

# 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 2 月底

收益率
1.9905%

## \*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 2 月底止基金規模與收益		
基金運用規模		1,750 億 6,245 萬元
103 年截至 2 月底止 運用總損益及評價後報酬率	自行運用	8 億 5,002 萬元 0.60%
	委託經營	2 億 6,482 萬元 0.97%
	合計	11 億 1,483 萬元 0.66%

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 2 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>	147,438,111,985	84.22
轉存金融機構	49,428,768,755	28.23
短期票券	799,133,759	0.45
公債、公司債及金融債券	9,900,000,000	5.65
貨幣型基金	0	0.00
股票及受益憑證投資(含期貨)	38,610,150,199	22.06
國外投資	48,700,059,272	27.83
固定收益	48,700,059,272	27.83
權益證券	0	0.00
另類投資	0	0.00
<b>委託經營</b>	27,624,337,263	15.78
國內委託經營	27,624,337,263	15.78
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>	175,062,449,248	100.00

## 2. 基金自營投資與委外投資比例

截至 103 年 2 月底

單位：新台幣元

項 目	金 額	占基金運用比例 (%)
自行運用	147,438,111,985	84.22
委託經營	27,624,337,263	15.78

## 3. 基金國內投資與國外投資比例

截至 103 年 2 月底

單位：新台幣元

項 目	金 額	占基金運用比例 (%)
國內投資	126,362,389,976	72.17
國外投資	48,700,059,272	27.83

## \*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 2 月底

項 目	收益率（%）
國內權益證券	-0.38

### 2. 基金自營股票及受益憑證投資比例概況

截至 103 年 2 月底

單位：新台幣元

項 目	金 額	比例（%）
國內權益證券	38,610,150,199	22.06

## \*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

#### 國民年金保險基金第二梯次

單位：新台幣元

投信 名稱	委託金額	目前淨資產	103年截至2月累 積投資報酬(%)	委任迄今(100.3.16~103.2.28)		
				投資報酬 率(%)	排名	大盤報酬率(%)
復華	1,500,000,000	1,576,380,044	1.85	5.09	3	3.87
統一	1,500,000,000	1,651,216,818	0.84	10.08	1	
國泰	3,000,000,000	3,236,765,458	1.14	7.89	2	
合計	6,000,000,000	6,464,362,320	1.24	7.74	-	

#### 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2月累 積投資報酬(%)	委任迄今(102.5.15~103.2.28)		
				投資報 酬率(%)	排名	大盤報酬率(%)
統一	4,000,000,000	4,377,385,077	2.41	9.43	1	4.54
滙豐 中華	4,000,000,000	4,100,259,558	-0.06	2.51	5	
國泰	4,000,000,000	4,163,248,779	0.51	4.08	4	
永豐	4,000,000,000	4,325,247,152	0.83	8.13	2	
摩根	4,000,000,000	4,193,834,377	0.70	4.85	3	
合計	20,000,000,000	21,159,974,943	0.89	5.80	-	

## 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 2 月 28 日

#### 一、避險：

種類	避險比例
權益證券避險	0%
匯率避險	52.98%

#### 二、投資：無

## \*國民年金保險基金財務收支表

單位：新台幣元

	餘絀	營業收入	營業支出
103年2月	1,327,217,776	1,446,695,759	119,477,983

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2月份

單位：新台幣元

項 目	金 額
基金收入	2,806,936,273
基金支出	498,267,518
現金增〈減〉數	2,308,668,755

註：本表採現金基礎。