

確定給付型企业年金の制度運営に関するアンケート

1. 貴社もしくは貴基金の年金制度についておたずねします。

(1) 企業年金の制度形態は、次のいずれでしょうか(複数の制度をおもちの場合は、代表的な制度についてお答え下さい)。

厚生年金基金

確定給付企業年金(基金型)

確定給付企業年金(規約型)

(2) 企業年金の資産規模についてお知らせ下さい。

5億円未満

5億円以上10億円未満

10億円以上50億円未満

50億円以上100億円未満

100億円以上500億円未満

500億円以上1000億円未満

1000億円以上

(3) 企業年金の人数規模についてお知らせ下さい(人数は、加入者、待期者、受給者の合計として下さい)。

300人未満

300人以上500人未満

500人以上1000人未満

1000人以上5000人未満

5000人以上10000人未満

10000人以上

2. 企業年金の制度運営に従事する方についておたずねします。

(1) 企業年金の制度運営に従事する方の人数をお知らせ下さい。

専任ご担当者()名

(他業務と)兼務のご担当者()名

(2) 上記(1)のご担当者の中に、証券アナリストの資格をお持ちの方はおられますか。

現在はいないし、今後、資格取得予定の担当者もいない。

現在はいないが、今後、資格取得予定の担当者がいる。

すでに資格取得者がいる。

- (3) 上記(1)のご担当者について、証券アナリスト等の企業年金運営に役立つと思われる資格取得を勧奨しておられるでしょうか。

特に勧奨していない。

勧奨しているが、資格を取得しても人事・給与面には反映されない。

勧奨しているとともに、資格取得後は人事・給与面に反映している。

- (4) 資産運用面を含め、年金制度運営業務のサポート役として、運用コンサルタントは導入されていますか。

現在は導入していないし、今後も導入予定はない。

現在は導入していないが、今後導入を検討する。

すでに導入している、もしくは、導入予定である。

3. 資産運用の状況についておたずねします。

- (1) いわゆるオルタナティブ投資(国内債券、国内株式、外国債券、外国株式、短期資産、生保一般勘定といった伝統的運用資産以外を対象とする投資)を行っていますか。

現在行ってないし、今後行う予定もない。

現在は行ってないが、今後検討する予定である。

すでに行っている、ないし、今後投資予定である。

- (2) 上記(1)で とお答えになった場合、その割合をお知らせ下さい。

5%未満

5%以上10%未満

10%以上20%未満

20%以上30%未満

30%以上

- (3) 上記(1)で とお答えになった場合、その商品をお知らせ下さい(複数回答可)。

ファンド・オブ・(ヘッジ・)ファンズ

マーケット・ニュートラル

マネージド・フューチャーズ

グローバル・マクロ

株式ロング・ショート

プライベート・エクイティ

C T A

不動産関連商品
その他

4. 運用受託機関の選定についておたずねします。

(1) 現在の運用受託機関の数についてお知らせ下さい。

信託銀行()社

生命保険会社()社

投資顧問会社()社

(2) 運用受託機関の数についての、今後の方向性をお知らせ下さい。

今後、運用受託機関の数を増やす予定である。

今後、運用受託機関の数を減らす予定である。

当面、運用受託機関の数を変更する予定はない。

(3) 運用受託機関の選定は、どのように行っていますか。

基本的には、ペーパーベースで定量面、定性面を評価して判断している。

基本的にはペーパーベースで判断しているが、リスク、リターン、相関係数などの基本数値は、自ら計算してチェックしている。

運用受託機関にプレゼンテーションをさせた上で、最終判断を行っている。

運用受託機関に直接訪問の上、最終判断を行っている。

5. 厚生労働省から(各地方厚生局長宛)発出されている、厚生年金基金あるいは確定給付企業年金の「資産運用関係者の役割及び責任に関するガイドライン」(以下、「ガイドライン」)についておたずねします。

(1) このガイドラインを、どのように認識されているでしょうか。

ガイドラインの存在を知らない。

ガイドラインの存在は知っているが、見たことはない。

ガイドラインの主要なポイントのみ、確認したことがある。

ガイドラインの主要なポイントだけでなく、全体を把握している。

ガイドライン全体を把握し、実務と照らし合わせて遵守状況をチェックしている。

(2) 今回のA I J問題を受けて、ガイドラインの再確認は行いましたか。

特に再確認は行っていない。

主要なポイントのみ再確認した、ないし、再確認する予定である。

ガイドライン全般にわたり再確認した、ないし、再確認する予定である。

6. 「運用の基本方針」の作成状況についておたずねします。

(1) 運用の基本方針をどのように作成していますか。

作成していない。

作成しているが、ほぼ幹事会社のひな型通りである。

幹事会社のひな型をベースに、独自の留意事項を織り込んでいる。

(2) 運用の基本方針の見直し状況はいかがでしょうか。

作成以来、見直したことはない。

政策アセットミックスに変更があれば、見直している。

定期的に内容をチェックするとともに、必要に応じて見直している。

(3) 今回のA I J問題を受けて、運用の基本方針の再確認は行いましたか。

特に再確認は行っていない。

政策アセットミックスのみ再確認した、ないし、再確認する予定である。

運用の基本方針全般にわたり再確認した、ないし、再確認する予定である。

7. 「政策アセットミックス」(ガイドライン上の「政策的資産構成割合」)についておたずねします。

(1) 政策アセットミックスをどのように作成・活用していますか。

作成していない。

作成しているが、実際の運用では特に意識していない。

政策アセットミックスを念頭において運用し、定期的に政策アセットミックスに沿った運用となっているか確認している。

(2) 加入者に対して、政策アセットミックスをどのようにディスクロージングしていますか。

現在、ディスクロージングしていないし、今後もディスクロージングする予定はない。

現在はディスクロージングしていないが、今後はディスクロージングする予定である。

現在、ディスクロージングしている。

(3) 加入者に対して、政策アセットミックスの設定理由(どのような根拠で、政策アセットミックスを決定したか)をディスクロージングしていますか。

現在、ディスクロージングしていないし、今後もディスクロージングする予定はない。

現在はディスクロージングしていないが、今後はディスクロージングする予定である。

現在、ディスクロージングしている。

8. 年金ALMについておたずねします。

(1) 年金ALMの実施状況をお知らせ下さい。

これまで実施したことはないし、今後も予定はない。

これまで実施したことはないが、今後実施を検討する。

これまでに少なくとも1回は実施したことがある。

これまでに実施したことがあり、今後も定期的実施する。

9. 企業年金のリスク管理についておたずねします。

(1) 下記のリスク管理手法のうち、すでに導入されているものをお知らせ下さい(複数回答可)。

- (バリュー・アット・リスクなどの) リスクの計測
- 下値をヘッジするような、運用商品の採用
- 相場急変時の対応(資産運用委員会の招集等)の事前準備
- オルタナティブ等、運用商品によるリスク分散の推進
- 為替オーバーレイのような、資産横断的なリスク管理商品の活用

10. 資産運用委員会の設置状況についておたずねします(年金委員会等、類似のネーミングの委員会も含めてお答え下さい)。

- (1) 資産運用委員会の設置状況をお知らせ下さい。
- 現在設置していないし、今後も設置する予定はない。
 - 現在は設置していないが、今後設置を検討する。
 - 現在設置している、ないし、今後設置予定である。
- (2) 資産運用委員会に従業員の代表者は参加されていますか。
- 現在参加していないし、今後も参加する予定はない。
 - 現在は参加していないが、今後参加を検討する。
 - 現在参加している、ないし、今後参加予定である。
- (3) 資産運用委員会に運用コンサルタント等の外部専門家は参加されていますか。
- 現在参加していないし、今後も参加する予定はない。
 - 現在は参加していないが、今後参加を検討する。
 - 現在参加している、ないし、今後参加予定である。

企業年金の制度運営に関し、日頃感じておられることがありましたらご記入下さい。
(制度設計面、資産運用面に限らず、ご自由にご記入下さい。)

ご協力ありがとうございました。