

國民年金保險基金運用情形

*國民年金保險基金 97 年 10 月迄今整體績效

截至 103 年 7 月底

收益率
2.9818%

*基金運用概況表

1. 基金規模與投資績效

單位：新台幣萬元

103 年 7 月底止基金規模與收益		
基金運用規模		1,833 億 70 萬元
103 年截至 7 月底止 運用總損益及評價後報酬率	自行運用	63 億 4,858 萬元 4.23%
	委託經營	15 億 5,486 萬元 6.69%
	合計	79 億 344 萬元 4.56%

註：評價後報酬率係以當期報酬率（即收益÷103 年之日平均餘額）列示。

資產配置

截至 103 年 7 月底

單位：新台幣元

項 目	餘 額	占基金運用比例(%)
自行運用	160,891,068,100	87.77%
轉存金融機構	38,790,499,123	21.16%
短期票券	1,645,764,992	0.90%
公債、公司債及金融債券	16,599,108,800	9.05%
貨幣型基金	0	0.00%
股票及受益憑證投資(含期貨)	43,600,041,203	23.79%
國外投資	60,255,653,982	32.87%
固定收益	52,221,785,937	28.49%
權益證券	8,033,868,045	4.38%
另類投資	0	0.00%
委託經營	22,409,632,791	12.23%
國內委託經營	22,409,632,791	12.23%
國外委託經營	0	0.00%
固定收益	0	0.00%
權益證券	0	0.00%
另類投資	0	0.00%
合 計	183,300,700,891	100.00%

2. 基金自營投資與委外投資比例

截至 103 年 7 月底

單位：新台幣元

項 目	金 額	占基金運用比例 (%)
自行運用	160,891,068,100	87.77
委託經營	22,409,632,791	12.23

3. 基金國內投資與國外投資比例

截至 103 年 7 月底

單位：新台幣元

項 目	金 額	占基金運用比例 (%)
國內投資	123,045,046,909	67.13
國外投資	60,255,653,982	32.87

*基金自營投資概況

1. 基金自營投資績效（國內權益證券）

截至 103 年 7 月底

項 目	收益率（%）
國內權益證券	11.21

2. 基金自營股票及受益憑證投資比例概況

截至 103 年 7 月底

單位：新台幣元

項 目	金 額	比例（%）
國內權益證券	43,600,041,203	23.79

*基金國內委外投資概況表

1. 基金國內委外投資績效、績效指標及排名表

國民年金保險基金 102 年度

單位：新台幣元

投信 名稱	委託金額	目前淨資產	103 年截至 7 月累 積投資報酬(%)	委任迄今 (102.5.15~103.7.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	大盤報 酬率(%)
統一	4,000,000,000	4,703,476,594	10.04	17.59	1	12.89
滙豐中華	4,000,000,000	4,378,373,325	6.71	9.46	4	
國泰	4,000,000,000	4,397,218,449	6.15	9.93	3	
永豐	4,000,000,000	4,577,092,138	6.70	14.43	2	
摩根	4,000,000,000	4,353,472,285	4.53	8.84	5	
合計	20,000,000,000	22,409,632,791	6.84	12.05	-	

2. 103 年度被提前收回之國內委外投資帳戶

(1) 基金國內委外投資被提前收回帳戶經理人名單及收回原因：無

(2) 受託機構經管本基金帳戶被主管機關懲處之相關資訊：無

*基金投資衍生性金融商品概況表

國民年金保險基金自營部位

(依交易目的分)

103年7月31日

一、避險：

種類	避險比例
權益證券避險	0%
匯率避險	42.38%

二、投資：無

***國民年金保險基金投資運用財務收支表**

單位：新台幣元

時間	餘絀	營業收入	營業支出
103年7月	653,367,091	1,336,706,770	683,339,679

註：上述金額係依權責基礎填列。

***國民年金保險基金投資運用現金收支表**

103年7月份

單位：新台幣元

項 目	金 額
基金收入	23,264,223,366
基金支出	22,689,092,435
現金增〈減〉數	575,130,931

註：本表採現金基礎。