

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 5 月底

收益率
3.1022%

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 5 月底止基金規模與收益		
基金運用規模		2,049 億 6,218 萬元
104 年截至 5 月底止 運用總損益及評價後報酬率	自行運用	28 億 587 萬元 1.68%
	委託經營	12 億 2,138 萬元 5.43%
	合計	40 億 2,725 萬元 2.13%

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 5 月底

單位：新台幣元

項 目	餘 額	占基金運用比例(%)
自行運用	181,267,854,862	88.44
轉存金融機構	46,784,914,764	22.82
短期貸款	1,917,928,609	0.94
短期票券	3,670,052,089	1.79
公債、公司債及金融債券	16,799,177,670	8.20
貨幣型基金	0	0.00
股票及受益憑證投資(含期貨)	42,916,340,709	20.94
國外投資	69,179,441,021	33.75
固定收益	51,426,450,695	25.09
權益證券	16,838,333,907	8.21
另類投資	914,656,419	0.45
委託經營	23,694,321,797	11.56
國內委託經營	23,694,321,797	11.56
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	204,962,176,659	100.00

(三)基金自營投資與委外投資比例

截至 104 年 5 月底

單位：新台幣元

項 目	金 額	占基金運用比例 (%)
自行運用	181,267,854,862	88.44
委託經營	23,694,321,797	11.56

(四)基金國內投資與國外投資比例

截至 104 年 5 月底

單位：新台幣元

項 目	金 額	占基金運用比例 (%)
國內投資	135,782,735,638	66.25
國外投資	69,179,441,021	33.75

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 5 月底

項 目	收益率(%)
國內權益證券	5.78

(二)基金自營股票及受益憑證投資比例概況

截至 104 年 5 月底

單位：新台幣元

項 目	金 額	比例(%)
國內權益證券	42,916,340,709	20.94

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 5 月累積投 資報酬(%)	委任迄今(102.5.15~104.5.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	大盤報酬 率(%)
統一	4,000,000,000	4,913,434,400	5.31	22.84	2	17.56
滙豐 中華	4,000,000,000	4,475,840,603	1.86	11.90	5	
國泰	4,000,000,000	4,602,414,982	3.97	15.06	4	
永豐	4,000,000,000	5,006,086,088	9.73	25.15	1	
摩根	4,000,000,000	4,696,545,724	6.15	17.41	3	
合計	20,000,000,000	23,694,321,797	5.43	18.47	-	

(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）

截至 104 年 5 月底

(一)避險：

種類	避險比例
權益證券避險	0%
匯率避險	33.47%

(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5月	62,950,095	1,139,864,621	1,076,914,526

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5月份

單位：新台幣元

項 目	金 額
基金收入	19,156,090,127
基金支出	17,733,337,359
現金增〈減〉數	1,422,752,768

註：本表採現金基礎。