

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 8 月底

收益率
2.4392%

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 8 月底止基金規模與收益		
基金運用規模		2,118 億 9,314 萬元
104 年截至 8 月底止 運用總損益及評價後報酬率	自行運用	-7 億 7,216 萬元 -0.45%
	委託經營	-6 億 9,656 萬元 -2.56%
	合計	-14 億 6,872 萬元 -0.73%

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 8 月底

單位：新台幣元

項 目	餘 額	占基金運用比例(%)
自行運用	185,364,013,252	87.48
轉存金融機構	48,578,514,934	22.93
短期貸款	2,180,622,259	1.03
短期票券	3,470,655,497	1.64
公債、公司債及金融債券	16,799,198,826	7.92
貨幣型基金	0	0.00
股票及受益憑證投資(含期貨)	47,347,190,759	22.34
國外投資	66,987,830,977	31.62
固定收益	50,314,307,599	23.75
權益證券	15,427,229,168	7.28
另類投資	1,246,294,210	0.59
委託經營	26,529,125,876	12.52
國內委託經營	21,924,485,996	10.35
國外委託經營	4,604,639,880	2.17
固定收益	0	0.00
權益證券	4,604,639,880	2.17
另類投資	0	0.00
合 計	211,893,139,128	100.00

(三)基金自營投資與委外投資比例

截至 104 年 8 月底

單位：新台幣元

項 目	金 額	占基金運用比例 (%)
自行運用	185,364,013,252	87.48
委託經營	26,529,125,876	12.52

(四)基金國內投資與國外投資比例

截至 104 年 8 月底

單位：新台幣元

項 目	金 額	占基金運用比例 (%)
國內投資	140,300,668,271	66.21
國外投資	71,592,470,857	33.79

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 8 月底

項 目	收益率(%)
國內權益證券	-4.93

(二)基金自營股票及受益憑證投資比例概況

截至 104 年 8 月底

單位：新台幣元

項 目	金 額	比例(%)
國內權益證券	47,347,190,759	22.34

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 8月累積投 資報酬(%)	委任迄今 (102.5.15~104.8.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	大盤報酬率 (%)
統一	4,000,000,000	4,213,279,735	-9.70	5.33	5	-0.93
滙豐 中華	4,000,000,000	4,273,399,209	-2.74	6.83	4	
國泰	4,000,000,000	4,432,917,352	0.14	10.82	2	
永豐	4,000,000,000	4,659,872,262	2.15	16.50	1	
摩根	4,000,000,000	4,345,017,438	-1.79	8.63	3	
合計	20,000,000,000	21,924,485,996	-2.44	9.62	-	

(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

投信名稱	懲處資訊
滙豐中華投信	國保102全權委託帳戶，查有投資分析報告內容錯誤情事，經金管會告知有違規情事，應予糾正。(104/6/15)

五、基金國外委外投資概況表

(一)基金國外委外投資績效、績效指標及排名表

104-1 全球高品質被動股票型

單位：美元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	104 年截至 8 月 累積投資報酬率 (%)	委任迄今 (104.08.11~104.08.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報 酬率(%)
北美信託	50,000,000	46,794,885	-6.41	-6.41	1	-6.34
LGIM	50,000,000	46,739,412	-6.52	-6.52	3	
GEODE	50,000,000	46,740,823	-6.52	-6.52	2	
合計	150,000,000	140,275,121	-6.48	-6.48	-	-

(二)104 年度被提前收回之國外委外投資帳戶

基金國外委外投資被提前收回帳戶經理人名單及收回原因：無

六、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）

截至 104 年 8 月底

(一)避險：

種類	避險比例
權益證券避險	0%
匯率避險	34.29%

(二)投資：無

七、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8月	-2,391,320,533	2,598,770,578	4,990,091,111

註：上述金額係依權責基礎填列。

八、國民年金保險基金投資運用現金收支表

104年8月份

單位：新台幣元

項 目	金 額
基金收入	27,836,110,747
基金支出	26,205,020,602
現金增〈減〉數	1,631,090,145

註：本表採現金基礎。