

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 9 月底

收益率
3.4310%

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 9 月底止基金規模與收益		
基金運用規模		6,446 億 9,284 萬元
104 年截至 9 月底止 運用總損益及評價後報酬率	自行運用	-57 億 190 萬元 -1.18%
	委託經營	-40 億 3,409 萬元 -2.64%
	合計	-97 億 3,599 萬元 -1.53%

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 9 月底

單位：新台幣元

項 目	餘 額	占基金運用比例(%)
自行運用	490,833,337,556	76.13
轉存金融機構	131,307,413,885	20.37
短期票券	11,946,140,450	1.85
公債、公司債、金融債券及證券化商品	67,479,205,882	10.47
房屋及土地	1,793,013,216	0.28
政府或公營事業貸款	940,000,000	0.14
被保險人貸款	33,343,283,030	5.17
股票及受益憑證投資(含期貨)	114,613,829,663	17.78
國外投資	129,410,451,430	20.07
固定收益	84,087,480,553	13.04
權益證券	41,114,414,299	6.38
另類投資	4,208,556,578	0.65
委託經營	153,859,503,164	23.87
國內委託經營	34,825,631,301	5.40
國外委託經營	119,033,871,863	18.47
固定收益	48,134,593,965	7.47
權益證券	57,652,901,762	8.94
另類投資	13,246,376,136	2.06
合 計	644,692,840,720	100.00

(三)基金自營投資與委外投資比例

截至 104 年 9 月底

單位：新台幣元

項 目	金 額	占基金運用比例 (%)
自行運用	490,833,337,556	76.13
委託經營	153,859,503,164	23.87

(四)基金國內投資與國外投資比例

截至 104 年 9 月底

單位：新台幣元

項 目	金 額	占基金運用比例 (%)
國內投資	396,248,517,427	61.46
國外投資	248,444,323,293	38.54

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 9 月底

項 目	收益率 (%)
國內權益證券	-7.63

(二)基金自營股票及受益憑證投資比例概況

截至 104 年 9 月底

單位：新台幣元

項 目	金 額	比例 (%)
國內權益證券	114,613,829,663	17.78

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 9 月 累積投資報酬(%)	委任迄今(104.7.2~104.9.30)		
				投資報酬率 (%)	排名	大盤報酬率(%)
野村	8,090,151,656	7,585,718,863	-6.24	-6.24	2	-12.74
永豐	5,620,805,395	5,278,918,167	-6.08	-6.08	1	
合計	13,710,957,051	12,864,637,030	-6.17	-6.17	—	

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 9 月 累積投資報酬(%)	委任迄今(102.8.15~104.9.30)		
				投資報酬率 (%)	排名	大盤報酬率(%)
國泰	5,013,118,929	5,674,273,735	-1.36	13.19	—	2.89

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 9 月 累積投資報酬(%)	委任迄今(102.9.16~104.9.30)		
				投資報酬率 (%)	排名	大盤報酬率(%)
統一	4,000,000,000	4,404,533,277	-9.10	10.11	—	0.48

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 9 月 累積投資報酬(%)	委任迄今(102.11.29~104.9.30)		
				投資報酬率 (%)	排名	大盤報酬率(%)
國泰(A)	4,000,000,000	4,383,485,399	-1.90	9.59	—	-2.17

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 9 月 累積投資報酬(%)	委任迄今(103.9.30~104.9.30)		
				投資報酬率 (%)	排名	大盤報酬率(%)
國泰	2,980,000,000	2,963,223,934	-1.79	-0.56	—	-8.70

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 9 月 累積投資報酬(%)	委任迄今(104.3.30~104.9.30)		
				投資報酬率 (%)	排名	大盤報酬率(%)
統一	5,106,824,840	4,535,477,926	-11.19	-11.19	—	-13.92

(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 9 月 累積投資報酬率 (%)	委任迄今 (103.11.3~104.9.30)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
威靈頓	300,000,000	303,188,975	-1.35	1.06	—	-5.70

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 9 月 累積投資報酬率 (%)	委任迄今 (101.10.1 ~104.9.30)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
瑞萬通博	309,910,147	292,204,947	-8.59	-5.71	—	-16.02

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 9 月 累積投資報酬率 (%)	委任迄今 (100.11.1、12.1、 101.1.3 註 ~104.9.30)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
MFS	400,000,000	537,434,153	-4.09	69.12	1	41.06
貝萊德	200,000,000	271,472,733	-8.77	35.74	2	44.59
Amundi	100,000,000	170,330,468	-3.83	33.85	3	44.25
合計	700,000,000	979,237,354	-5.39	47.35	—	—

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。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 9 月 累積投資報酬率 (%)	委任迄今 (101.10.1、11.1 註 ~104.9.30)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
實港	150,000,000	104,804,241	-16.52	-30.13	3	-24.43
博祿貝	150,000,000	108,507,850	-17.07	-27.66	2	-24.27
坦伯頓	150,000,000	127,406,050	-7.59	-15.06	1	
合計	450,000,000	340,718,141	-13.58	-24.76	—	—

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 9 月 累積投資報酬率 (%)	委任迄今 (104.2.2~104.9.30)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
Standish Mellon	232,680,166	224,793,148	-3.39	-3.39	4	-2.10
威靈頓	228,104,878	223,271,257	-2.12	-2.12	1	
太平洋	462,694,059	449,728,506	-2.80	-2.80	3	
聯博	220,415,963	214,474,679	-2.70	-2.70	2	
合計	1,143,895,066	1,112,267,590	-2.76	-2.76	—	

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 9 月 累積投資報酬率 (%)	委任迄今 (104.08.11 ~104.9.30)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
北美信託	60,000,000	55,219,641	-7.97	-7.97	2	-7.86
LGIM	60,000,000	55,201,375	-8.00	-8.00	3	
Geode	60,000,000	55,255,054	-7.91	-7.91	1	
合計	180,000,000	165,676,070	-7.96	-7.96	—	—

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 9 月 累積投資報酬率 (%)	委任迄今 (104.09.25~104.09.30)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
信安環球	100,000,000	100,849,397	0.85	0.85	1	0.88
CBRE	100,000,000	100,198,828	0.20	0.20	2	
合計	200,000,000	201,048,225	0.52	0.52	—	—

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 9 月 累積投資報酬率 (%)	委任迄今 (104.09.25~104.09.30)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
Cohen & Steers	50,000,000	49,564,294	-0.87	-0.87	3	-0.11
麥格理	50,000,000	49,320,943	-1.36	-1.36	4	
Magellan	50,000,000	50,245,373	0.49	0.49	1	
RREEF	50,000,000	49,675,552	-0.65	-0.65	2	
合計	200,000,000	198,806,162	-0.60	-0.60	—	—

(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9月30日

(一) 避險：

種類	避險比例
權益證券避險	0%
匯率避險	23.05%

(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9月	-4,375,286,143	4,748,945,392	9,124,231,535

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9月份

單位：新台幣元

項 目	金 額
基金收入	64,209,031,614
基金支出	59,688,388,138
現金增(減)數	4,520,643,476

註：本表係採現金基礎。