

第 70 回経営委員会議事概要

1. 日 時 : 2022 年 6 月 27 日 (月) 15:00~15:50
2. 場 所 : 年金積立金管理運用独立行政法人 会議室
3. 出席委員等 : ・山口委員長 ・新井委員長代理 ・内田委員 ・逢見委員 ・尾崎委員
・加藤委員 ・小宮山委員 ・根本委員 ・堀江委員
・宮園理事長

※加藤委員及び根本委員は Web 会議システムにより出席

4. 議事概要

【議決事項】

(1) 「2021 年度業務概況書 (案)」

(2) 「保有全銘柄開示 (2021 年度末時点)」

議決事項 1 及び 2 については、関連する事項であることから、まとめて説明し議決をとることで了承を得た。

2021 年度業務概況書 (案) 及び保有全銘柄開示 (2021 年度末時点) について、議決を行い、出席した 10 名の全委員の賛成により承認された。

質疑等の概要は以下のとおりである。

委員 A 株式指数先物取引に関する、社会保障審議会年金部会・資金運用部会におけるこれまでの説明では、インハウスの建玉を運用受託機関に移し、同機関において決済することなどが説明されていなかったもので、今後きちんとした説明をする必要がある。

理 事 独法評価の際に開催される資金運用部会で丁寧に説明したい。

(3) 「令和 3 年度業務実績評価について (案)」

独立行政法人通則法 (平成 11 年法律第 103 号) 第 32 条第 1 項第 1 号及び第 2 項の規定に基づき、令和 3 年度業務実績評価書を作成し、厚生労働大臣へ提出することについて、議決を行い、出席した 10 名の全委員の賛成により承認された。

質疑等はなかった。

【議決事項】

(4) 「令和 3 事業年度財務諸表並びに事業報告書及び決算報告書の作成、利益及び損失の処理その他会計に関する重要事項について (案)」

【報告事項】

(1) 「2021 年度監査委員会監査報告」

報告事項 1 については、議決事項 4 と関連する内容であるため、議決に先立ち、管理運用法人の業務は、法令等に従って適正に実施され、また、中期目標及び中期計画の達成に向け効果的かつ効率的に実施されていること等について、委員から報告があった。

令和 3 事業年度財務諸表、令和 3 事業年度事業報告書、令和 3 事業年度決算報告書、令和 3 事業年度利益の処分の 4 つの事項については、関連する事項であることから、まとめて説明し議決をとることです承を得た。

令和 3 事業年度財務諸表並びに事業報告書及び決算報告書の作成、利益及び損失の処理その他会計に関する重要事項（案）について、議決を行い、出席した 10 名の全委員の賛成により承認された。

質疑等はなかった。

【報告事項】

(2) 「2022 年度監査委員会監査報告」

2022 年度監査委員会監査計画について、委員から報告があった。

質疑等はなかった。

(3) 「2021 年度調査研究実績評価」

2021 年度調査研究実績評価について、執行部から以下の報告があった。

- ・ 2021 年度の調査研究テーマのうち、完了に至ったものは、「世界的な低金利環境を発生・定着させているメカニズム」、「ポストコロナ社会における企業価値の探索に関する研究」、「ESG 投資の分散投資効果とポートフォリオ効率性」の 3 件であり、いずれのテーマも実施において特段問題は生じず、事後評価の対象である「ESG 投資の分散投資効果とポートフォリオ効率性」については、いずれの項目においても「期待通り」の成果が得られた。
- ・ 第 4 期中期計画において調査研究業務における「PDCA サイクルの取組の強化」が盛り込まれたことを踏まえ、テーマ選定時に事前の目標（実務への応用方法、成果想定）を設定すると共に、事後にその達成度合いの評価を実施し、その結果をその後の調査研究業務に活かす PDCA サイクルを実践する。

質疑等はなかった。

(4) 「足元の運用リスク管理状況及び業務執行状況について」

足元の運用リスク管理状況及び業務執行状況について、理事長及び理事から報告があった。

以上