

# 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 11 月底

收益率
3.3662%

## 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 11 月底止基金規模與收益		
基金運用規模		1,886 億 97 萬元
103 年截至 11 月底止 運用總損益及評價後報酬率	自行運用	91 億 7,544 萬元 5.99%
	委託經營	14 億 749 萬元 6.28%
	合 計	105 億 8,293 萬元 6.03%

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 11 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>166,338,701,979</b>	<b>88.19</b>
轉存金融機構	28,445,859,121	15.08
短期貸款	35,026,616	0.02
短期票券	2,920,012,908	1.55
公債、公司債及金融債券	16,599,136,355	8.80
貨幣型基金	0	0.00
股票及受益憑證投資(含期貨)	46,306,829,371	24.55
國外投資	72,031,837,608	38.19
固定收益	53,863,368,588	28.56
權益證券	18,168,469,020	9.63
另類投資	0	0.00
<b>委託經營</b>	<b>22,262,265,003</b>	<b>11.81</b>
國內委託經營	22,262,265,003	11.81
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>188,600,966,982</b>	<b>100.00</b>

### (三)基金自營投資與委外投資比例

截至 103 年 11 月底

單位：新台幣元

項 目	金 額	占基金運用比例 (%)
自行運用	166,338,701,979	88.19
委託經營	22,262,265,003	11.81

### (四)基金國內投資與國外投資比例

截至 103 年 11 月底

單位：新台幣元

項 目	金 額	占基金運用比例 (%)
國內投資	116,569,129,374	61.81
國外投資	72,031,837,608	38.19

### 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11月底

項 目	收益率(%)
國內權益證券	13.73

#### (二)基金自營股票及受益憑證投資比例概況

截至103年11月底

單位：新台幣元

項 目	金 額	比例(%)
國內權益證券	46,306,829,371	24.55

#### 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 11 月累積投 資報酬(%)	委任迄今 (102.5.15~103.11.30)		
				投資報酬 率(%)	排名	大盤報 酬率(%)
統一	4,000,000,000	4,604,182,447	7.72	15.10	1	11.33
滙豐 中華	4,000,000,000	4,395,678,600	7.14	9.89	3	
國泰	4,000,000,000	4,364,626,511	5.37	9.12	4	
永豐	4,000,000,000	4,534,529,892	5.71	13.36	2	
摩根	4,000,000,000	4,363,247,553	4.76	9.08	5	
合計	20,000,000,000	22,262,265,003	6.14	11.31	-	

##### (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11月30日

1. 避險：

種類	避險比例
權益證券避險	0%
匯率避險	36.63%

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11月	1,965,737,635	2,702,846,558	737,108,923

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11月份

單位：新台幣元

項 目	金 額
基金收入	13,456,534,283
基金支出	12,587,790,103
現金增〈減〉數	868,744,180

註：本表採現金基礎。