

第19回地方公務員共済資金運用委員会議事要旨

1. 日 時：平成30年2月23日（金） 10:00～10:30
2. 場 所：地方公務員共済組合連合会 特別会議室
3. 出席した委員：
 - ・若杉座長 ・井手委員 ・川北委員 ・喜多委員 ・高山委員
 - ・竹原委員 ・徳島委員 ・蜂須賀委員 ・森本委員
4. 議 事
 - (1) 平成29年度第3四半期の各積立金の運用状況
 - (2) 平成29年度第3四半期の各積立金のリスク管理状況
 - (3) 平成27年度各積立金の管理及び運用に関する業務概況書の訂正

〈議事の概要〉

- ・事務局から上記議題について資料の説明が行われた。
- ・その後、意見交換が行われた。

(2) 平成29年度第3四半期の各積立金のリスク管理状況

- トラッキングエラー、バリュー・アット・リスクの推定に際しては、リスク計測方法という意味で異なる方法の併用や潜在的な資産価格下落リスクを織り込むような方法を中期的な課題として検討すべきではないか。
- 今後、金利が上昇局面にきたときに今の状況の中でどういう影響を受けるのかというシミュレーションについて、検討をしても良いのではないか。
- 例えば1%とか金利が動いたときのセンシティブティや過去の大きな金利変動とかマーケットの変動があったときのシナリオでどれぐらいの損失が発生するポートフォリオなのかといった情報があると良いのではないか。

以上