

## 第72回資産運用委員会議事要旨

1. 日時：平成30年10月26日（金）10：00～12：00
2. 場所：九段合同庁舎9F 共用第一会議室
3. 参加者：神野委員長、臼杵委員長代理、小幡委員、菅原委員
4. 議事要旨
  - (1) 平成30年度第2四半期の運用状況及び運用リスク管理の状況について
    - ・外債ベンチマーク構成銘柄が変更になる場合の対応、外債パッシブ運用でのTEなどについて、質疑があった。
    - ・BarraOne計測データ(標準偏差と相関係数)の時系列推移における見方などについて、質疑があった。
  - (2) 乖離許容幅およびリバランスについて

厚年積立金のリバランスのあり方等について議論が行われ、引き続き議論していくこととなった。

以 上