

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 2 月底

收益率
2.9980%

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 2 月底止基金規模與收益		
基金運用規模		1,958 億 4,601 萬元
104 年截至 2 月底止 運用總損益及評價後報酬率	自行運用	25 億 208 萬元 1.53%
	委託經營	5 億 1,123 萬元 2.27%
	合計	30 億 1,331 萬元 1.62%

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 2 月底

單位：新台幣元

項 目	餘 額	占基金運用比例(%)
自行運用	172,861,903,394	88.27
轉存金融機構	31,695,248,564	16.19
短期貸款	1,081,314,053	0.55
短期票券	3,419,518,186	1.74
公債、公司債及金融債券	16,799,156,544	8.58
貨幣型基金	0	0.00
股票及受益憑證投資(含期貨)	46,565,096,193	23.78
國外投資	73,301,569,854	37.43
固定收益	55,560,593,345	28.37
權益證券	16,142,490,273	8.24
另類投資	1,598,486,236	0.82
委託經營	22,984,110,955	11.73
國內委託經營	22,984,110,955	11.73
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	195,846,014,349	100.00

(三)基金自營投資與委外投資比例

截至 104 年 2 月底

單位：新台幣元

項 目	金 額	占基金運用比例 (%)
自行運用	172,861,903,394	88.27
委託經營	22,984,110,955	11.73

(四)基金國內投資與國外投資比例

截至 104 年 2 月底

單位：新台幣元

項 目	金 額	占基金運用比例 (%)
國內投資	122,544,444,495	62.57
國外投資	73,301,569,854	37.43

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 2 月底

項 目	收益率 (%)
國內權益證券	3.83

(二)基金自營股票及受益憑證投資比例概況

截至 104 年 2 月底

單位：新台幣元

項 目	金 額	比例 (%)
國內權益證券	46,565,096,193	23.78

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2月累 積投資報 酬(%)	委任迄今(102.5.15~104.2.28)		
				投資報酬率 (%)	排名	大盤報酬率 (%)
統一	4,000,000,000	4,785,189,808	2.56	19.63	1	16.61
滙豐 中華	4,000,000,000	4,453,703,479	1.36	11.34	5	
國泰	4,000,000,000	4,505,645,245	1.78	12.64	4	
永豐	4,000,000,000	4,688,985,938	2.78	17.22	2	
摩根	4,000,000,000	4,550,586,485	2.85	13.76	3	
合計	20,000,000,000	22,984,110,955	2.27	14.92	-	

(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：無

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)

104年2月28日

1. 避險：

種類	避險比例
權益證券避險	0%
匯率避險	36.53%

2. 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2月	2,579,289,074	2,699,332,722	120,043,648

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2月份

單位：新台幣元

項 目	金 額
基金收入	14,947,482,415
基金支出	16,867,032,037
現金增〈減〉數	(1,919,549,622)

註：本表採現金基礎。