

# 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 8 月底績效

| 基金與指標   | 農退基金   | 台灣 10 年期<br>公債殖利率 | 台灣加權<br>股價指數 | MSCI 全球<br>股票指數 | Bloomberg<br>全球債券指數 |
|---------|--------|-------------------|--------------|-----------------|---------------------|
| 收益率/報酬率 | 36.22% | 1.61%             | 59.26%       | 14.31%          | -0.30%              |

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<br>公債殖利率 | 台灣加權<br>股價指數 | MSCI 全球<br>股票指數 | Bloomberg<br>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<br>公債殖利率 | 台灣加權<br>股價指數 | MSCI 全球<br>股票指數 | Bloomberg<br>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<br>公債殖利率 | 台灣加權<br>股價指數 | MSCI 全球<br>股票指數 | Bloomberg<br>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 8 月底止基金運用規模與收益       |      |                 |                          |
|----------------------------|------|-----------------|--------------------------|
| 基金運用規模                     |      |                 | 314 億 3,241 萬元           |
| 115 年截至 8 月底止<br>運用收益數及收益率 | 自行運用 | 國內固定收益          | 1 億 9,997 萬元<br>2.54%    |
|                            |      | 國內權益證券<br>及國外投資 | 103 億 8,085 萬元<br>59.78% |
|                            | 委託經營 |                 | 0 萬元<br>0%               |
|                            | 合 計  |                 | 105 億 8,082 萬元<br>36.22% |

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 8 月之保證收益率為 1.7108%。

### (二)資產配置

115 年 8 月 31 日

單位：新臺幣元

| 項 目         | 餘 額            | 占基金運用比率(%) |
|-------------|----------------|------------|
| 自行運用        | 31,432,412,370 | 100.00     |
| 轉存金融機構      | 6,135,803,530  | 19.52      |
| 公債、公司債及金融債券 | 6,450,000,000  | 20.52      |
| 股票及受益憑證     | 11,195,996,151 | 35.62      |
| 國外投資        | 7,650,612,689  | 24.34      |
| 固定收益        | 6,365,024,531  | 20.25      |
| 權益證券        | 1,285,588,158  | 4.09       |
| 合 計         | 31,432,412,370 | 100.00     |

### (三)基金自營投資與委外投資比率

115 年 8 月 31 日

單位：新臺幣元

| 項 目     | 金 額            | 占基金運用比率(%) |
|---------|----------------|------------|
| 自 行 運 用 | 31,432,412,370 | 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 8 月 31 日

單位：新臺幣元

| 項 目     | 金 額            | 占基金運用比率(%) |
|---------|----------------|------------|
| 國 內 投 資 | 23,781,799,681 | 75.66      |
| 國 外 投 資 | 7,650,612,689  | 24.34      |

## 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 8 月底

| 項 目    | 收益率(%) |
|--------|--------|
| 國內權益證券 | 96.26  |

### (二)基金自營股票及受益憑證投資比率概況

115 年 8 月 31 日

| 項 目    | 金 額            | 比率(%) |
|--------|----------------|-------|
| 國內權益證券 | 11,195,996,151 | 35.62 |