

第60回資産運用委員会議事要旨

1. 日時：平成28年9月15日（木） 15：00～17：00
2. 場所：KKRホテル東京
3. 参加者：米澤委員長代理、臼杵委員、山崎委員
4. 議事要旨

- (1) 運用リスク管理の状況について（平成28年度第1四半期）

本四半期に影響の大きかった為替変動について、内外株式等の運用資産の相関への影響等をふまえたリスク管理、ポートフォリオ管理のあり方について議論が行われた。また、市場の流動性リスク管理の観点から、ポートフォリオ調整に係るコストの把握等についても議論が行われた。

- (2) 平成28年度第2四半期運用状況について

基本ポートフォリオを踏まえた資産移動の状況等について、議論が行われた。

以 上