

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 7 月底

收益率
3.7637%

*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 7 月底止基金規模與收益		
基金運用規模		5,865 億 8,089 萬元
103 年截至 7 月底止 運用總損益及評價後報酬率	自行運用	173 億 8,711 萬元 4.30%
	委託經營	73 億 4,730 萬元 5.50%
	合計	247 億 3,441 萬元 4.60%

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 7 月底

單位：新台幣元

項 目	餘 額	占基金運用比例(%)
自行運用	445,429,907,031	75.94
轉存金融機構	100,570,441,928	17.15
短期票券	21,632,535,365	3.69
公債、公司債、金融債券及證券化商品	47,299,108,800	8.06
房屋及土地	1,813,265,700	0.31
政府或公營事業貸款	2,880,000,000	0.49
被保險人貸款	37,170,918,256	6.34
股票及受益憑證投資(含期貨)	112,171,585,788	19.12
國外投資	121,892,051,194	20.78
固定收益	82,281,751,802	14.03
權益證券	37,890,854,854	6.46
另類投資	1,719,444,538	0.29
委託經營	141,150,980,052	24.06
國內委託經營	38,479,198,396	6.56
國外委託經營	102,671,781,656	17.50
固定收益	52,099,844,872	8.88
權益證券	50,571,936,784	8.62
另類投資	0	0.00
合 計	586,580,887,083	100.00

2. 基金自營投資與委外投資比例

截至 103 年 7 月底

單位：新台幣元

項 目	金 額	占基金運用比例 (%)
自行運用	445,429,907,031	75.94
委託經營	141,150,980,052	24.06

3. 基金國內投資與國外投資比例

截至 103 年 7 月底

單位：新台幣元

項 目	金 額	占基金運用比例 (%)
國內投資	362,017,054,233	61.72
國外投資	224,563,832,850	38.28

*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 7 月底

項 目	收益率（%）
國內權益證券	11.65

2. 基金自營股票及受益憑證投資比例概況

截至 103 年 7 月底

單位：新台幣元

項 目	金 額	比例（%）
國內權益證券	112,171,585,788	19.12

***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 7 月累 積投資報酬(%)	委任迄今(101.7.2~103.7.31)		
				投資報酬 率(%)	排名	大盤報酬率(%)
安泰	6,000,000,000	7,539,964,723	10.39	25.67	2	27.68
永豐	4,000,000,000	5,314,462,371	5.98	32.86	1	
合計	10,000,000,000	12,854,427,094	8.52	28.54	—	

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 7 月累 積投資報酬(%)	委任迄今(102.8.15~103.7.31)		
				投資報酬 率(%)	排名	大盤報酬率(%)
國泰	5,013,118,929	5,741,647,505	9.14	14.53	—	17.16

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 7 月累 積投資報酬(%)	委任迄今(102.9.16~103.7.31)		
				投資報酬 率(%)	排名	大盤報酬率(%)
統一	4,000,000,000	4,836,246,037	11.91	20.91	—	14.41

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 7 月累積投資報酬(%)	委任迄今(102. 11. 29~103. 7. 31)		
				投資報酬率(%)	排名	大盤報酬率(%)
國泰(A)	4, 000, 000, 000	4, 459, 112, 631	9. 28	11. 48	—	11. 40

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 7 月累積投資報酬(%)	委任迄今(100. 9. 30~103. 7. 31)		
				投資報酬率(%)	排名	大盤報酬率(%)
國泰(B)	4, 000, 000, 000	5, 429, 480, 559	9. 19	35. 74	—	29. 70

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 7 月累積投資報酬(%)	委任迄今(101. 3. 29~103. 7. 31)		
				投資報酬率(%)	排名	大盤報酬率(%)
統一(A)	4, 000, 000, 000	5, 158, 284, 570	12. 18	28. 96	—	15. 90

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)受託機構經營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7月累積投資報酬率 (%)	委任迄今 (98.11.1~103.7.31)		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率 (%)
太平洋	100,000,000	121,328,537.73	3.28	21.33	1	12.47
聯博	100,000,000	117,630,622.29	3.50	17.63	2	
合計	200,000,000	238,959,160.02	3.39	19.48	—	

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7月累積投資報酬率 (%)	委任迄今 (98.11.1~103.7.31)		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率 (%)
威靈頓	150,000,000	287,680,064.93	1.45	91.79	—	71.48

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7月累積投資報酬率 (%)	委任迄今 (99.7.1~103.7.31)		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率 (%)
威靈頓	79,276,014	155,624,728.26	1.44	96.31	—	79.50

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7月累積投資報酬率 (%)	委任迄今 (100.2.1~103.7.31)		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率 (%)
聯博	100,000,000	109,331,498.87	3.49	9.33	—	7.80

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 7 月累 積投資報酬率 (%)	委任迄今 (99.2.1~103.7.31)		
				投資報 酬率(%)	排名	指標報酬率 (%)
Standish Mellon	200,000,000	240,031,892.96	3.88	20.02	2	17.33
威靈頓	200,000,000	235,945,000.79	3.76	17.97	3	
太平洋	200,000,000	252,996,143.86	4.82	26.50	1	
合計	600,000,000	728,973,037.61	4.17	21.50	—	

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 7 月累 積投資報酬率 (%)	委任迄今 (101.1.1~103.7.31)		
				投資報 酬率(%)	排名	指標報酬率 (%)
太平洋	200,000,000	218,843,398.31	4.83	9.42	—	5.66

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 7 月累 積投資報酬率 (%)	委任迄今 (100.11.1、12.1、 101.1.3 註 ~103.7.31)		
				投資報 酬率(%)	排名	指標報酬率 (%)
MFS	300,000,000	433,226,690.46	3.06	67.46	1	49.48
貝萊德	200,000,000	298,930,317.59	3.01	49.47	2	53.22
Amundi	100,000,000	173,807,867.04	2.61	36.59	3	52.85
合計	600,000,000	905,964,875.09	2.79	51.26	—	—

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 103.7.16 收回 1 億美元，並於同日增額撥款 1 億美元至 MFS。

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7月累積投資報酬率 (%)	委任迄今 (101.10.1、11.1 註 ~103.7.31)		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率 (%)
實港	150,000,000	143,239,812.67	4.22	-4.51	3	0.24
博祿貝	150,000,000	147,284,277.54	3.33	-1.81	2	0.45
坦伯頓	150,000,000	147,697,570.24	4.79	-1.53	1	
合計	450,000,000	438,221,660.45	4.11	-3.23	—	—

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。本批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7月累積投資報酬率 (%)	委任迄今 (101.10.1 ~103.7.31)		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率 (%)
瑞萬通博	309,910,147	334,216,909.06	13.01	7.84	—	9.53

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：

單位：美元

投信名稱	收回日期	收回委託金額	經理人	收回理由
100 年 Amundi	103.7.16	1 億	Nicholas 00	委託經營投資契約第 4 條(d)項規定， 收回半數委託額度

*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7月31日

一、避險：

種類	避險比例
權益證券避險	0%
匯率避險	18.26%

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7月	1,314,627,566	6,648,366,460	5,333,738,894

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7月份

單位：新臺幣元

項 目	金 額
基金收入	80,866,349,334
基金支出	81,100,835,346
現金增(減)數	(234,486,012)

註：本表採現金基礎。