

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 7 月底

收益率
2.7306%

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 7 月底止基金規模與收益		
基金運用規模		2,124 億 9,502 萬元
104 年截至 7 月底止 運用總損益及評價後報酬率	自行運用	9 億 3,184 萬元 0.54%
	委託經營	-924 萬元 -0.04%
	合 計	9 億 2,260 萬元 0.48%

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 7 月底

單位：新台幣元

項 目	餘 額	占基金運用比例(%)
自行運用	190,030,881,085	89.43
轉存金融機構	54,435,224,789	25.62
短期貸款	2,990,414,477	1.41
短期票券	3,470,663,991	1.63
公債、公司債及金融債券	16,799,191,864	7.91
貨幣型基金	0	0.00
股票及受益憑證投資(含期貨)	43,798,965,375	20.61
國外投資	68,536,420,589	32.25
固定收益	50,972,712,025	23.98
權益證券	16,461,690,906	7.75
另類投資	1,102,017,658	0.52
委託經營	22,464,137,672	10.57
國內委託經營	22,464,137,672	10.57
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	212,495,018,757	100.00

(三)基金自營投資與委外投資比例

截至 104 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	190,030,881,085	89.43
委託經營	22,464,137,672	10.57

(四)基金國內投資與國外投資比例

截至 104 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	143,958,598,168	67.75
國外投資	68,536,420,589	32.25

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 7 月底

項 目	收益率(%)
國內權益證券	-0.43

(二)基金自營股票及受益憑證投資比例概況

截至 104 年 7 月底

單位：新台幣元

項 目	金 額	比例(%)
國內權益證券	43,798,965,375	20.61

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 7月累積投 資報酬(%)	委任迄今(102.5.15~104.7.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	大盤報酬率 (%)
統一	4,000,000,000	4,422,267,166	-5.22	10.56	4	5.01
滙豐 中華	4,000,000,000	4,337,772,590	-1.28	8.44	5	
國泰	4,000,000,000	4,537,377,471	2.50	13.43	2	
永豐	4,000,000,000	4,735,834,634	3.81	18.40	1	
摩根	4,000,000,000	4,430,885,811	0.15	10.77	3	
合計	20,000,000,000	22,464,137,672	-0.04	12.32	-	

(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 7 月底

(一)避險：

種類	避險比例
權益證券避險	0%
匯率避險	32.36%

(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7月	-1,702,747,444	1,763,432,752	3,466,180,196

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7月份

單位：新台幣元

項 目	金 額
基金收入	15,491,556,795
基金支出	14,315,012,444
現金增〈減〉數	1,176,544,351

註：本表採現金基礎。