

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 9 月底

收益率
2.2776%

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 9 月底止基金規模與收益		
基金運用規模		2,104 億 3,668 萬元
104 年截至 9 月底止 運用總損益及評價後報酬率	自行運用	-19 億 1,037 萬元 -1.09%
	委託經營	-8 億 7,540 萬元 -2.87%
	合計	-27 億 8,577 萬元 -1.36%

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 9 月底

單位：新台幣元

項 目	餘 額	占基金運用比例(%)
自行運用	180,805,403,133	85.92
轉存金融機構	47,034,731,704	22.36
短期貸款	2,386,896,720	1.13
短期票券	3,170,690,786	1.51
公債、公司債及金融債券	16,799,205,882	7.98
貨幣型基金	0	0.00
股票及受益憑證投資(含期貨)	48,432,187,646	23.01
國外投資	62,981,690,395	29.93
固定收益	46,425,269,714	22.06
權益證券	14,946,364,979	7.10
另類投資	1,610,055,702	0.77
委託經營	29,631,278,005	14.08
國內委託經營	21,731,155,707	10.33
國外委託經營	7,900,122,298	3.75
固定收益	0	0.00
權益證券	4,574,807,752	2.17
另類投資	3,325,314,546	1.58
合 計	210,436,681,138	100.00

(三)基金自營投資與委外投資比例

截至 104 年 9 月底

單位：新台幣元

項 目	金 額	占基金運用比例 (%)
自行運用	180,805,403,133	85.92
委託經營	29,631,278,005	14.08

(四)基金國內投資與國外投資比例

截至 104 年 9 月底

單位：新台幣元

項 目	金 額	占基金運用比例 (%)
國內投資	139,554,868,445	66.32
國外投資	70,881,812,693	33.68

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 9 月底

項 目	收 益 率 (%)
國內權益證券	-6.95

(二)基金自營股票及受益憑證投資比例概況

截至 104 年 9 月底

單位：新台幣元

項 目	金 額	比 例 (%)
國內權益證券	48,432,187,646	23.01

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 9 月累積投 資報酬(%)	委任迄今(102.5.15~104.9.30)		
				投資報酬率 (%)	排名	大盤報酬率 (%)
統一	4,000,000,000	4,164,421,881	-10.75	4.11	5	-0.86
滙豐 中華	4,000,000,000	4,217,218,437	-4.02	5.43	4	
國泰	4,000,000,000	4,415,240,861	-0.26	10.38	2	
永豐	4,000,000,000	4,588,589,046	0.58	14.71	1	
摩根	4,000,000,000	4,345,685,482	-1.78	8.64	3	
合計	20,000,000,000	21,731,155,707	-3.30	8.66	-	

(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09月 累積投資報酬率 (%)	委任迄今 (104.08.11~104.09.30)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
北美信託	50,000,000	46,061,780	-7.88	-7.88	1	-1.62
LGIM	50,000,000	46,005,150	-7.99	-7.99	3	
GEODE	50,000,000	46,027,966	-7.94	-7.94	2	
合計	150,000,000	138,094,897	-7.94	-7.94	-	-

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09月 累積投資報酬率 (%)	委任迄今 (104.09.25~104.09.30)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
信安環球	50,000,000	50,023,691	0.05	0.05	2	0.88
CBRE	50,000,000	50,354,073	0.71	0.71	1	
合計	100,000,000	100,377,763	0.38	0.38	-	-

(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 9 月底

（一）避險：

種類	避險比例(%)
權益證券避險	0
匯率避險	36.82

（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 9 月	-1,317,051,608	1,373,712,294	2,690,763,902

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 9 月份

單位：新台幣元

項 目	金 額
基金收入	18,336,225,058
基金支出	16,666,308,288
現金增〈減〉數	1,669,916,770

註：本表採現金基礎。