

勞工保險基金運用情形

一、勞工保險基金 84 年度迄今整體績效

截至 104 年 11 月底

收益率
3.5302%

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 11 月底止基金規模與收益		
基金運用規模		6,591 億 1,393 萬元
104 年截至 11 月底止 運用總損益及評價後報酬率	自行運用	-7 億 2,946 萬元 -0.15%
	委託經營	-5 億 7,027 萬元 -0.37%
	合計	-12 億 9,973 萬元 -0.20%

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 11 月底

單位：新台幣元

項 目	餘 額	占基金運用比例(%)
自行運用	491,156,265,753	74.52
轉存金融機構	132,382,524,185	20.08
短期票券	12,046,550,147	1.83
公債、公司債、金融債券及證券化商品	67,479,219,946	10.24
房屋及土地	1,790,125,774	0.27
政府或公營事業貸款	2,020,000,000	0.31
被保險人貸款	31,388,260,371	4.76
股票及受益憑證投資(含期貨)	115,028,355,279	17.45
國外投資	129,021,230,051	19.58
固定收益	80,610,040,341	12.23
權益證券	43,657,580,326	6.63
另類投資	4,753,609,384	0.72
委託經營	167,957,663,297	25.48
國內委託經營	34,852,279,904	5.29
國外委託經營	133,105,383,393	20.19
固定收益	52,384,343,577	7.95
權益證券	67,243,163,754	10.20
另類投資	13,477,876,062	2.04
合 計	659,113,929,050	100.00

(三)基金自營投資與委外投資比例

截至 104 年 11 月底

單位：新台幣元

項 目	金 額	占基金運用比例 (%)
自行運用	491,156,265,753	74.52
委託經營	167,957,663,297	25.48

(四)基金國內投資與國外投資比例

截至 104 年 11 月底

單位：新台幣元

項 目	金 額	占基金運用比例 (%)
國內投資	396,987,315,606	60.23
國外投資	262,126,613,444	39.77

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 11 月底

項 目	收益率 (%)
國內權益證券	-6.61

(二)基金自營股票及受益憑證投資比例概況

截至 104 年 11 月底

單位：新台幣元

項 目	金 額	比例 (%)
國內權益證券	115,028,355,279	17.45

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

勞工保險基金 104 年度續約

單位：新台幣元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	104 年截至 11 月 累積投資報酬(%)	委任迄今(104. 7. 2~104. 11. 30)		
				投資報酬率 (%)	排名	大盤報酬率(%)
野村	8,090,151,656	7,617,609,626	-5.84	-5.84	1	-11.25
永豐	5,620,805,395	5,216,259,936	-7.20	-7.20	2	
合計	13,710,957,051	12,833,869,562	-6.40	-6.40	—	

勞工保險基金 102 年度續約(國泰)

單位：新台幣元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	104 年截至 11 月 累積投資報酬(%)	委任迄今(102. 8. 15~104. 11. 30)		
				投資報酬率 (%)	排名	大盤報酬率(%)
國泰	5,013,118,929	5,717,430,420	-0.61	14.05	—	4.64

勞工保險基金 102 年度續約(統一)

單位：新台幣元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	104 年截至 11 月 累積投資報酬(%)	委任迄今(102. 9. 16~104. 11. 30)		
				投資報酬率 (%)	排名	大盤報酬率(%)
統一	4,000,000,000	4,411,654,346	-8.95	10.29	—	2.19

勞工保險基金 102 年度續約(國泰 A)

單位：新台幣元

投信 名稱	委託金額	目前淨資產	104 年截至 11 月 累積投資報酬(%)	委任迄今(102.11.29~104.11.30)		
				投資報酬率 (%)	排名	大盤報酬率(%)
國泰(A)	4,000,000,000	4,420,296,315	-1.07	10.51	—	-0.50

勞工保險基金 103 年度續約

單位：新台幣元

投信 名稱	委託金額	目前淨資產	104 年截至 11 月 累積投資報酬(%)	委任迄今(103.9.30~104.11.30)		
				投資報酬率 (%)	排名	大盤報酬率(%)
國泰	2,980,000,000	2,989,399,914	-0.92	0.32	—	-7.14

勞工保險基金 104 年度續約

單位：新台幣元

投信 名稱	委託金額	目前淨資產	104 年截至 11 月 累積投資報酬(%)	委任迄今(104.3.30~104.11.30)		
				投資報酬率 (%)	排名	大盤報酬率(%)
統一	5,106,824,840	4,479,629,347	-12.28	-12.28	—	-12.45

(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. 受託機構經營本基金帳戶被主管機關懲處之相關資訊：無

五、基金國外委外投資概況表

(一)基金國外委外投績效、績效指標及排名表

94 年全球股票型(續約 2)

單位：美元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	104 年截至 11 月 累積投資報酬率 (%)	委任迄今 (103.11.3~104.11.30)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
威靈頓	300,000,000	326,401,417	6.21	8.80	—	1.26

96 年全球新興市場股票型(續約)

單位：美元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	104 年截至 11 月 累積投資報酬率 (%)	委任迄今 (101.10.1 ~104.11.30)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
瑞萬通博	309,910,147	300,083,911	-6.12	-3.17	—	-13.89

100 年全球股票型

單位：美元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	104 年截至 11 月 累積投資報酬率 (%)	委任迄今 (100.11.1、12.1、 101.1.3 註 ~104.11.30)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
MFS	400,000,000	579,757,888	3.47	82.43	1	51.48
貝萊德	200,000,000	294,937,357	-0.89	47.47	2	55.27
Amundi	100,000,000	184,122,362	3.95	44.69	3	54.90
合計	700,000,000	1,058,817,608	2.30	59.33	—	—

註：其中 MFS 委託日為 100 年 11 月 1 日，BlackRock 之委託日為 100 年 12 月 1 日，Amundi 之委託日為 101 年 1 月 3 日。本批次委任迄今之合計投資報酬率採時間加權計算。另 Amundi 於 103 年 7 月 16 日收回 1 億美元，並於同日增額撥款 1 億美元至 MFS。另 MFS 於 103 年 11 月 3 日再獲加碼 1 億美元。

101 年全球新興市場債券型

單位：美元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	104 年截至 11 月 累積投資報酬率 (%)	委任迄今 (101.10.1、11.1 註 ~104.11.30)		
				投資報 酬率(%)	排 名	指標報酬率 (%)
實港	150,000,000	106,531,219	-15.14	-28.98	3	-23.45
博祿貝	150,000,000	109,237,804	-16.51	-27.17	2	-23.29
坦伯頓	150,000,000	129,413,127	-6.14	-13.72	1	
合計	450,000,000	345,182,150	-12.45	-23.78	—	—

註：其中 Stone Harbor 之委託日為 101 年 10 月 1 日，Bluebay 與 Templeton 之委託日均為 101 年 11 月 1 日。本梯次委任迄今之合計投資報酬率採時間加權計算。

104 年全球債券型(續約)

單位：美元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	104 年截至 11 月 累積投資報酬率 (%)	委任迄今 (104.2.2~104.11.30)		
				投資報 酬率(%)	排名	指標報酬率 (%)
Standish Mellon	232,680,166	222,326,130	-4.45	-4.45	4	-3.51
威靈頓	228,104,878	220,239,410	-3.45	-3.45	1	
太平洋	462,694,069	446,552,080	-3.49	-3.49	2	
聯博	220,415,963	211,313,573	-4.13	-4.13	3	
合計	1,143,895,066	1,100,431,193	-3.80	-3.80	—	

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 11 月 累積投資報酬率 (%)	委任迄今 (104.08.11 ~104.11.30)		
				投資報 酬率(%)	排名	指標報酬率 (%)
北美信託	120,000,000	121,097,607	-0.42	-0.42	1	-0.63
LGIM	120,000,000	120,889,736	-0.66	-0.66	3	
Geode	120,000,000	120,932,803	-0.54	-0.54	2	
合計	360,000,000	362,920,146	-0.54	-0.54	—	—

104-2 年全球不動產股票型

單位：美元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	104 年截至 11 月 累積投資報酬率 (%)	委任迄今 (104.09.25~104.11.30)		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率(%)
信安環球	100,000,000	104,284,337	4.28	4.28	1	4.25
CBRE	100,000,000	103,784,241	3.78	3.78	2	
合計	200,000,000	208,068,579	4.03	4.03	—	—

104-2 年全球基礎建設股票型

單位：美元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	104 年截至 11 月 累積投資報酬率 (%)	委任迄今 (104.09.25~104.11.30)		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率(%)
Cohen & Steers	50,000,000	49,899,341	-0.20	-0.20	4	1.27
麥格理	50,000,000	50,432,791	0.87	0.87	3	
Magellan	50,000,000	51,585,483	3.17	3.17	1	
RREEF	50,000,000	50,549,172	1.10	1.10	2	
合計	200,000,000	202,466,787	1.23	1.23	—	—

104-1 全球主權信用增值債券型

單位：美元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	104 年截至 11 月 累積投資報酬率 (%)	委任迄今 (104.11.13~104.11.30)		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率(%)
NNIP	50,000,000	49,929,304	-0.14	-0.14	2	-0.28
布蘭迪	50,000,000	50,174,878	0.35	0.35	1	
盧米斯	50,000,000	49,904,337	-0.19	-0.19	3	
合計	150,000,000	150,008,519	0.01	0.01	—	—

(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

勞工保險基金自營部位

(依交易目的分)

104年11月30日

(一) 避險：

種類	避險比例
權益證券避險	0%
匯率避險	21%

(二) 投資：無

七、勞工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11月	-5,255,717,532	1,864,662,108	7,120,379,640

註：上述金額係依權責基礎填列。

八、勞工保險基金投資運用現金收支表

104年11月份

單位：新台幣元

項 目	金 額
基金收入	70,157,598,995
基金支出	66,611,308,085
現金增(減)數	3,546,290,910

註：本表係採現金基礎。