ 2,730,679 (△ 5.7%)
合計	86,416,816 (100%)	6,993,823 (－)

2. 外貨建運用収入の内訳

(単位:百万円)

	平成23年度	対前年度比増減額
外 貨 預 け 金 利 子	3,480	△ 1,212
当座預け金利息	178	32
定期預け金利息	3,302	△ 1,245
外 貨 証 券 運 用 益	2,162,897	△ 340,832
外貨証券利息	2,149,402	△ 322,912
外貨証券償還益	11,168	△ 18,011
外貨証券貸出収入	2,326	91
そ の 他 外 貨 建 収 入	16,389	2,386
合 計	2,182,767	△ 339,658
(参考) 償還差額補填金	15,886	6,456

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23年度	対前年度比増減額
運 用 収 入 (注1)	2,150,312	△ 348,535
運 用 資 産 平 残 (注2)	80,772,981	1,011,813
運 用 資 産 利 回 り (注3)	2.66%	△ 0.47%

(注1) 運用収入には、外貨預け金利息のうちの定期預け金利息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2847