

# 農民退休基金運用情形

## 一、農民退休基金整體績效

### (一) 115 年截至 5 月底績效

基金與指標	農退基金	台灣 10 年期公債殖利率	台灣加權股價指數	MSCI 全球股票指數	Bloomberg 全球債券指數
收益率/報酬率	37.43%	1.48%	54.45%	12.15%	0.50%

註 1：股、債指數係依據行政院農業委員會 111 年 6 月 28 日農輔字第 1110023265 號函核定之農民退休基金投資政策書所載參考指標，且均為原幣別報酬率。

註 2：收益率係評價後收益數÷日平均餘額。

### (二) 近一年(114 年)績效

基金與指標	農退基金	台灣 10 年期公債殖利率	台灣加權股價指數	MSCI 全球股票指數	Bloomberg 全球債券指數
收益率/報酬率	15.41%	1.47%	25.74%	22.34%	8.17%

### (三) 近三年(112~114 年)平均績效

基金與指標	農退基金	台灣 10 年期公債殖利率	台灣加權股價指數	MSCI 全球股票指數	Bloomberg 全球債券指數
收益率/報酬率	15.66%	1.40%	27.01%	20.65%	3.98%

### (四) 近五年(110~114 年)平均績效

基金與指標	農退基金	台灣 10 年期公債殖利率	台灣加權股價指數	MSCI 全球股票指數	Bloomberg 全球債券指數
收益率/報酬率	13.49%	1.17%	14.48%	11.19%	-2.15%

## 二、基金運用概況表

### (一) 基金運用規模與投資績效

115 年 5 月底止基金運用規模與收益		
基金運用規模		296 億 9,397 萬元
115 年截至 5 月底止 運用收益數及收益率	自行運用	國內固定收益 2.56%
		國內權益證券 及國外投資 62.43%
	委託經營 0 萬元 0%	
	合 計 105 億 8,491 萬元 37.43%	

註 1：農民退休基金管理運用及盈虧分配辦法第 11 條規定收益率事項應另以本局公告為準。

註 2：收益率係以當期收益率(即收益數÷日平均餘額)列示。

註 3：115 年 5 月之保證收益率為 1.7108%。

### (二) 資產配置

115 年 5 月 31 日

單位：新臺幣元

項 目	餘 額	占基金運用比率(%)
<b>自行運用</b>	<b>29,693,973,615</b>	<b>100.00</b>
轉存金融機構	5,539,681,229	18.66
公債、公司債及金融債券	6,350,000,000	21.38
股票及受益憑證	10,455,392,551	35.21
國外投資	7,348,899,835	24.75
固定收益	6,273,692,619	21.13
權益證券	1,075,207,216	3.62
<b>合 計</b>	<b>29,693,973,615</b>	<b>100.00</b>

### (三)基金自營投資與委外投資比率

115年5月31日

單位：新臺幣元

項 目	金 額	占基金運用比率(%)
自行運用	29,693,973,615	100.00
委託經營	0	0.00

### (四)基金國內投資與國外投資比率

115年5月31日

單位：新臺幣元

項 目	金 額	占基金運用比率(%)
國內投資	22,345,073,780	75.25
國外投資	7,348,899,835	24.75

## 三、基金自營投資概況

### (一)基金自營投資績效(國內權益證券)

115年截至5月底

項 目	收益率(%)
國內權益證券	99.6253

### (二)基金自營股票及受益憑證投資比率概況

115年5月31日

項 目	金 額	比率(%)
國內權益證券	10,455,392,551	35.21