

# 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 4 月底

收益率
3.0998%

## 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 4 月底止基金規模與收益		
基金運用規模		2,019 億 6,576 萬元
104 年截至 4 月底止 運用總損益及評價後報酬率	自行運用	28 億 9,057 萬元 1.75%
	委託經營	10 億 7,373 萬元 4.78%
	合計	39 億 6,430 萬元 2.11%

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 4 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>178,419,139,748</b>	<b>88.34</b>
轉存金融機構	40,606,261,996	20.10
短期貸款	1,121,049,981	0.56
短期票券	3,420,674,985	1.69
公債、公司債及金融債券	16,799,170,457	8.32
貨幣型基金	0	0.00
股票及受益憑證投資(含期貨)	44,272,695,702	21.92
國外投資	72,199,286,627	35.75
固定收益	54,925,715,641	27.20
權益證券	16,360,981,895	8.10
另類投資	912,589,091	0.45
<b>委託經營</b>	<b>23,546,620,396</b>	<b>11.66</b>
國內委託經營	23,546,620,396	11.66
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>201,965,760,144</b>	<b>100.00</b>

### (三)基金自營投資與委外投資比例

截至 104 年 4 月底

單位：新台幣元

項 目	金 額	占基金運用比例 (%)
自行運用	178,419,139,748	88.34
委託經營	23,546,620,396	11.66

### (四)基金國內投資與國外投資比例

截至 104 年 4 月底

單位：新台幣元

項 目	金 額	占基金運用比例 (%)
國內投資	129,766,473,517	64.25
國外投資	72,199,286,627	35.75

### 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 4 月底

項 目	收益率(%)
國內權益證券	6.08

#### (二)基金自營股票及受益憑證投資比例概況

截至 104 年 4 月底

單位：新台幣元

項 目	金 額	比例(%)
國內權益證券	44,272,695,702	21.92

#### 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 4月累積投 資報酬(%)	委任迄今(102.5.15~104.4.30)		
				投資報酬率 (%)	排名	大盤報酬率 (%)
統一	4,000,000,000	4,880,896,839	4.61	22.02	2	19.00
滙豐 中華	4,000,000,000	4,475,461,011	1.86	11.89	5	
國泰	4,000,000,000	4,616,777,171	4.29	15.42	4	
永豐	4,000,000,000	4,891,139,256	7.21	22.28	1	
摩根	4,000,000,000	4,682,346,119	5.83	17.06	3	
合計	20,000,000,000	23,546,620,396	4.78	17.73	-	

##### (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）

截至 104 年 4 月底

(一)避險：

種類	避險比例
權益證券避險	0%
匯率避險	36.20%

(二)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4月	1,599,646,173	1,765,466,239	165,820,066

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4月份

單位：新台幣元

項 目	金 額
基金收入	20,798,942,459
基金支出	19,204,293,642
現金增〈減〉數	1,594,648,817

註：本表採現金基礎。