

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 103 年 12 月底

| |
|---------|
| 收益率 |
| 3.8376% |

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

| 103 年 12 月底止基金規模與收益 | | |
|--------------------------------|------|-------------------------|
| 基金運用規模 | | 6,224 億 5,908 萬元 |
| 103 年截至 12 月底止 運用總損益及評價後報酬率 | 自行運用 | 217 億 6,772 萬元 5.18% |
| | 委託經營 | 92 億 7,504 萬元 6.98% |
| | 合計 | 310 億 4,276 萬元 5.61% |
| 夏普指標(Sharp ratio) | | 0.43 |

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。

(二) 資產配置

截至 103 年 12 月底

單位：新台幣元

| 項 目 | 餘 額 | 占基金運用比例(%) |
|-------------------|------------------------|---------------|
| 自行運用 | 481,272,400,501 | 77.31 |
| 轉存金融機構 | 103,547,014,870 | 16.64 |
| 短期票券 | 25,226,458,844 | 4.05 |
| 公債、公司債、金融債券及證券化商品 | 61,979,143,303 | 9.96 |
| 房屋及土地 | 1,806,030,405 | 0.29 |
| 政府或公營事業貸款 | 2,350,000,000 | 0.37 |
| 被保險人貸款 | 31,670,266,915 | 5.09 |
| 股票及受益憑證投資(含期貨) | 122,189,779,186 | 19.63 |
| 國外投資 | 132,503,706,978 | 21.28 |
| 固定收益 | 81,806,591,812 | 13.14 |
| 權益證券 | 48,891,219,118 | 7.85 |
| 另類投資 | 1,805,896,048 | 0.29 |
| 委託經營 | 141,186,679,778 | 22.69 |
| 國內委託經營 | 36,087,873,126 | 5.80 |
| 國外委託經營 | 105,098,806,652 | 16.89 |
| 固定收益 | 52,383,582,091 | 8.42 |
| 權益證券 | 52,715,224,561 | 8.47 |
| 另類投資 | 0 | 0.00 |
| 合 計 | 622,459,080,279 | 100.00 |

(三)基金自營投資與委外投資比例

截至 103 年 12 月底

單位：新台幣元

| 項 目 | 金 額 | 占基金運用比例 (%) |
|------|-----------------|-------------|
| 自行運用 | 481,272,400,501 | 77.31 |
| 委託經營 | 141,186,679,778 | 22.69 |

(四)基金國內投資與國外投資比例

截至 103 年 12 月底

單位：新台幣元

| 項 目 | 金 額 | 占基金運用比例 (%) |
|------|-----------------|-------------|
| 國內投資 | 384,856,566,649 | 61.83 |
| 國外投資 | 237,602,513,630 | 38.17 |

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 103 年 12 月底

| 項 目 | 收 益 率 (%) |
|--------|-------------|
| 國內權益證券 | 12.79 |

(二)基金自營股票及受益憑證投資比例概況

截至 103 年 12 月底

單位：新台幣元

| 項 目 | 金 額 | 比 例 (%) |
|--------|-----------------|-----------|
| 國內權益證券 | 122,189,779,186 | 19.63 |

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 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12月累 積投資報酬(%) | 委任迄今(101.7.2~103.12.31) | | |
|----------|----------------|----------------|------------------------|-------------------------|----|----------|
| | | | | 投資報酬 率(%) | 排名 | 大盤報酬率(%) |
| 安泰 | 6,000,000,000 | 7,634,467,439 | 11.77 | 27.24 | 2 | 27.56 |
| 永豐 | 4,000,000,000 | 5,299,780,296 | 5.69 | 32.49 | 1 | |
| 合計 | 10,000,000,000 | 12,934,247,735 | 9.20 | 29.34 | — | |

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12月累 積投資報酬(%) | 委任迄今(102.8.15~103.12.31) | | |
|----------|---------------|---------------|------------------------|--------------------------|----|----------|
| | | | | 投資報酬 率(%) | 排名 | 大盤報酬率(%) |
| 國泰 | 5,013,118,929 | 5,752,714,727 | 9.35 | 14.75 | — | 17.05 |

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12月累 積投資報酬(%) | 委任迄今(102.9.16~103.12.31) | | |
|----------|---------------|---------------|------------------------|--------------------------|----|----------|
| | | | | 投資報酬 率(%) | 排名 | 大盤報酬率(%) |
| 統一 | 4,000,000,000 | 4,845,328,626 | 12.12 | 21.13 | — | 14.30 |

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 12 月累積投資報酬(%) | 委任迄今(102.11.29~103.12.31) | | |
|-------|---------------|---------------|-----------------------|---------------------------|----|----------|
| | | | | 投資報酬率(%) | 排名 | 大盤報酬率(%) |
| 國泰(A) | 4,000,000,000 | 4,468,324,485 | 9.50 | 11.71 | — | 11.30 |

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 | 103 年截至 12 月累積投資報酬(%) | 委任迄今(103.9.30~103.12.31) | | |
|------|---------------|---------------|-----------------------|--------------------------|----|----------|
| | | | | 投資報酬率(%) | 排名 | 大盤報酬率(%) |
| 國泰 | 2,980,000,000 | 3,017,259,901 | 1.25 | 1.25 | — | 3.87 |

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 12 月累積投資報酬(%) | 委任迄今(101.3.29~103.12.31) | | |
|-------|---------------|---------------|-----------------------|--------------------------|----|----------|
| | | | | 投資報酬率(%) | 排名 | 大盤報酬率(%) |
| 統一(A) | 4,000,000,000 | 5,069,997,652 | 10.26 | 26.75 | — | 15.79 |

(二)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

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 年全球債券型續約 II

單位：美元

| 投信名稱 | 委託金額 | 目前淨資產 | 103 年截至 12 月 累積投資報酬率 (%) | 委任迄今 (103.11.3~103.12.31) | | |
|------|-------------|-------------|--------------------------------|------------------------------|----|----------|
| | | | | 投資報酬率(%) | 排名 | 指標報酬率(%) |
| 太平洋 | 118,594,099 | 117,667,683 | -0.78 | -0.78 | 1 | -1.03 |
| 聯博 | 222,245,940 | 220,089,064 | -0.97 | -0.97 | 2 | |
| 合計 | 340,840,039 | 337,756,747 | -0.90 | -0.90 | — | |

94 年全球股票型續約 II

單位：美元

| 投信名稱 | 委託金額 | 目前淨資產 | 103 年截至 12 月 累積投資報酬率 (%) | 委任迄今 (103.11.3~103.12.31) | | |
|------|-------------|-------------|--------------------------------|------------------------------|----|----------|
| | | | | 投資報酬率(%) | 排名 | 指標報酬率(%) |
| 威靈頓 | 300,000,000 | 307,322,666 | 2.44 | 2.44 | — | 0.36 |

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 | 103 年截至 12 月 累積投資報酬率 (%) | 委任迄今 (101.10.1 ~103.12.31) | | |
|------|-------------|-------------|--------------------------------|-------------------------------|----|----------|
| | | | | 投資報酬率(%) | 排名 | 指標報酬率(%) |
| 瑞萬通博 | 309,910,147 | 319,648,290 | 8.08 | 3.14 | — | 0.21 |

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 12 月 累積投資報酬率 (%) | 委任迄今 (99.2.1~103.12.31) | | |
|-----------------|-------------|-------------|--------------------------------|----------------------------|----|--------------|
| | | | | 投資報酬率(%) | 排名 | 指標報酬率 (%) |
| Standish Mellon | 200,000,000 | 232,061,138 | 0.43 | 16.03 | 2 | 13.49 |
| 威靈頓 | 200,000,000 | 228,201,281 | 0.35 | 14.10 | 3 | |
| 太平洋 | 200,000,000 | 245,923,413 | 1.89 | 22.96 | 1 | |
| 合計 | 600,000,000 | 706,185,832 | 0.91 | 17.70 | — | |

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 12 月 累積投資報酬率 (%) | 委任迄今 (101.1.1~103.12.31) | | |
|------|-------------|-------------|--------------------------------|-----------------------------|----|--------------|
| | | | | 投資報酬率(%) | 排名 | 指標報酬率 (%) |
| 太平洋 | 200,000,000 | 213,324,145 | 2.19 | 6.66 | — | 2.20 |

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 12 月 累積投資報酬率 (%) | 委任迄今 (100.11.1、12.1、 101.1.3 註 ~103.12.31) | | |
|--------|-------------|---------------|--------------------------------|---|----|--------------|
| | | | | 投資報酬率(%) | 排名 | 指標報酬率 (%) |
| MFS | 400,000,000 | 560,334,967 | 8.52 | 76.32 | 1 | 50.13 |
| 貝萊德 | 200,000,000 | 297,573,160 | 2.55 | 48.79 | 2 | 53.88 |
| Amundi | 100,000,000 | 177,118,034 | 4.56 | 39.19 | 3 | 53.52 |
| 合計 | 700,000,000 | 1,035,026,161 | 5.84 | 55.75 | — | — |

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 12 月 累積投資報酬率 (%) | 委任迄今 (101.10.1、11.1 註 ~103.12.31) | | |
|------|-------------|-------------|--------------------------------|--|----|--------------|
| | | | | 投資報 酬率(%) | 排名 | 指標報酬率 (%) |
| 實港 | 150,000,000 | 125,537,464 | -8.66 | -16.31 | 3 | -10.46 |
| 博祿貝 | 150,000,000 | 130,845,234 | -8.20 | -12.77 | 2 | -10.27 |
| 坦伯頓 | 150,000,000 | 137,873,154 | -2.18 | -8.08 | 1 | |
| 合計 | 450,000,000 | 394,255,852 | -6.33 | -12.94 | — | — |

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。

(二)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

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)

103年12月31日

(一) 避險：

| 種類 | 避險比例 |
|--------|--------|
| 權益證券避險 | 0% |
| 匯率避險 | 22.01% |

(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 |
|---------|--------------|---------------|---------------|
| 103年12月 | -913,898,746 | 7,446,696,127 | 8,360,594,873 |

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

103年12月份

單位：新台幣元

| 項 目 | 金 額 |
|---------|-----------------|
| 基金收入 | 123,655,148,737 |
| 基金支出 | 128,681,006,655 |
| 現金增(減)數 | (5,025,857,918) |

註：本表採現金基礎。