

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 3 月底

收益率
2.9194%

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 3 月底止基金規模與收益		
基金運用規模		1,982 億 9,599 萬元
104 年截至 3 月底止 運用總損益及評價後報酬率	自行運用	17 億 7,945 萬元 1.08%
	委託經營	5 億 8,521 萬元 2.60%
	合計	23 億 6,466 萬元 1.27%

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 3 月底

單位：新台幣元

項 目	餘 額	占基金運用比例(%)
自行運用	175,237,894,655	88.37
轉存金融機構	36,131,913,179	18.22
短期貸款	328,243,652	0.17
短期票券	3,819,944,789	1.93
公債、公司債及金融債券	16,799,163,527	8.47
貨幣型基金	0	0.00
股票及受益憑證投資(含期貨)	45,360,722,406	22.87
國外投資	72,797,907,102	36.71
固定收益	56,017,005,625	28.24
權益證券	15,640,102,730	7.89
另類投資	1,140,798,747	0.58
委託經營	23,058,094,950	11.63
國內委託經營	23,058,094,950	11.63
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	198,295,989,605	100.00

(三)基金自營投資與委外投資比例

截至 104 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	175,237,894,655	88.37
委託經營	23,058,094,950	11.63

(四)基金國內投資與國外投資比例

截至 104 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	125,498,082,503	63.29
國外投資	72,797,907,102	36.71

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 3 月底

項 目	收益率(%)
國內權益證券	3.15

(二)基金自營股票及受益憑證投資比例概況

截至 104 年 3 月底

單位：新台幣元

項 目	金 額	比例(%)
國內權益證券	45,360,722,406	22.87

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 3月累積投 資報酬(%)	委任迄今 (102.5.15~104.3.31)		
				投資報酬 率(%)	排名	大盤報酬 率(%)
統一	4,000,000,000	4,788,075,060	2.62	19.70	1	16.17
滙豐 中華	4,000,000,000	4,435,404,170	0.94	10.89	5	
國泰	4,000,000,000	4,503,346,629	1.73	12.58	4	
永豐	4,000,000,000	4,766,830,349	4.49	19.17	2	
摩根	4,000,000,000	4,564,438,742	3.17	14.11	3	
合計	20,000,000,000	23,058,094,950	2.60	15.29	-	

(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：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)

104年3月31日

1. 避險：

種類	避險比例
權益證券避險	0%
匯率避險	36.66%

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
104年3月	-648,649,378	654,860,041	1,303,509,419

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

104年3月份

單位：新台幣元

項 目	金 額
基金收入	28,555,766,642
基金支出	28,332,902,027
現金增〈減〉數	222,864,615

註：本表採現金基礎。