

全国社会保障基金理事会 社保基金年度报告

(2019年度)

一、社保基金会概况

(一) 社保基金会简介

1. 法定中文名称: 全国社会保障基金理事会(简称: 社保基金会), 法定英文名称: National Council for Social Security Fund, PRC(缩写: SSF)。

2. 法定代表人: 刘伟。

3. 成立时间: 2000年8月。

4. 注册及办公地址: 北京市西城区丰汇园11号楼丰汇时代大厦南座, 网址: www.ssf.gov.cn。

(二) 社保基金会的职责

社保基金会贯彻落实党中央关于全国社会保障基金投资运营工作的方针政策和决策部署, 在履行职责过程中坚持和加强党对全国社会保障基金投资运营工作的集中统一领导。主要职责是:

1. 管理运营全国社会保障基金。

2. 受国务院委托集中持有管理划转的中央企业国有股权, 单独核算, 接受考核和监督。

3. 经国务院批准, 受托管理基本养老保险基金投资运营。

4. 根据国务院批准的范围和比例, 直接投资运营或选择并委托专业机构运营管理。定期向有关部门报告投资运营情况, 提交财务会计报告, 接受有关部门监督。

5. 定期向社会公布基金收支、管理和投资运营情况。

6. 根据有关部门下达的指令和确定的方式拨出资金。

7. 完成党中央、国务院交办的其他任务。

8. 作为投资运营机构, 履行好基金安全和保值增值的主体责任。

(三) 社保基金会的组织架构

根据中共中央和国务院批准的《全国社会保障基金理事会职能配置、内设机构和人员编制规定》和《全国社会保障基金理事会章程》, 社保基金会在借鉴国际养老金管理机构经验的基础上设置组织架构。

理事会由理事长、副理事长、理事组成, 是社保基金会的最高权力机构, 主要负责基金的重大战略决策和社保基金会的重大事宜决策。理事长、副理事长由国务院任命, 理事由国务院聘任。理事长是社保基金会的法定代表人。

社保基金会现设综合部、规划研究部、基金财务部、证券投资部、境外投资部、股权资产部(实业投资部)、法规及监管部、风险管理部、养老金管理部、养老金会计部、信息技术部、机关党委(人事部)和机关服务中心等职能部门。

社保基金会设立四个非常设机构, 即投资决策委员会、风险管理委员会、内部控制委员会和专家评审委员会。

投资决策委员会为社保基金会投资决策机构, 主要审议战略和年度资产配置计划, 审定风险政策与风险预算, 审定重大投资决策事项。

风险管理委员会为社保基金会风险管理的专门议事机构, 主要审议风险管理制度、风险政策、重大投资和重大风险的评判标准, 审议资产配置和重大投资的执行及效果评价等事项。

内部控制委员会为社保基金会内部控制的决策机构, 主要审议内部控制基本制度、基础性业务制度、专项制度等规范性文件, 社保基金会内部控制重大事项部署安排和内控年度工作计划等决定, 内部控制风险事件定责追责决策等事项。

专家评审委员会为社保基金会应聘委托投资管理人或托管人

四、社保基金会计报表及报表附注

(一) 会计报表

1. 社保基金资产负债表(会社基01表)

2. 社保基金收益表(会社基02表)

3. 社保基金权益变动表(会社基01表附表)

社保基金资产负债表

2019年12月31日

编制单位: 全国社会保障基金理事会

项 目 2018年12月31日 2019年12月31日

资产	2019年12月31日	
	2018年12月31日	2019年12月31日
银行存款	26,152,947,242.47	29,672,996,042.18
结算备付金	8,826,017,272.98	4,712,194,503.87
存出保证金	350,428,739.04	515,018,027.21
交易类金融资产	874,093,170,785.74	1,159,491,738,513.54
融券回购	38,122,232,360.08	23,849,621,070.04
应收证券清算款	4,039,615,195.45	8,650,986,591.01
应收利息	23,646,771,694.58	30,094,824,732.94
应收股利	142,267,104.40	143,668,878.60
应收退税款	92,114,582.81	134,204,402.02
可供出售金融资产	239,409,174,221.57	253,062,961,661.51
持有至到期投资	833,701,914,242.28	936,591,204,947.70
长期股权投资	181,748,259,837.87	181,628,217,356.27
其他资产	62,365,798.89	28,764,052.25
资产总计	2,235,387,279,068.11	2,628,566,390,779.14
负债:		
应付证券清算款	4,791,160,406.23	13,215,802,002.71
交易类金融负债	512,567,859.86	167,457,132.11
融券回购	162,840,221,452.28	182,599,251,452.28
应付交易费用	91,063,487.73	192,616,686.18
应付管理人报酬	1,063,600,065.25	1,417,433,851.89
应付托管费	458,387,054.43	432,676,033.98
应交税费	-	-
应付利息	158,712,941.18	76,530,557.84
应付款项	7,763,877,644.14	7,880,335,707.30
其他负债	342,199,525.62	34,373,343.25
负债合计	178,022,170,071.26	206,006,476,859.52
基金权益:		
全国社保基金	1,766,203,616,302.92	2,062,299,919,963.14
个人账户基金	132,133,222,040.10	157,137,401,550.69
地方委托资金	114,767,824,619.35	127,771,824,619.35
基金公积	46,644,488,734.90	65,165,366,143.60
报表折算差额	7,615,957,358.08	10,185,411,642.84
基金权益合计	2,057,365,109,055.35	2,422,559,913,919.62
负债和基金权益总计	2,235,387,279,068.11	2,628,566,390,779.14

社保基金收益表

2019年度

编制单位: 全国社会保障基金理事会

项 目 本年数

2018年12月31日

单位: 人民币元

一、收入

利息收入

证券差价收入

股利收入

信托投资收益

衍生金融工具收益

长期股权投资收益

股权投资基金收益

交易类金融资产公允价值变动收益

退票收入

其他收入

二、费用

管理人报酬

托管费

交易费用

利息支出

汇兑损失

资产减值损失

其他费用

三、净收益

其中: 已实现收益

交易类资产公允价值变动收益

社保基金权益变动表

2019年度 会社基01表附表

编制单位: 全国社会保障基金理事会

项 目 本年数

上年数

2018年12月31日

单位: 人民币元

一、基金权益上期期末余额

二、权益法下按投资单位会改变政策而调整

三、基金权益本期期初余额

其中: 全国社保基金期初余额

个人账户基金期初余额

地方委托资金期初余额

基金公积期初余额

报表折算差额期初余额

其他调整

四、基金收入, 投出产生的基金权益变动额

基金收入

基金收入