

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 8 月底

收益率
3.3290%

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 8 月底止基金規模與收益		
基金運用規模		1,852 億 8,003 萬元
103 年截至 8 月底止 運用總損益及評價後報酬率	自行運用	83 億 2,081 萬元 5.52%
	委託經營	19 億 5,153 萬元 8.51%
	合計	102 億 7,235 萬元 5.91%

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 8 月底

單位：新台幣元

項 目	餘 額	占基金運用比例(%)
自行運用	162,473,720,648	87.69%
轉存金融機構	32,065,076,018	17.31%
短期票券	2,165,659,063	1.17%
公債、公司債及金融債券	16,599,115,702	8.96%
貨幣型基金	0	0.00%
股票及受益憑證投資(含期貨)	44,513,461,300	24.02%
國外投資	67,130,408,565	36.23%
固定收益	55,399,091,011	29.90%
權益證券	11,731,317,554	6.33%
另類投資	0	0.00%
委託經營	22,806,306,865	12.31%
國內委託經營	22,806,306,865	12.31%
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	185,280,027,513	100.00%

(三)基金自營投資與委外投資比例

截至 103 年 8 月底

單位：新台幣元

項 目	金 額	占基金運用比例 (%)
自行運用	162,473,720,648	87.69
委託經營	22,806,306,865	12.31

(四)基金國內投資與國外投資比例

截至 103 年 8 月底

單位：新台幣元

項 目	金 額	占基金運用比例 (%)
國內投資	118,149,618,948	63.77
國外投資	67,130,408,565	36.23

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 8 月底

項 目	收益率(%)
國內權益證券	14.71

(二)基金自營股票及受益憑證投資比例概況

截至 103 年 8 月底

單位：新台幣元

項 目	金 額	比例(%)
國內權益證券	44,513,461,300	24.02

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

國民年金保險基金 102 年度

單位：新台幣元

投信 名稱	委託金額	目前淨資產	103 年截至 8 月累 積投資報酬(%)	委任迄今(102. 5. 15~103. 8. 31)		
				投資報 酬率(%)	排名	大盤報酬率(%)
統一	4,000,000,000	4,875,074,511	14.06	21.88	1	14.35
滙豐 中華	4,000,000,000	4,423,915,582	7.82	10.60	4	
國泰	4,000,000,000	4,411,719,657	6.50	10.29	5	
永豐	4,000,000,000	4,667,521,926	8.81	16.69	2	
摩根	4,000,000,000	4,428,075,189	6.32	10.70	3	
合計	20,000,000,000	22,806,306,865	8.74	14.03	-	

(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)

103年8月31日

1. 避險：

種類	避險比例
權益證券避險	0%
匯率避險	37.95%

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

時間	餘絀	營業收入	營業支出
103年8月	2,368,902,843	2,471,473,552	102,570,709

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8月份

單位：新台幣元

項 目	金 額
基金收入	19,953,473,885
基金支出	19,921,596,990
現金增〈減〉數	31,876,895

註：本表採現金基礎。