

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 10 月底

收益率
3.0797%

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 10 月底止基金規模與收益		
基金運用規模		1,865 億 1,756 萬元
103 年截至 10 月底止 運用總損益及評價後報酬率	自行運用	74 億 9,293 萬元 4.91%
	委託經營	11 億 2,427 萬元 4.99%
	合計	86 億 1,720 萬元 4.92%

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 10 月底

單位：新台幣元

項 目	餘 額	占基金運用比例(%)
自行運用	164,538,511,913	88.22
轉存金融機構	28,261,914,941	15.16
短期票券	4,016,533,217	2.15
公債、公司債及金融債券	16,599,129,480	8.90
貨幣型基金	0	0.00
股票及受益憑證投資(含期貨)	44,890,708,099	24.07
國外投資	70,770,226,176	37.94
固定收益	53,215,095,294	28.53
權益證券	17,555,130,882	9.41
另類投資	0	0.00
委託經營	21,979,043,782	11.78
國內委託經營	21,979,043,782	11.78
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	186,517,555,695	100.00

(三)基金自營投資與委外投資比例

截至 103 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	164,538,511,913	88.22
委託經營	21,979,043,782	11.78

(四)基金國內投資與國外投資比例

截至 103 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	115,747,329,519	62.06
國外投資	70,770,226,176	37.94

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 10 月底

項 目	收益率(%)
國內權益證券	11.48

(二)基金自營股票及受益憑證投資比例概況

截至 103 年 10 月底

單位：新台幣元

項 目	金 額	比例(%)
國內權益證券	44,890,708,099	24.07

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10月累 積投資報酬(%)	委任迄今(102.5.15~103.10.31)		
				投資報 酬率(%)	排名	大盤報酬率(%)
統一	4,000,000,000	4,543,183,851	6.29	13.58	1	8.76
滙豐 中華	4,000,000,000	4,349,008,445	6.00	8.73	3	
國泰	4,000,000,000	4,341,039,030	4.80	8.53	4	
永豐	4,000,000,000	4,463,327,167	4.05	11.58	2	
摩根	4,000,000,000	4,282,485,289	2.82	7.06	5	
合計	20,000,000,000	21,979,043,782	4.79	9.90	-	

(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 10 月 31 日

1. 避險：

種類	避險比例
權益證券避險	0%
匯率避險	36.61%

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

	餘絀	營業收入	營業支出
103年10月	1,741,875,670	2,093,844,490	351,968,820

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10月份

單位：新台幣元

項 目	金 額
基金收入	14,936,842,820
基金支出	14,617,814,476
現金增〈減〉數	319,028,344

註：本表採現金基礎。