

【議事】

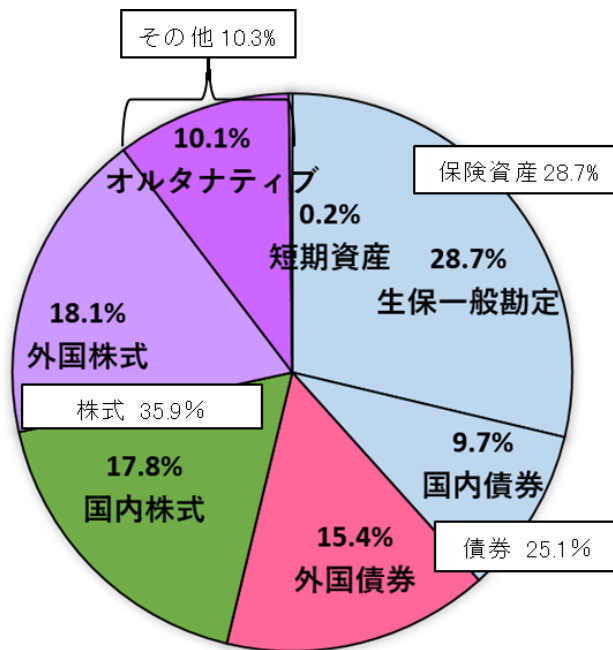
1. 企業年金基金設立の報告
2. 運用状況の報告

企業年金基金設立に伴う資産の移受管や移行時の資産残高について、運用執行理事より報告を行いました。

また、平成 30 年 9 月 12 日開催の第 2 回理事会に先立ち、厚生年金基金の平成 29 年度の運用状況及び、個別のファンドの定性・定量評価についての報告を行うとともに一部のファンドの商品性改善案について活発な議論を行いました。

【参考】

各資産の資産構成割合（平成 30 年 7 月 1 日：企業年金基金設立時）



直近の運用利回り推移(平成 30 年度)

平成30年度 年金資産運用推移	H30/3	H30/4	H30/5	H30/6	H30/7	H30/8	H30/9	H30/10	H30/11	H30/12	H31/1	H31/2	H31/3
複合ベンチマーク(月次)	-	1.62%	-0.57%	0.62%	1.21%								
月次運用実績	-	1.40%	-0.28%	0.33%	1.47%								
累積運用実績	-	1.40%	1.05%	1.38%	2.89%								
資産残高(百万円)	246,000	247,033	247,397	245,998	249,609								

：制度移行に伴う現物移受管(厚生年金基金→企業年金基金)により参考値となること

複合ベンチマーク：複数資産に投資を行うポートフォリオ全体の運用成果の基本的な評価基準となる収益率です。資産構成割合にそれぞれの資産のベンチマーク収益率を加重平均して求めます。一般的に、ポートフォリオ全体のベンチマークとして使用されています。