

## 第77回資産運用委員会議事要旨

1. 日時：令和元年7月26日（金）15：00～16：00
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、小野委員、小幡委員、菅原委員、  
玉木委員、山崎委員
4. 議事要旨

令和元年度第1四半期の運用状況及び運用リスク管理の状況

・リスク管理全般及びリスク管理の各論（アクティブシェア、インプライドボラティリティ、足元のBarraOne計測ベースでの標準偏差と相関関係の解釈、流動性リスクの考え等）について、質疑があった。

・日銀による金融政策下においての、国内債券投資の在り方等について質疑があった。

以 上