

勞工保險基金運用情形

*勞工保險基金 84 年度迄今整體績效

截至 103 年 5 月底

收益率
3.6647%

*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		5,716 億 9,219 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	107 億 8,535 萬元 2.71%
	委託經營	60 億 6,534 萬元 4.54%
	合計	168 億 5,069 萬元 3.17%

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	431,891,429,704	75.55
轉存金融機構	96,940,803,756	16.96
短期票券	30,220,164,326	5.28
公債、公司債、金融債券及證券化商品	38,523,510,730	6.73
房屋及土地	1,816,159,818	0.32
政府或公營事業貸款	2,220,000,000	0.39
被保險人貸款	38,838,288,508	6.79
股票及受益憑證投資 (含期貨)	108,626,898,333	19.01
國外投資	114,705,604,233	20.07
固定收益	75,694,999,753	13.25
權益證券	37,290,257,007	6.52
另類投資	1,720,347,473	0.30
委託經營	139,800,763,671	24.45
國內委託經營	37,542,532,431	6.56
國外委託經營	102,258,231,240	17.89
固定收益	52,193,087,357	9.13
權益證券	50,065,143,883	8.76
另類投資	0	0.00
合 計	571,692,193,375	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	431,891,429,704	75.55
委託經營	139,800,763,671	24.45

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	354,728,357,902	62.05
國外投資	216,963,835,473	37.95

*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	5.11

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	108,626,898,333	19.01

*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

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 5 月累 積投資報酬(%)	委任迄今(101.7.2~103.5.31)		
				投資報酬 率(%)	排名	大盤報酬率(%)
安泰	6,000,000,000	7,369,351,704	7.89	22.82	2	24.39
永豐	4,000,000,000	5,162,320,283	2.95	29.06	1	
合計	10,000,000,000	12,531,671,987	5.80	25.32	—	

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 5 月累 積投資報酬(%)	委任迄今(102.8.15~103.5.31)		
				投資報酬 率(%)	排名	大盤報酬率(%)
國泰	5,013,118,929	5,612,346,480	6.69	11.95	—	14.14

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 5 月累 積投資報酬(%)	委任迄今(102.9.16~103.5.31)		
				投資報酬 率(%)	排名	大盤報酬率(%)
統一	4,000,000,000	4,721,891,029	9.26	18.05	—	11.46

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 5 月累 積投資報酬(%)	委任迄今(102.11.29~103.5.31)		
				投資報酬 率(%)	排名	大盤報酬率(%)
國泰(A)	4,000,000,000	4,357,738,000	6.79	8.94	—	8.53

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 5 月累 積投資報酬(%)	委任迄今(100.9.30~103.5.31)		
				投資報酬 率(%)	排名	大盤報酬率(%)
國泰(B)	4,000,000,000	5,306,017,725	6.71	32.65	—	26.36

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 5 月累 積投資報酬(%)	委任迄今(101.3.29~103.5.31)		
				投資報酬 率(%)	排名	大盤報酬率(%)
統一(A)	4,000,000,000	5,012,867,210	9.01	25.32	—	12.91

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

98 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	103年截至5月累積投資報酬率 (%)	委任迄今 (98.11.1~103.5.31)		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率 (%)
太平洋	100,000,000	121,286,751	3.25	21.29	1	12.72
聯博	100,000,000	118,095,393	3.91	18.10	2	
合計	200,000,000	239,382,144	3.57	19.69	-	

98 年全球股票型續約

單位：美元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	103年截至5月累積投資報酬率 (%)	委任迄今 (98.11.1~103.5.31)		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率 (%)
威靈頓	150,000,000	287,989,440	1.56	91.99	-	71.20

98 年全球股票型續約 加碼

單位：美元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	103年截至5月累積投資報酬率 (%)	委任迄今 (99.7.1~103.5.31)		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率 (%)
威靈頓	79,276,014	155,764,705	1.54	96.48	-	79.21

98 年全球債券型續約 加碼

單位：美元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	103年截至5月累積投資報酬率 (%)	委任迄今 (100.2.1~103.5.31)		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率 (%)
聯博	100,000,000	109,757,696	3.89	9.76	-	8.04

99 年全球債券型

單位：美元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	103年截至5月累 積投資報酬率 (%)	委任迄今 (99.2.1~103.5.31)		
				投資報 酬率(%)	排名	指標報酬率 (%)
Standish Mellon	200,000,000	240,325,464	4.01	20.16	2	17.54
威靈頓	200,000,000	236,302,613	3.91	18.15	3	
太平洋	200,000,000	252,268,713	4.52	26.13	1	
合計	600,000,000	728,896,789	4.16	21.48	-	

99 年全球債券型 加碼

單位：美元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	103年截至5月累 積投資報酬率 (%)	委任迄今 (101.1.1~103.5.31)		
				投資報 酬率(%)	排名	指標報酬率 (%)
太平洋	200,000,000	218,489,838	4.66	9.24	-	5.85

100 年全球股票型

單位：美元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	103年截至5月累 積投資報酬率 (%)	委任迄今 (100.11.1、12.1、 101.1.3註 ~103.5.31)		
				投資報 酬率(%)	排名	指標報酬率 (%)
MFS	200,000,000	338,684,244	4.22	69.34	1	49.23
貝萊德	200,000,000	293,360,616	1.09	46.68	2	52.97
Amundi	200,000,000	273,488,525	2.73	36.74	3	52.60
合計	600,000,000	905,533,385	2.74	51.19	-	-

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。本梯次委任迄今之合計投資報酬率採時間加權計算。

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	103年截至5月累積投資報酬率 (%)	委任迄今 (101.10.1、11.1註 ~103.5.31)		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率 (%)
實港	150,000,000	143,724,268	4.58	-4.18	3	0.38
博祿貝	150,000,000	148,435,863	4.14	-1.04	1	0.59
坦伯頓	150,000,000	148,167,573	5.13	-1.22	2	
合計	450,000,000	440,327,705	4.61	-2.77	-	-

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。

101 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	103年截至5月累積投資報酬率 (%)	委任迄今 (101.10.1 ~103.5.31)		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率 (%)
瑞萬通博	309,910,147	316,773,830	7.11	2.21	-	3.99

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	19.42%

二、投資：無

***勞工保險基金投資運用財務收支表**

單位：新臺幣元

	餘絀	營業收入	營業支出
103年5月	6,635,996,170	8,823,546,971	2,187,550,801

註：上述金額係依權責基礎填列。

***勞工保險基金投資運用現金收支表**

103年5月份

單位：新臺幣元

項 目	金 額
基金收入	72,947,473,446
基金支出	76,365,295,491
現金增(減)數	(3,417,822,045)

註：本表採現金基礎。