

【議事】

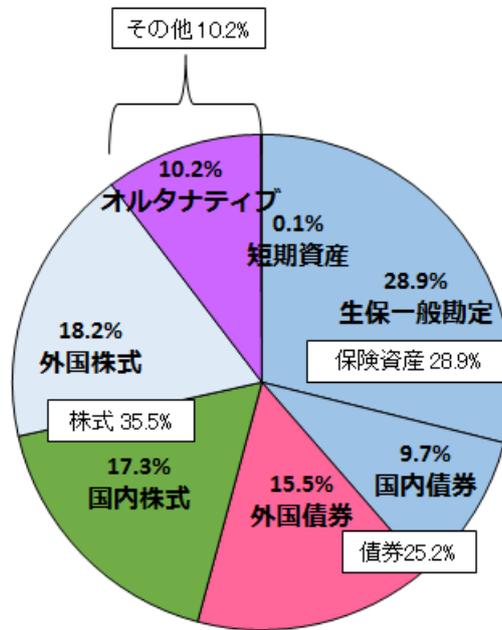
1. 年金資産運用の状況について
2. 各ファンドの定性・定量評価について
3. その他

平成 30 年 10 月末現在の運用状況や資産残高について、事務局より報告を行いました。

また、運用機関へのヒアリングを基にコンサルタントが作成した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、年金 ALM 等の中期計画について検討を行いました。

【参考】

各資産の資産構成割合（平成 30 年 10 月 31 日現在）



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%	-0.29%	1.80%	-3.36%					
月次運用実績	-	1.40%	-0.28%	0.33%	1.47%	-0.29%	1.57%	-3.39%					
累積運用実績	-	1.40%	1.05%	1.38%	2.89%	2.59%	4.20%	0.67%					
資産残高 (百万円)	246,000	247,033	247,397	245,998	249,609	246,490	251,356	242,116					

：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。