

# 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 1 月底

收益率
2.6997%

## 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 1 月底止基金規模與收益		
基金運用規模		1,925 億 3,627 萬元
104 年截至 1 月底止 運用總損益及評價後報酬率	自行運用	2 億 5,923 萬元 0.16%
	委託經營	1 億 7,479 萬元 0.78%
	合 計	4 億 3,402 萬元 0.23%

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 1 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>169,888,600,492</b>	<b>88.24</b>
轉存金融機構	30,318,298,186	15.75
短期貸款	0	0.00
短期票券	4,002,202,520	2.08
公債、公司債及金融債券	16,699,150,263	8.67
貨幣型基金	0	0.00
股票及受益憑證投資(含期貨)	46,414,917,637	24.11
國外投資	72,454,031,886	37.63
固定收益	55,170,828,281	28.66
權益證券	15,080,464,623	7.83
另類投資	2,202,738,982	1.14
<b>委託經營</b>	<b>22,647,670,942</b>	<b>11.76</b>
國內委託經營	22,647,670,942	11.76
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>192,536,271,434</b>	<b>100.00</b>

### (三)基金自營投資與委外投資比例

截至 104 年 1 月底

單位：新台幣元

項 目	金 額	占基金運用比例 (%)
自行運用	169,888,600,492	88.24
委託經營	22,647,670,942	11.76

### (四)基金國內投資與國外投資比例

截至 104 年 1 月底

單位：新台幣元

項 目	金 額	占基金運用比例 (%)
國內投資	120,082,239,548	62.37
國外投資	72,454,031,886	37.63

### 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 1 月底

項 目	收益率(%)
國內權益證券	0.59

#### (二)基金自營股票及受益憑證投資比例概況

截至 104 年 1 月底

單位：新台幣元

項 目	金 額	比例(%)
國內權益證券	46,414,917,637	24.11

#### 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1月累積投資報酬(%)	委任迄今(102.5.15~104.1.31)		
				投資報酬率(%)	排名	大盤報酬率(%)
統一	4,000,000,000	4,720,853,452	1.18	18.02	1	13.45
滙豐 中華	4,000,000,000	4,400,191,434	0.14	10.00	5	
國泰	4,000,000,000	4,456,066,446	0.66	11.40	4	
永豐	4,000,000,000	4,596,863,194	0.76	14.92	2	
摩根	4,000,000,000	4,473,696,416	1.11	11.84	3	
合計	20,000,000,000	22,647,670,942	0.78	13.24	-	

##### (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1月31日

### 1. 避險：

種類	避險比例
權益證券避險	0%
匯率避險	37.02%

### 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1月	434,017,861	591,114,162	157,096,301

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1月份

單位：新台幣元

項 目	金 額
基金收入	17,688,381,254
基金支出	15,767,001,041
現金增〈減〉數	1,921,380,213

註：本表採現金基礎。