

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 5 月底

收益率
2.5835%

*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 5 月底止基金規模與收益		
基金運用規模		1,804 億 2,124 萬元
103 年截至 5 月底止 運用總損益及評價後報酬率	自行運用	41 億 5,921 萬元 2.80%
	委託經營	10 億 2,377 萬元 4.24%
	合計	51 億 8,292 萬元 3.00%

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 5 月底

單位：新台幣元

項 目	餘 額	占基金運用比例(%)
自行運用	158,542,690,072	87.87%
轉存金融機構	46,417,126,849	25.73%
短期票券	449,133,759	0.25%
公債、公司債及金融債券	11,799,550,230	6.54%
貨幣型基金	0	0.00%
股票及受益憑證投資(含期貨)	41,150,329,128	22.81%
國外投資	58,726,550,106	32.55%
固定收益	52,559,481,103	29.13%
權益證券	6,167,069,003	3.42%
另類投資	0	0.00%
委託經營	21,878,545,041	12.13%
國內委託經營	21,878,545,041	12.13%
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%
合 計	180,421,235,113	100.00%

2. 基金自營投資與委外投資比例

截至 103 年 5 月底

單位：新台幣元

項 目	金 額	占基金運用比例 (%)
自行運用	158,542,690,072	87.87
委託經營	21,878,545,041	12.13

3. 基金國內投資與國外投資比例

截至 103 年 5 月底

單位：新台幣元

項 目	金 額	占基金運用比例 (%)
國內投資	121,694,685,007	67.45
國外投資	58,726,550,106	32.55

*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 5 月底

項 目	收 益 率（%）
國內權益證券	5.50

2. 基金自營股票及受益憑證投資比例概況

截至 103 年 5 月底

單位：新台幣元

項 目	金 額	比 例（%）
國內權益證券	41,150,329,128	22.81

*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 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 5 月 累積投資報酬 (%)	委任迄今(102.5.15~103.5.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	大盤報酬率 (%)
統一	4,000,000,000	4,644,057,928	8.65	16.10	1	9.99
滙豐中華	4,000,000,000	4,259,647,360	3.82	6.49	4	
國泰	4,000,000,000	4,241,008,603	2.38	6.03	5	
永豐	4,000,000,000	4,458,392,401	3.93	11.46	2	
摩根	4,000,000,000	4,275,438,749	2.65	6.89	3	
合計	20,000,000,000	21,878,545,041	4.31	9.39	-	

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

勞工保險基金自營部位

(依交易目的分)

103年5月31日

一、避險：

種類	避險比例
權益證券避險	0%
匯率避險	43.49%

二、投資：無

*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5月	1,992,525,851	2,047,319,293	54,793,442

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5月份

單位：新台幣元

項 目	金 額
基金收入	16,345,050,703
基金支出	17,084,771,740
現金增〈減〉數	(739,721,037)

註：本表採現金基礎。