

平成25年度第2回資産運用評価委員会 議事要旨

1. 日時 平成25年7月4日(木) 13:30~14:10
2. 場所 ニッセイ池袋ビル 19階役員会議室
3. 出席者 奥村委員、村山委員、吉國委員、米澤委員、(小粥委員欠席)

4. 議事要旨

(1) 運用目標等の部分に関する評価報告書(案)について

事務局で用意した「運用の目標等の部分に関する評価報告書(案)」について説明があり、それについて審議がされた。

[主な意見等]

- 中退共について、基本ポートフォリオ管理の結果、資産構成の割合が乖離許容幅内に収まっていながらも年度末において、基準に則りリバランスを実施したのであれば、それを記載すべきとの意見があった。
- 清退共給付経理について、国内株式の時間加重収益率がベンチマークを大幅に下回った理由を記載したほうが良いとの意見があった。また、評価について、課題があることを指摘した方が良いとの意見があった。
- 清退共特別給付経理の評価を今回から記載しないことについて、市場運用をしている金銭信託を行っていないので妥当であるとして、了承を得られた。
- 基本方針の遵守状況について、定量的な指標が定められた基本方針の事項だけでなく、その他の事項についても適切に行われていることを確認して評価したとの報告書にすべきとの意見があった。
- これらの指摘を踏まえて、事務局で評価報告書を修文することとし、その内容の確認については、委員長に一任された。

(2) 今後の予定について

- 本日のご指摘を踏まえて、事務局で評価書を修文し、委員長に確認いただいた後に「運用の目標等の部分に関する評価報告書」については昨年と同様に独法評価委員会への補足説明資料としたい旨の報告があった。

○個別具体的な評価のための第3回委員会は9月を予定。改めて日程調整することとされた。

以上