

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 10 月底

收益率
2.7570%

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 10 月底止基金規模與收益		
基金運用規模		2,155 億 1,661 萬元
104 年截至 10 月底止 運用總損益及評價後報酬率	自行運用	14 億 7,052 萬元 0.84%
	委託經營	3,332 萬元 0.11%
	合計	15 億 384 萬元 0.73%

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 10 月底

單位：新台幣元

項 目	餘 額	占基金運用比例(%)
自行運用	180,007,176,508	83.52
轉存金融機構	44,566,075,919	20.68
短期貸款	3,165,594,580	1.46
短期票券	3,022,184,493	1.40
公債、公司債及金融債券	16,799,212,868	7.80
貨幣型基金	0	0.00
股票及受益憑證投資(含期貨)	48,351,839,099	22.44
國外投資	64,102,269,549	29.74
固定收益	46,744,797,530	21.69
權益證券	15,568,118,465	7.22
另類投資	1,789,353,554	0.83
委託經營	35,509,437,167	16.48
國內委託經營	22,071,302,099	10.24
國外委託經營	13,438,135,068	6.24
固定收益	0	0.00
權益證券	9,953,303,207	4.62
另類投資	3,484,831,861	1.62
合 計	215,516,613,675	100.00

(三)基金自營投資與委外投資比例

截至 104 年 10 月底

單位：新台幣元

項 目	金 額	占基金運用比例 (%)
自行運用	180,007,176,508	83.52
委託經營	35,509,437,167	16.48

(四)基金國內投資與國外投資比例

截至 104 年 10 月底

單位：新台幣元

項 目	金 額	占基金運用比例 (%)
國內投資	137,976,209,058	64.02
國外投資	77,540,404,617	35.98

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 10 月底

項 目	收 益 率 (%)
國內權益證券	-2.00

(二)基金自營股票及受益憑證投資比例概況

截至 104 年 10 月底

單位：新台幣元

項 目	金 額	比 例 (%)
國內權益證券	48,351,839,099	22.44

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10月累積投資報酬(%)	委任迄今 (102.5.15~104.10.31)		
				投資報酬率(%)	排名	大盤報酬率(%)
統一	4,000,000,000	4,244,629,077	-9.03	6.12	5	3.67
滙豐中華	4,000,000,000	4,260,346,519	-3.04	6.51	4	
國泰	4,000,000,000	4,565,160,327	3.13	14.13	2	
永豐	4,000,000,000	4,602,661,326	0.89	15.07	1	
摩根	4,000,000,000	4,398,504,850	-0.58	9.96	3	
合計	20,000,000,000	22,071,302,099	-1.79	10.36	-	

(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、基金國外委外投資概況表

(一)基金國外委外投資績效、績效指標及排名表

104-1 全球高品質被動股票型

單位：美元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	104年截至10月 累積投資報酬率 (%)	委任迄今 (104.08.11~104.10.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
北美信託	100,000,000	101,258,871	-0.06	-0.06	1	-0.19
LGIM	100,000,000	101,050,782	-0.35	-0.35	3	
GEODE	100,000,000	101,126,211	-0.22	-0.22	2	
合計	300,000,000	303,435,864	-0.21	-0.21	-	-

104 全球不動產股票型

單位：美元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	104年截至10月累 積投資報酬率 (%)	委任迄今 (104.09.25~104.10.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
信安環球	50,000,000	52,891,327	5.78	5.78	2	6.62
CBRE	50,000,000	53,347,069	6.69	6.69	1	
合計	100,000,000	106,238,396	6.24	6.24	-	-

(二)104 年度被提前收回之國外委外投資帳戶

基金國外委外投資被提前收回帳戶經理人名單及收回原因：無

六、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 10 月底

（一）避險：

種類	避險比例(%)
權益證券避險	0
匯率避險	35.82

（二）投資：無

七、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 10 月	4,289,617,090	4,990,104,329	700,487,239

註：上述金額係依權責基礎填列。

八、國民年金保險基金投資運用現金收支表

104 年 10 月份

單位：新台幣元

項 目	金 額
基金收入	19,113,514,218
基金支出	18,809,670,003
現金增〈減〉數	303,844,215

註：本表採現金基礎。