

第90回資産運用委員会 議事要旨

1. 日時：令和3年11月1日（月）14：00～16：15
2. 場所：KKRホテル東京 11F 丹頂
3. 参加者：神野委員長、臼杵委員長代理、小野委員、小幡委員、白須委員、
玉木委員、山崎委員

4. 議事要旨

(1) 令和3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

事務局から、厚生年金保険給付積立金、退職等年金給付積立金、経過的長期給付積立金の令和3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説明があり、それぞれの積立金の管理運用の方針に則り運用が行われたこと、適切なリスク管理が行われたことが確認された。

(2) 外国債券 政策ベンチマーク（WGBI）中国国債組入れへの対応について

事務局から、外国債券 政策ベンチマーク（WGBI）中国国債組入れへの対応について説明があった。

委員からは様々な意見等があったが、中国国債の市場動向、特に様々な政治的・経済的リスクの動向について不断のモニタリングを実施するとともに、一元化された厚生年金の管理運用主体として適切な説明責任を果たしていくよう十分留意のうえ対応されたいと取りまとめられた。

(3) 政策ベンチマークの在り方について

事務局から、外国株式 政策ベンチマークの在り方について説明があり、事務局案を踏まえて対応されたいと取りまとめられた。

(4) オルタナティブ投資の進め方について

事務局から、オルタナティブ投資の進め方について説明があった。

委員からは様々な意見等があったが、委託コストの水準にも十分に留意して流動性プレミアム見込みの妥当性を的確に判断し、オルタナティブ資産に特有のリスク・リターンをモニタリングを着実に実施することとしたうえで対応されたいと取りまとめられた。

以 上