

國民年金保險基金運用情形

*國民年金保險基金 97 年 10 月迄今整體績效

截至 103 年 3 月底

收益率
2.2707%

*基金運用概況表

1. 基金規模與投資績效

單位：新台幣萬元

103 年 3 月底止基金規模與收益		
基金運用規模		1,770 億 300 萬元
103 年截至 3 月底止 運用總損益及評價後報酬率	自行運用	24 億 2,635 萬元 1.68%
	委託經營	5 億 9,972 萬元 2.28%
	合計	30 億 2,607 萬元 1.77%

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。

資產配置

截至 103 年 3 月底

單位：新台幣元

項 目	餘 額	占基金運用比例(%)
自行運用	155,548,499,897	87.87
轉存金融機構	55,384,154,020	31.29
短期票券	1,138,985,993	0.64
公債、公司債及金融債券	9,900,000,000	5.59
貨幣型基金	0	0.00
股票及受益憑證投資(含期貨)	39,722,691,001	22.44
國外投資	49,402,668,883	27.91
固定收益	48,557,555,123	27.43
權益證券	845,113,760	0.48
另類投資	0	0.00
委託經營	21,454,497,646	12.13
國內委託經營	21,454,497,646	12.13
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	177,002,997,543	100.00

2. 基金自營投資與委外投資比例

截至 103 年 3 月底

單位：新台幣元

項 目	金 額	占基金運用比例 (%)
自行運用	155,548,499,897	87.87
委託經營	21,454,497,646	12.13

3. 基金國內投資與國外投資比例

截至 103 年 3 月底

單位：新台幣元

項 目	金 額	占基金運用比例 (%)
國內投資	127,600,328,660	72.09
國外投資	49,402,668,883	27.91

*基金自營投資概況

1. 基金自營投資績效（國內權益證券）

截至 103 年 3 月底

項 目	收益率（%）
國內權益證券	2.62

2. 基金自營股票及受益憑證投資比例概況

截至 103 年 3 月底

單位：新台幣元

項 目	金 額	比例（%）
國內權益證券	39,722,691,001	22.44

*基金國內委外投資概況表

1. 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 3 月 累積投資報酬 (%)	委任迄今(102.5.15~103.3.31)		
				投資報酬 率(%)	排名	大盤報酬 率(%)
統一	4,000,000,000	4,451,489,197	4.15	11.29	1	7.24
滙豐中華	4,000,000,000	4,152,369,690	1.21	3.81	5	
國泰	4,000,000,000	4,208,440,910	1.60	5.21	4	
永豐	4,000,000,000	4,400,786,612	2.59	10.02	2	
摩根	4,000,000,000	4,241,411,237	1.84	6.04	3	
合計	20,000,000,000	21,454,497,646	2.29	7.27	-	

2. 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

*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3月31日

一、避險：

種類	避險比例
權益證券避險	0%
匯率避險	52.49%

二、投資：無

*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3月	1,911,235,491	2,300,384,042	389,148,551

註：上述金額係依權責基礎填列。

*國民年金保險基金投資運用現金收支表

103年3月份

單位：新台幣元

項 目	金 額
基金收入	17,932,000,235
基金支出	17,954,614,970
現金增〈減〉數	(22,614,735)

註：本表採現金基礎。