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 9 月底績效

基金與指標	農退基金	台灣 10 年期公債殖利率	台灣加權股價指數	MSCI 全球股票指數	Bloomberg 全球債券指數
收益率/報酬率	40.72%	1.65%	65.52%	13.03%	-2.67%

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 年期公債殖利率	台灣加權股價指數	MSCI 全球股票指數	Bloomberg 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 年期公債殖利率	台灣加權股價指數	MSCI 全球股票指數	Bloomberg 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 年期公債殖利率	台灣加權股價指數	MSCI 全球股票指數	Bloomberg 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9月底止基金運用規模與收益情形		
基金運用規模		324億7,360萬元
115年截至9月底止運用收益數	自行運用	120億2,641萬元
	委託經營	0萬元
	合　　計(收益率)	120億2,641萬元 (40.72%)

(二)資產配置

115年9月30日　　單位：新臺幣元

項　　目	餘　　額	占基金運用比率（%）
自行運用	**32,473,603,973**	**100.00**
轉存金融機構	6,862,667,200	21.13
公債、公司債及金融債券	6,350,000,000	19.55
股票及受益憑證	11,315,867,288	34.85
國外投資	7,945,069,485	24.47
固定收益	6,618,293,683	20.38
權益證券	1,326,775,802	4.09
合　　計	**32,473,603,973**	**100.00**

(三)基金自營投資與委外投資比率

115 年 9 月 30 日　　單位：新臺幣元

項　　目	金　　額	占基金運用比率（%）
自 行 運 用	32,473,603,973	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 9 月 30 日　　單位：新臺幣元

項　　目	金　　額	占基金運用比率（%）
國 內 投 資	24,528,534,488	75.53
國 外 投 資	7,945,069,485	24.47

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 9 月底

項　　目	收益率（%）
國內權益證券	109.50

(二)基金自營股票及受益憑證投資比率概況

115 年 9 月 30 日

項　　目	金　　額	比率（%）
國內權益證券	11,315,867,288	34.85