

勞工保險基金運用情形

一、勞工保險基金整體績效

(一)本年度迄今(110年1月)績效

基金別	收益率	台灣 10 年期 公債殖利率	台灣 加權股價指數	MSCI 全球股票指數	Barclays 全球債券指數
勞保基金	0.87%	0.32%	2.75%	-0.45%	-0.88%

註 1：股、債指數係依據勞動部 103 年 12 月 15 日勞動福 4 字第 1030136646 號函核定之勞動基金投資政策書所載參考指標，且均為原幣別報酬率。

註 2：收益率係評價後收益數÷日平均餘額。

(二)近一年(109年)績效

基金別	收益率	台灣 10 年期 公債殖利率	台灣 加權股價指數	MSCI 全球股票指數	Barclays 全球債券指數
勞保基金	8.83%	0.43%	22.80%	16.25%	9.20%

(三)近三年(107~109年)平均績效

基金別	收益率	台灣 10 年期 公債殖利率	台灣 加權股價指數	MSCI 全球股票指數	Barclays 全球債券指數
勞保基金	6.57%	0.70%	11.45%	10.06%	4.85%

(四)近五年(105~109年)平均績效

基金別	收益率	台灣 10 年期 公債殖利率	台灣 加權股價指數	MSCI 全球股票指數	Barclays 全球債券指數
勞保基金	6.33%	0.80%	12.06%	12.26%	4.79%

二、基金運用概況表

(一)基金規模與投資績效

110年1月底止基金規模與收益			
基金運用規模			7,913億1,163萬元
110年截至1月底止 運用收益數及收益率	自行運用	國內固定收益	1億9,042萬元 1.08%
		國內權益證券 及國外投資	87億2,463萬元 3.36%
	委託經營		-25億951萬元 -0.93%
	合 計		64億554萬元 0.87%

註：收益率係以當期收益率列示，惟國內固定收益係以年化收益率列示。

(二)資產配置

截至110年1月底

單位：新台幣元

項 目	餘 額	占基金運用比例(%)
自行運用	523,223,429,614	66.13
轉存金融機構	76,289,282,578	9.64
短期票券	14,816,272,552	1.87
公債、公司債、金融債券及特別股	73,080,487,938	9.24
房屋及土地	1,654,961,587	0.21
政府或公營事業貸款	2,840,000,000	0.36
被保險人貸款	33,004,906,107	4.17
股票及受益憑證投資(含期貨)	170,396,866,341	21.53
國外投資	151,140,652,511	19.11
固定收益	74,579,174,438	9.43
權益證券	69,051,600,435	8.73
另類投資	7,509,877,638	0.95
委託經營	268,088,205,095	33.87
國內委託經營	26,909,018,586	3.40
國外委託經營	241,179,186,509	30.47
固定收益	59,930,155,023	7.57
權益證券	107,092,823,447	13.53
另類投資	74,156,208,039	9.37
合 計	791,311,634,709	100.00

(三)基金自營投資與委外投資比例

截至 110 年 1 月底

單位：新台幣元

項 目	金 額	占基金運用比例 (%)
自行運用	523,223,429,614	66.13
委託經營	268,088,205,095	33.87

(四)基金國內投資與國外投資比例

截至 110 年 1 月底

單位：新台幣元

項 目	金 額	占基金運用比例 (%)
國內投資	398,991,795,689	50.42
國外投資	392,319,839,020	49.58

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 110 年 1 月底

項 目	收益率 (%)
國內權益證券	8.33

(二)基金自營股票及受益憑證投資比例概況

截至 110 年 1 月底

單位：新台幣元

項 目	金 額	比 例 (%)
國內權益證券	170,396,866,341	21.53

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 103 年度續約 3

單位：新台幣元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	110 年截至 1 月 累積投資報酬率(%)	委任迄今 (109. 9. 30~110. 1. 31)		
				投資 報酬率(%)	排名	大盤/目標 報酬率(%)
國泰	4, 280, 395, 006	4, 857, 988, 445	1. 67	13. 49	—	21. 42/2. 08

勞工保險基金 104 年度續約 2

單位：新台幣元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	110 年截至 1 月 累積投資報酬率 (%)	委任迄今 (107. 7. 2~110. 1. 31)		
				投資 報酬率 (%)	排名	大盤/目標 報酬率(%)
野村	8, 378, 723, 777	10, 911, 310, 117	2. 84	31. 04	1	39. 69/16. 21
永豐	2, 923, 806, 721	2, 709, 377, 609	3. 98	25. 38	2	
合計	11, 302, 530, 498	13, 620, 687, 726	3. 07	27. 11	—	

勞工保險基金 106 年度第 1 次

單位：新台幣元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	110 年截至 1 月 累積投資報酬率(%)	委任迄今 (107. 10. 8~110. 1. 31)		
				投資 報酬率(%)	排名	大盤/目標 報酬率(%)
台新	1, 000, 000, 000	1, 272, 517, 219	2. 62	27. 25	7	43. 94/14. 43
安聯	1, 000, 000, 000	1, 470, 489, 617	0. 17	47. 05	1	
保德信	1, 000, 000, 000	1, 306, 161, 811	1. 51	30. 62	5	
國泰	900, 000, 000	1, 232, 070, 819	-1. 39	38. 40	3	
復華	351, 099, 628	505, 449, 524	4. 68	43. 13	2	
群益	1, 000, 000, 000	1, 299, 458, 808	3. 28	29. 95	6	
滙豐中華	1, 000, 000, 000	1, 344, 194, 617	1. 56	34. 42	4	
合計	6, 251, 099, 628	8, 430, 342, 415	1. 32	35. 04	—	

(二) 110 年 1 月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) 基金國外委外投資績效、績效指標及排名表

96 年全球新興市場主動股票型(續約 2)

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	110 年截至 1 月 累積投資報酬率(%)	委任迄今 (106.10.2~110.01.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標 報酬率(%)
瑞萬通博	134,445,625	149,948,641	3.87	10.24	—	24.86

100 年全球主動股票型(續約)

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	110 年截至 1 月 累積投資報酬率(%)	委任迄今 (105.11.1~110.01.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標 報酬率(%)
MFS	796,706,966	1,401,038,633	-2.63	75.85	—	70.02

101 年全球新興市場主動債券型(續約)

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	110 年截至 1 月 累積投資報酬率(%)	委任迄今 (106.11.1~110.01.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標 報酬率(%)
富蘭克林 坦伯頓	300,039,317	347,905,718	-0.48	15.95	—	21.30

104 年全球主動債券型(續約 2)

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	110 年截至 1 月 累積投資報酬率(%)	委任迄今 (109.2.3~110.01.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標 報酬率(%)
威靈頓	358,235,765	380,387,442	-1.03	6.18	2	6.65
PIMCO	734,536,253	805,896,662	-0.90	8.74	1	
合計	1,092,772,018	1,186,284,105	-0.94	7.97	—	—

104-1 全球高品質被動股票型(續約)

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	110 年截至 1 月 累積投資報酬率(%)	委任迄今 (109.8.11~110.01.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標 報酬率(%)
北美信託	423,550,185	477,987,515	-0.79	12.85	1	13.11
LGIM	423,212,022	477,543,940	-0.84	12.84	2	
Geode	422,872,469	477,015,856	-0.87	12.80	3	
合計	1,269,634,675	1,432,547,312	-0.83	12.83	—	—

104-2 全球基礎建設有價證券型(續約)

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	110 年截至 1 月 累積投資報酬率(%)	委任迄今 (109.9.25~110.01.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標 報酬率(%)
麥格理	103,110,456	113,720,934	-1.10	10.29	1	7.98
Magellan	334,158,139	348,885,976	-2.70	4.41	3	
RREEF	265,570,288	282,562,274	-1.96	6.40	2	
合計	702,838,883	745,169,184	-2.18	6.02	—	—

104-2 全球不動產有價證券型(續約)

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	110年截至1月 累積投資報酬率(%)	委任迄今 (109.9.25~110.01.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標 報酬率(%)
CBRE	229,525,997	263,438,449	-0.78	14.77	1	15.40
信安環球	343,981,408	377,122,144	-1.22	12.88	2	
合計	573,507,404	640,560,592	-1.04	13.61	—	—

104-1 全球主權信用增值債券型(續約)

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	110年截至1月 累積投資報酬率(%)	委任迄今 (109.11.13~110.01.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標 報酬率(%)
盧米斯	122,855,665	125,877,115	-1.24	2.46	—	2.08

105-1 全球多元資產型

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	110年截至1月 累積投資報酬率(%)	委任迄今 (105.7.20~110.01.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標/目標 報酬率(%)
Allianz	150,000,000	189,295,480	-0.29	25.46	4	7.15/29.85
摩根	300,000,000	406,528,939	-0.18	41.97	1	
DWS	250,000,000	316,447,726	0.08	28.35	2	
柏瑞	250,000,000	311,583,060	-0.82	27.28	3	
合計	950,000,000	1,223,855,205	-0.30	30.80	—	—

105-1 亞太混合指數增值股票型

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	110年截至1月 累積投資報酬率(%)	委任迄今 (105.8.24~110.01.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標 報酬率(%)
貝萊德	100,000,000	148,324,294	1.60	48.81	—	47.46

106-1 全球 ESG 混合指數被動股票型

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	110年截至1月 累積投資報酬率(%)	委任迄今 (106.6.22~110.01.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標 報酬率(%)
貝萊德	125,000,000	158,446,850	-0.28	41.54	4	42.01
DWS	125,000,000	159,058,369	-0.27	42.38	2	
道富	125,000,000	159,668,349	-0.11	43.08	1	
北美信託	125,000,000	159,135,844	-0.21	42.37	3	
合計	500,000,000	636,309,412	-0.22	42.34	—	—

106-1 絕對報酬債券型

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	110年截至1月 累積投資報酬率(%)	委任迄今 (106.7.25~110.01.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標/目標 報酬率(%)
American Century	100,000,000	111,118,027	-0.12	12.05	3	4.86/13.68
富達	100,000,000	118,355,653	-0.38	19.69	1	
富蘭克林坦伯頓	100,000,000	105,982,810	0.38	7.87	4	
TCW	100,000,000	113,671,468	0.45	16.12	2	
合計	400,000,000	449,127,957	0.07	13.94	—	—

(二) 110年1月被提前收回之國外委外投資帳戶：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)

110年1月31日

(一)避險：

種類	避險比例
權益證券避險	0%
匯率避險	12.28%

(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	作業收入	作業支出
110年1月	6,405,541,033	12,975,094,578	6,569,553,545

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

110年1月份

單位：新台幣元

項 目	金 額
基金收入	127,715,915,424
基金支出	119,665,899,911
現金增(減)數	8,050,015,513

註：本表係採現金基礎。