

# 2023年度 第2四半期（上半期） 団体年金保険に関するご報告 （一般勘定）

～確定給付企業年金保険・厚生年金基金保険（Ⅱ）・新企業年金保険（Ⅱ）～

一生涯のパートナー

**第一生命**



Dai-ichi Life Group

## I. ご報告のポイント

- 2023年度第2四半期(上半期) 経営に関するご報告～ポイント～…………… 1
- 2023年度第2四半期(上半期) 団体年金に関するご報告～ポイント～ …… 3
- 団体年金保険の受託状況 …………… 5

## II. 一般勘定団体年金区分に関するご報告

- 2023年度第2四半期(上半期) 経済概況 …………… 7
- 2023年度第2四半期(上半期) 運用環境 …………… 8
- 2023年度第2四半期(上半期) 一般勘定団体年金区分 運用実績 …… 9
  - ・ 資産の状況について …………… 9
  - ・ 時価情報について …………… 13
  - ・ 損益状況について …………… 15
  - ・ 運用利回りについて …………… 17
  - ・ 個別資産の状況について …………… 19
- 2023年度下半期 経済予測 …………… 23
- 2023年度下半期 市場予測 …………… 25
- 運用哲学・運用方針 …………… 27
- 運用体制 …………… 31
- 運用プロセス …………… 32
- 資産運用リスク管理 …………… 33
- 資産管理体制 …………… 35

## III. ご参考

- スチュワードシップ活動 …………… 37
- 団体年金保険の契約者配当について…………… 41
- 解約調整率について …………… 43

### ～ご案内～

2022年4月より、これまで同一区分で運用してきた団体年金区分を、下記①・②の商品群にそれぞれ分割いたしました。今後は、お客さまに採用いただいている商品に合わせて、下記2つの商品群ごとにご報告させていただきます。ご報告冊子についても下記①・②ごとにご用意いたします。

① 2021年10月に予定利率・予定事業費率を変更した商品

(確定給付企業年金保険・厚生年金保険(Ⅱ)・新企業年金保険(Ⅱ))

② 2021年10月に予定利率・予定事業費率を変更していない商品

(拋出型企業年金保険(Ⅱ)・厚生年金保険・新企業年金保険 等)