

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 103 年 12 月底

收益率
3.3729%

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

103 年 12 月底止基金規模與收益		
基金運用規模		1,908 億 522 萬元
103 年截至 12 月底止 運用總損益及評價後報酬率	自行運用	90 億 2,903 萬元 5.87%
	委託經營	16 億 1,811 萬元 7.26%
	合計	106 億 4,714 萬元 6.05%
夏普指標(Sharp ratio)		0.51

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。

(二) 資產配置

截至 103 年 12 月底

單位：新台幣元

項 目	餘 額	占基金運用比例(%)
自行運用	168,332,334,297	88.22
轉存金融機構	26,525,917,973	13.90
短期貸款	1,150,702,168	0.61
短期票券	4,751,740,478	2.49
公債、公司債及金融債券	16,599,143,303	8.70
貨幣型基金	0	0.00
股票及受益憑證投資(含期貨)	46,736,046,671	24.49
國外投資	72,568,783,704	38.03
固定收益	55,444,637,807	29.06
權益證券	17,124,145,897	8.97
另類投資	0	0.00
委託經營	22,472,884,320	11.78
國內委託經營	22,472,884,320	11.78
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	190,805,218,617	100.00

(三)基金自營投資與委外投資比例

截至 103 年 12 月底

單位：新台幣元

項 目	金 額	占基金運用比例 (%)
自行運用	168,332,334,297	88.22
委託經營	22,472,884,320	11.78

(四)基金國內投資與國外投資比例

截至 103 年 12 月底

單位：新台幣元

項 目	金 額	占基金運用比例 (%)
國內投資	118,236,434,913	61.97
國外投資	72,568,783,704	38.03

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 103 年 12 月底

項 目	收益率(%)
國內權益證券	13.09

(二)基金自營股票及受益憑證投資比例概況

截至 103 年 12 月底

單位：新台幣元

項 目	金 額	比例(%)
國內權益證券	46,736,046,671	24.49

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	103 年截至 12 月累積投資報 酬(%)	委任迄今 (102.5.15~103.12.31)		
				投資報 酬率(%)	排名	大盤報酬 率(%)
統一	4,000,000,000	4,665,848,811	9.16	16.65	1	12.79
滙豐 中華	4,000,000,000	4,393,913,422	7.09	9.85	5	
國泰	4,000,000,000	4,426,735,455	6.87	10.67	3	
永豐	4,000,000,000	4,562,010,423	6.35	14.05	2	
摩根	4,000,000,000	4,424,376,209	6.23	10.61	4	
合計	20,000,000,000	22,472,884,320	7.15	12.36	-	

(二) 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

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 103 年 12 月底

1. 避險：

種類	避險比例
權益證券避險	0%
匯率避險	37.15%

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
103年12月	64,202,084	2,016,462,337	1,952,260,253

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

103年12月份

單位：新台幣元

項 目	金 額
基金收入	15,810,342,451
基金支出	16,967,883,599
現金增〈減〉數	(1,157,541,148)

註：本表採現金基礎。