

# 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 9 月底

收益率
2.8260%

## 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 9 月底止基金規模與收益		
基金運用規模		1,846 億 3,317 萬元
103 年截至 9 月底止 運用總損益及評價後報酬率	自行運用	55 億 9,140 萬元 3.69%
	委託經營	12 億 8,392 萬元 5.65%
	合計	68 億 7,532 萬元 3.94%

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 9 月底

單位：新台幣元

項 目	餘 額	占基金運用比例(%)
<b>自行運用</b>	<b>162,494,471,136</b>	<b>88.01%</b>
轉存金融機構	27,292,086,597	14.78%
短期票券	5,571,730,858	3.02%
公債、公司債及金融債券	16,599,122,554	8.99%
貨幣型基金	0	0.00%
股票及受益憑證投資(含期貨)	42,981,234,872	23.28%
國外投資	70,050,296,255	37.94%
固定收益	55,846,714,808	30.25%
權益證券	14,203,581,447	7.69%
另類投資	0	0.00%
<b>委託經營</b>	<b>22,138,698,583</b>	<b>11.99%</b>
國內委託經營	22,138,698,583	11.99%
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%
<b>合 計</b>	<b>184,633,169,719</b>	<b>100.00%</b>

### (三)基金自營投資與委外投資比例

截至 103 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	162,494,471,136	88.01
委託經營	22,138,698,583	11.99

### (四)基金國內投資與國外投資比例

截至 103 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	114,582,873,464	62.06
國外投資	70,050,296,255	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 9 月底

項 目	收益率(%)
國內權益證券	8.33

#### (二)基金自營股票及受益憑證投資比例概況

截至 103 年 9 月底

單位：新台幣元

項 目	金 額	比例(%)
國內權益證券	42,981,234,872	23.28

#### 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 9 月累 積投資報酬(%)	委任迄今(102.5.15~103.9.30)		
				投資報 酬率(%)	排名	大盤報酬率(%)
統一	4,000,000,000	4,670,488,094	9.27	16.76	1	8.67
滙豐 中華	4,000,000,000	4,319,637,492	5.28	7.99	4	
國泰	4,000,000,000	4,335,633,730	4.67	8.39	3	
永豐	4,000,000,000	4,505,841,830	5.04	12.65	2	
摩根	4,000,000,000	4,307,097,437	3.41	7.68	5	
合計	20,000,000,000	22,138,698,583	5.55	10.69	-	

##### (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9月30日

#### 1. 避險：

種類	避險比例
權益證券避險	0%
匯率避險	36.93%

#### 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9月	-3,397,025,711	470,996,126	3,868,021,837

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9月份

單位：新臺幣元

項 目	金 額
基金收入	30,610,026,605
基金支出	31,259,916,026
現金增〈減〉數	(649,889,421)

註：本表採現金基礎。