

2020年度の資金運用結果について

2020年度の世界経済は、新型コロナウイルス感染症の感染拡大により歴史的な落込みを経験し、経済活動の立直しを図るため、世界各国で大規模な金融緩和や財政出動がなされ、日本をはじめ主要国の金利は低下しました。

このような投資環境において、本学では「2020年度資金運用方針」に基づく資金運用に臨み、2020年度の有価証券の運用収益は3.6億円（利回りは0.8%）となりました。

以下に2020年度の運用結果についてご報告いたします。

1 国内債券

国内債券については、将来の金利上昇を考慮しつつ、中期ゾーン（期間3～5年）でラダー型ポートフォリオ^(注1)を構築する購入を計画していましたが、大規模な金融緩和により事業債の利回りが一段と低下するなか購入を見合わせ、一部、利回り確保の観点から長期債を購入するにとどめました。

国内債券による運用収益は1.9億円（利回り0.7%）となりました。

2 外国債券

外国債券については、将来の為替動向を考慮しつつ、長期ゾーン（期間8～10年）でのラダー型ポートフォリオを構築する購入を計画していましたが、米ドル長期金利が低位で推移するなか為替耐性も勘案し購入を見合わせました。

外国債券による運用収益は0.4億円（利回り0.8%）となりました。

3 国内株式

国内株式については、「関西大学発新事業創出支援基金」（特定資産）^(注2)への拠出原資を確保することを目的として委託運用によるESG投資^(注3)を行い、当該運用から受け取る配当金を用いて次代を担うベンチャー・シーズの事業化を支援する枠組みを構築しています。

国内株式による運用収益は1.0億円（利回り4.6%）となりました。

4 その他

仕組債等による運用収益は0.3億円（利回り0.4%）となりました。

^(注1) 各償還年限の割合が均等となる銘柄から構成されるポートフォリオ

^(注2) 学生や研究者が育んだベンチャー・シーズの事業化支援を目的に設立

^(注3) 環境（Environment）、社会（Social）、企業統治（Governance）に取り組む企業を重視・選別する投資手法