

*勞工保險基金整體績效

勞保基金自 84 年迄今整體績效

單位：新台幣元

項目	收益數	收益率	夏普指標 (SHARPE ratio)	期末基金規模
84 年度 (83. 7. 1~84. 6. 30)	8, 229, 101, 233	7. 78%		108, 921, 325, 013
85 年度 (84. 7. 1~85. 6. 30)	9, 506, 878, 126	6. 80%		170, 650, 127, 413
86 年度 (85. 7. 1~86. 6. 30)	13, 352, 331, 261	6. 46%		242, 670, 162, 969
87 年度 (86. 7. 1~87. 6. 30)	15, 949, 482, 055	5. 69%		311, 968, 584, 465
88 年度 (87. 7. 1~88. 6. 30)	24, 806, 535, 950	7. 07%		379, 779, 022, 523
89 年度 (88. 7. 1~89. 12. 31)	5, 648, 966, 329	0. 92%		479, 515, 104, 997
90 年度 (90. 1. 1~90. 12. 31)	16, 970, 795, 190	3. 37%		520, 866, 510, 717
91 年度 (91. 1. 1~91. 12. 31)	5, 769, 527, 216	1. 15%		497, 190, 795, 366
92 年度 (92. 1. 1~92. 12. 31)	27, 208, 218, 842	5. 86%		461, 850, 814, 792
93 年度 (93. 1. 1~93. 12. 31)	14, 416, 621, 069	3. 12%		459, 723, 505, 938
94 年度 (94. 1. 1~94. 12. 31)	16, 661, 377, 316	3. 79%		427, 946, 867, 910
95 年度 (95. 1. 1~95. 12. 31)	33, 346, 441, 249	7. 91%		436, 307, 649, 894
96 年度 (96. 1. 1~96. 12. 31)	24, 175, 937, 474	5. 78%		427, 039, 748, 305
97 年度 (97. 1. 1~97. 12. 31)	-54, 850, 562, 601	-16. 53%		214, 447, 226, 617
98 年度 (98. 1. 1~98. 12. 31)	43, 263, 333, 084	18. 21%	0. 67	296, 607, 797, 498
99 年度 (99. 1. 1~99. 12. 31)	13, 021, 611, 407	3. 96%	0. 14	376, 717, 475, 852

100 年度 (100.1.1~100.12.31)	-12,447,814,337	-2.97%	-0.17	451,985,984,518
101 年度 (101.1.1~101.12.31)	31,303,980,748	6.25%	0.37	484,531,774,943
102 年度 (102.1.1~102.12.31)	30,444,525,122	6.35%	0.47	527,988,810,549
算術平均收益率		4.26%		
幾何平均收益率		4.06%		
103 年度 (103.1.1~103.1.31)	-3,630,561,619	-0.70%	0.29	534,017,158,951
合計收益數	263,146,725,114			

- 註：1. 夏普指標(SHARPE ratio)自 98 年度開始，不滿 1 年者，即往前取 12 個月資料計算。
2. 夏普指標(SHARPE ratio)用以衡量每單位總風險（以月化標準差衡量）所得之超額報酬，無風險月利率採用台銀每月 15 日公佈之一年期定存大額固定利率/12。

*基金運用概況表

1. 基金規模與投資績效

截至 103 年 1 月底

單位：新台幣元

投資項目	金額	%
壹、國內業務	322,780,703,328	60.44
一、約當現金	102,292,756,770	19.16
(一)銀行存款	94,252,920,000	17.65
1. 活期存款	3,918,920,000	0.73
2. 定期存款	90,334,000,000	16.92
(二)短期票券	8,039,836,770	1.51
二、權益證券	138,291,771,803	25.90
(一)自行操作	103,787,584,106	19.44
(二)委託經營	34,504,187,697	6.46
三、債務證券	35,487,282,850	6.64
(一)政府公債	0	0.00
(二)公司債	9,500,000,000	1.78
(三)金融債券	25,800,000,000	4.83
(四)金融資產證券化商品	187,282,850	0.03
(五)債券型基金	0	0.00
四、房屋及土地	1,821,948,054	0.34
五、政府或公營事業貸款	2,890,000,000	0.54
(一)經建貸款	0	0.00
(二)農保借款	2,890,000,000	0.54
六、被保險人貸款	41,996,943,851	7.86
貳、國外業務	211,236,455,623	39.56
一、約當現金	24,274,423,293	4.55
(一)外幣存款	24,274,423,293	4.55
(二)貨幣型基金	0	0.00
二、權益證券	76,232,280,518	14.28
(一)自行操作(境外基金)	29,468,663,976	5.52
(二)委託經營	46,763,616,542	8.76
三、債務證券	108,998,927,334	20.41

(一)自行操作	58,640,977,621	10.98
1. 國外有價證券	31,294,444,482	5.86
2. 債券型基金	27,346,533,139	5.12
(二)委託經營	50,357,949,713	9.43
四、另類投資	1,730,824,478	0.32
合計	534,017,158,951	100.00
年度累計收益數	-3,630,561,619	
年度累計收益率		-0.70

2. 基金自營投資與委外投資比例

截至 103 年 1 月底止

單位：新台幣元

項 目	金 額	占基金運用比例 (%)
自行運用	402,391,404,999	75.35
委託經營	131,625,753,952	24.65

3. 基金國內投資與國外投資比例

截至 103 年 1 月底止

單位：新台幣元

項 目	金 額	占基金運用比例 (%)
國內投資	322,780,703,328	60.44
國外投資	211,236,455,623	39.56

*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 1 月底止

單位：%

項 目	收益率 (%)
國內權益證券	-1.88

2. 基金自營股票及受益憑證投資比例概況

截至 103 年 1 月底止

單位：新台幣元

項 目	金 額	比例 (%)
國內權益證券	103,787,584,106	19.44

*基金國內委外投資概況表

1. 基金國內委外投績效、績效指標及排名表

截至 103 年 1 月底止

勞工保險基金 101 年度續約

單位：新台幣元；%

投信名稱	委託金額	目前淨資產	103 年截至 1 月累積投資報酬(%)	委任迄今(101.7.2~103.1.31)			
				投資報酬率(%)	排名	大盤報酬率(%)	指標報酬率(%)
安泰	6,000,000,000	6,726,566,349	-1.52	12.11	2	15.21	11.10
永豐	4,000,000,000	4,934,438,819	-1.60	23.36	1		
合計	10,000,000,000	11,661,005,168	-1.55	16.61	-		

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	103 年截至 1 月累積投資報酬(%)	委任迄今(102.8.15~103.1.31)			
				投資報酬率(%)	排名	大盤報酬率(%)	指標報酬率(%)
國泰	5,013,118,929	5,176,747,767	-1.60	3.26	1	7.08	3.00
合計	5,013,118,929	5,176,747,767	-1.60	3.26	-		

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	103 年截至 1 月累積投資報酬(%)	委任迄今(102.9.16~103.1.31)			
				投資報酬率(%)	排名	大盤報酬率(%)	指標報酬率(%)
統一	4,000,000,000	4,241,993,260	-1.84	6.05	1	3.33	2.43
合計	4,000,000,000	4,241,993,260	-1.84	6.05	-		

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	103 年截至 1 月累積投資報酬(%)	委任迄今(102.11.29~103.1.31)			
				投資報酬率(%)	排名	大盤報酬率(%)	指標報酬率(%)
國泰(A)	4,000,000,000	4,008,592,014	-1.76	0.21	1	1.06	1.12
合計	4,000,000,000	4,008,592,014	-1.76	0.21	-		

勞工保險基金第六梯次第二次加碼

單位：新台幣元；%

投信名稱	委託金額	目前淨資產	103 年截至 1 月累積投資報酬(%)	委任迄今(100.9.30~103.1.31)			
				投資報酬率(%)	排名	大盤報酬率(%)	指標報酬率(%)
國泰(B)	4,000,000,000	4,892,774,580	-1.60	22.32	1	17.18	16.40
合計	4,000,000,000	4,892,774,580	-1.60	22.32	-		

勞工保險基金第六梯次第三次加碼

單位：新台幣元；%

投信名稱	委託金額	目前淨資產	103 年截至 1 月累積投資報酬(%)	委任迄今(101.3.29~103.1.31)			
				投資報酬率(%)	排名	大盤報酬率(%)	指標報酬率(%)
統一(A)	4,000,000,000	4,523,074,908	-1.64	13.08	1	5.81	12.93
合計	4,000,000,000	4,523,074,908	-1.64	13.08	-		

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

*基金國外委外投資概況表

1. 基金國外委外投績效、績效指標及排名表

截至 103 年 1 月底止

98 年全球債券型續約 (原稱「第一梯次續約 全球債券型委託」) 單位：美元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	103 年截至 1 月累積投資報酬率(%)	委任迄今 (98.11.1~103.1.31)		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率(%)
PIMCO	100,000,000	118,331,547	0.73	18.33	1	9.87
Alliance Bernstein	100,000,000	115,084,542	1.26	15.08	2	9.87
合計	200,000,000	233,416,089	0.99	16.71	-	9.87

98 年全球股票型續約 (原稱「第一梯次續約 全球股票型委託」) 單位：美元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	103 年截至 1 月累積投資報酬率(%)	委任迄今 (98.11.1~103.1.31)		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率(%)
Wellington	150,000,000	273,180,935	-3.66	82.12	-	58.04

98 年全球股票型續約 加碼 (原稱「第一梯次續約加碼 全球股票型委託」)

單位：美元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	103 年截至 1 月累積投資報酬率(%)	委任迄今 (99.7.1~103.1.31)		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率(%)
Wellington (II)	79,276,014	147,786,444	-3.67	86.42	-	65.43

98 年全球債券型續約 加碼 (原稱「第一梯次續約加碼 全球債券型委託」)

單位：美元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	103 年截至 1 月累積投資報酬率(%)	委任迄今 (100.2.1~103.1.31)		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率(%)
Alliance Bernstein (II)	100,000,000	106,972,488	1.25	6.97	-	5.31

99 年全球債券型 (原稱「第三梯次國外委託經營」)

單位：美元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	103 年截至 1 月累積投資報酬率(%)	委任迄今 (99.2.1~103.1.31)		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率(%)
Standish Mellon	200,000,000	232,221,356	0.50	16.11	2	14.02
Wellington	200,000,000	229,764,164	1.04	14.88	3	14.02
PIMCO	200,000,000	242,882,101	0.63	21.44	1	14.02
合計	600,000,000	704,867,621	0.72	17.48	-	-

99 年全球債券型 加碼 (原稱「第三梯次加碼」)

單位：美元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	103 年截至 1 月累積投資報酬率(%)	委任迄今 (101.1.1~103.1.31)		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率(%)
PIMCO	200,000,000	210,304,276	0.74	5.15	-	2.68

100 年全球股票型 (原稱「第四梯次國外委託經營」)

單位：美元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	103 年截至 1 月累積投資報酬率(%)	委任迄今 (100.11.1、12.1、 101.1.3 註 ~103.1.31)		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率(%)
MFS	200,000,000	310,208,635	-4.54	55.10	1	37.76
BlackRock	200,000,000	276,496,606	-4.72	38.25	2	41.21
Amundi	200,000,000	255,870,451	-3.89	27.94	3	40.88
合計	600,000,000	842,575,692	-4.40	40.43	-	-

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。

101 年全球新興市場債券型 (原稱「101 年度國外委託經營」)

單位：美元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	103 年截至 1 月累積投資報酬率(%)	委任迄今 (101.10.1、11.1 註 ~103.1.31)		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率(%)
Stone Harbor	150,000,000	130,858,230	-4.79	-12.76	3	-8.72
BlueBay	150,000,000	135,700,232	-4.79	-9.53	1	-8.53
Templeton	150,000,000	135,681,270	-3.73	-9.55	2	-8.53
合計	450,000,000	402,239,732	-4.44	-10.61	-	-

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。

101 年全球新興市場股票型續約 (原稱「101 年度續約國外委託經營」) 單位：美元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	103 年截至 1 月累積投資報酬率(%)	委任迄今 (101.10.1 ~103.1.31)		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率(%)
Vontobel	309,910,147	275,949,178	-6.69	-10.96	-	-6.94

2.103 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

*基金投資衍生性金融商品概況表

勞保基金自營部位

(依交易目的分)

103年1月31日

一、避險：

種類	避險比例
權益證券避險	0.15%
匯率避險	29.05%

二、投資：無