

# 國民年金保險基金運用情形

## \*國民年金保險基金 97 年 10 月迄今整體績效

截至 103 年 6 月底

收益率
2.8873%

## \*基金運用概況表

### 1. 基金規模與投資績效

單位：新台幣萬元

103 年 6 月底止基金規模與收益		
基金運用規模		1,823 億 7,936 萬元
103 年截至 6 月底止 運用總損益及評價後報酬率	自行運用	57 億 6,400 萬元 3.86%
	委託經營	14 億 8,608 萬元 6.29%
	合計	72 億 5,008 萬元 4.19%

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。

## 資產配置

截至 103 年 6 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>	160,038,511,870	87.75%
轉存金融機構	43,365,068,192	23.78%
短期票券	3,076,482,841	1.69%
公債、公司債及金融債券	12,099,553,485	6.64%
貨幣型基金	0	0.00%
股票及受益憑證投資(含期貨)	42,811,402,021	23.47%
國外投資	58,686,005,331	32.18%
固定收益	52,172,211,118	28.61%
權益證券	6,513,794,213	3.57%
另類投資	0	0.00%
<b>委託經營</b>	22,340,847,215	12.25%
國內委託經營	22,340,847,215	12.25%
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>	182,379,359,085	100.00%

## 2. 基金自營投資與委外投資比例

截至 103 年 6 月底

單位：新台幣元

項 目	金 額	占基金運用比例 (%)
自行運用	160,038,511,870	87.75
委託經營	22,340,847,215	12.25

## 3. 基金國內投資與國外投資比例

截至 103 年 6 月底

單位：新台幣元

項 目	金 額	占基金運用比例 (%)
國內投資	123,693,353,754	67.82
國外投資	58,686,005,331	32.18

## \*基金自營投資概況

### 1. 基金自營投資績效（國內權益證券）

截至 103 年 6 月底

項 目	收 益 率（%）
國內權益證券	9.55

### 2. 基金自營股票及受益憑證投資比例概況

截至 103 年 6 月底

單位：新台幣元

項 目	金 額	比 例（%）
國內權益證券	42,811,402,021	23.47

\*基金國內委外投資概況表

1. 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 6 月累 積投資報酬(%)	委任迄今 (102.5.15~103.6.30)		
				投資報酬率 (%)	排名	大盤報 酬率(%)
統一	4,000,000,000	4,800,393,387	12.31	20.01	1	13.83
滙豐中華	4,000,000,000	4,354,815,299	6.14	8.87	3	
國泰	4,000,000,000	4,275,728,155	3.22	6.89	5	
永豐	4,000,000,000	4,575,723,751	6.67	14.39	2	
摩根	4,000,000,000	4,334,186,623	4.07	8.35	4	
合計	20,000,000,000	22,340,847,215	6.52	11.70	-	

2. 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

\*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6月30日

一、避險：

種類	避險比例
權益證券避險	0%
匯率避險	43.33%

二、投資：無

**\*國民年金保險基金投資運用財務收支表**

單位：新台幣元

時間	餘絀	營業收入	營業支出
103年6月	2,067,095,566	2,130,331,757	63,236,191

註：上述金額係依權責基礎填列。

**\*國民年金保險基金投資運用現金收支表**

103年6月份

單位：新台幣元

項 目	金 額
基金收入	21,608,998,152
基金支出	21,520,156,809
現金增〈減〉數	88,841,343

註：本表採現金基礎。