

國民年金保險基金運用情形

一、國民年金保險基金 97 年 10 月迄今整體績效

截至 104 年 6 月底

收益率
2.9332%

二、基金運用概況表

(一)基金規模與投資績效

單位：新台幣萬元

104 年 6 月底止基金規模與收益		
基金運用規模		2,118 億 4,981 萬元
104 年截至 6 月底止 運用總損益及評價後報酬率	自行運用	16 億 9,172 萬元 1.00%
	委託經營	9 億 3,363 萬元 4.15%
	合計	26 億 2,535 萬元 1.37%

註：評價後報酬率係以當期報酬率（即收益÷104 年之日平均餘額）列示。

(二) 資產配置

截至 104 年 6 月底

單位：新台幣元

項 目	餘 額	占基金運用比例(%)
自行運用	188,443,246,251	88.95
轉存金融機構	56,320,380,438	26.59
短期貸款	1,785,574,529	0.84
短期票券	3,669,780,487	1.73
公債、公司債及金融債券	16,799,184,924	7.93
貨幣型基金	0	0.00
股票及受益憑證投資(含期貨)	42,666,601,853	20.14
國外投資	67,201,724,020	31.72
固定收益	49,903,649,503	23.56
權益證券	16,426,882,758	7.75
另類投資	871,191,759	0.41
委託經營	23,406,568,490	11.05
國內委託經營	23,406,568,490	11.05
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	211,849,814,741	100.00

(三)基金自營投資與委外投資比例

截至 104 年 6 月底

單位：新台幣元

項 目	金 額	占基金運用比例 (%)
自行運用	188,443,246,251	88.95
委託經營	23,406,568,490	11.05

(四)基金國內投資與國外投資比例

截至 104 年 6 月底

單位：新台幣元

項 目	金 額	占基金運用比例 (%)
國內投資	144,648,090,721	68.28
國外投資	67,201,724,020	31.72

三、基金自營投資概況

(一)基金自營投資績效(國內權益證券)

截至 104 年 6 月底

項 目	收益率(%)
國內權益證券	3.94

(二)基金自營股票及受益憑證投資比例概況

截至 104 年 6 月底

單位：新台幣元

項 目	金 額	比例(%)
國內權益證券	42,666,601,853	20.14

四、基金國內委外投資概況表

(一)基金國內委外投資績效、績效指標及排名表

單位：新台幣元

投信 名稱	委託金額	目前淨資產	104年截至 6月累積投 資報酬(%)	委任迄今(102.5.15~104.6.30)		
				投資報酬率 (%)	排名	大盤報酬率 (%)
統一	4,000,000,000	4,830,601,918	3.53	20.77	2	12.98
滙豐 中華	4,000,000,000	4,427,499,530	0.76	10.69	5	
國泰	4,000,000,000	4,567,671,671	3.18	14.19	4	
永豐	4,000,000,000	4,965,211,169	8.84	24.13	1	
摩根	4,000,000,000	4,615,584,202	4.32	15.39	3	
合計	20,000,000,000	23,406,568,490	4.15	17.03	-	

(二)104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

投信名稱	懲處資訊
滙豐中華投信	國保102全權委託帳戶，查有投資分析報告內容錯誤情事，經金管會告知有違規情事，應予糾正。(104/6/15)

五、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）

截至 104 年 6 月底

(一)避險：

種類	避險比例
權益證券避險	0%
匯率避險	43.33%

(二)投資：無

六、國民年金保險基金投資運用財務收支表

單位：新台幣元

	餘絀	營業收入	營業支出
104年6月	-1,401,907,461	1,259,212,775	2,661,120,236

註：上述金額係依權責基礎填列。

七、國民年金保險基金投資運用現金收支表

104年6月份

單位：新台幣元

項 目	金 額
基金收入	37,998,748,874
基金支出	41,058,583,200
現金增〈減〉數	-3,059,834,326

註：本表採現金基礎。