

厚生年金基金等の資産運用・財政運営に関する有識者会議 開催要綱

1. 趣旨

厚生年金基金等の企業年金の資産運用は、平成 9 年の 5:3:3:2 規制の撤廃後、各基金が自己責任の下で自主的に運用を行うことを基本原則とし、厚生労働省では受託者責任に係るガイドラインを示してきた。しかし、その後、資産運用の手法は多様化・複雑化し、また、金融市場の変動幅も大きくなってきている。

一方、平成 9 年には厚生年金基金の財政運営についても、予定利率設定の弾力化、非継続基準による財政検証の導入、資産評価の簿価から時価への変更などの見直しが行われた。しかし、その後の経済金融情勢の悪化により、厚生年金基金等の企業年金は厳しい財政状況が続いており、特に、厚生年金基金については、厚生年金の代行部分に必要な積立金を持たない「代行割れ基金」が全体の 4 割を占めている。

こうした状況を踏まえ、厚生年金基金等の企業年金について、資産運用規制と財政運営の両面からこれまでの施策を検証し、今後の在り方について幅広い観点から議論を行うため、「厚生年金基金等の資産運用・財政運営に関する有識者会議」（以下「有識者会議」という。）を開催する。

2. 検討事項

- ①厚生年金基金等の企業年金の資産運用・受託者責任の在り方
- ②厚生年金基金等の企業年金の財政運営の在り方
- ③その他

3. 構成員

別紙のとおり

4. 今後の進め方

第 1 回は 4 月 13 日（金）：17 時 30 分～19 時 30 分 於 厚生労働省専用第 15・16 会議室
6 月を目途に一定の報告を取りまとめる。

5. 運営

- (1) 有識者会議は、厚生労働大臣の下、開催する。
- (2) 有識者会議の庶務は年金局企業年金国民年金基金課において行う。

(別紙)

(敬称略・五十音順)

臼杵	政治	名古屋市立大学経済学研究科教授
翁	百合	日本総合研究所理事
小野	正昭	みずほ年金研究所研究理事
鹿毛	雄二	前・企業年金連合会常務理事
蟹江	宣雄	トヨタ自動車企業年金基金常務理事・運用執行理事
近藤	憲二	住友化学株式会社経理室(財務)部長
玉木	伸介	大妻女子大学短期大学部教授
永山	善二	東京乗用旅客自動車厚生年金基金常務理事・運用執行理事
花井	圭子	日本労働組合総連合会総合政策局長
濱口	大輔	企業年金連合会常務理事・運用執行理事
森戸	英幸	慶応義塾大学大学院法務研究科教授
山口	修	横浜国立大学経営学部教授・附属図書館長
山本	御稔	監査法人トーマツパートナー