

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 11 月底

收益率
3.8510%

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 11 月底止基金規模與收益		
基金運用規模		6,163 億 3,511 萬元
103 年截至 11 月底止 運用總損益及評價後報酬率	自行運用	222 億 1,437 萬元 5.33%
	委託經營	97 億 4,229 萬元 7.32%
	合計	319 億 5,666 萬元 5.81%

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 11 月底

單位：新台幣元

項 目	餘 額	占基金運用比例(%)
自行運用	475,448,442,627	77.14
轉存金融機構	111,109,692,788	18.03
短期票券	23,576,934,790	3.83
公債、公司債、金融債券及證券化商品	51,879,136,355	8.42
房屋及土地	1,807,477,464	0.29
政府或公營事業貸款	1,940,000,000	0.31
被保險人貸款	32,814,259,394	5.32
股票及受益憑證投資(含期貨)	120,025,565,146	19.48
國外投資	132,295,376,690	21.46
固定收益	79,775,443,164	12.94
權益證券	50,751,331,306	8.23
另類投資	1,768,602,220	0.29
委託經營	140,886,663,266	22.86
國內委託經營	36,006,262,251	5.84
國外委託經營	104,880,401,015	17.02
固定收益	52,224,976,766	8.47
權益證券	52,655,424,249	8.55
另類投資	0	0.00
合 計	616,335,105,893	100.00

(三)基金自營投資與委外投資比例

截至 103 年 11 月底

單位：新台幣元

項 目	金 額	占基金運用比例 (%)
自行運用	475,448,442,627	77.14
委託經營	140,886,663,266	22.86

(四)基金國內投資與國外投資比例

截至 103 年 11 月底

單位：新台幣元

項 目	金 額	占基金運用比例 (%)
國內投資	379,159,328,188	61.52
國外投資	237,175,777,705	38.48

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 11 月底

項 目	收益率(%)
國內權益證券	13.29

(二)基金自營股票及受益憑證投資比例概況

截至 103 年 11 月底

項 目	金 額	比例(%)
國內權益證券	120,025,565,146	19.48

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11月累 積投資報酬(%)	委任迄今(101.7.2~103.11.30)		
				投資報酬 率(%)	排名	大盤報酬率(%)
安泰	6,000,000,000	7,588,386,829	11.10	26.47	2	23.00
永豐	4,000,000,000	5,323,415,657	6.16	33.09	1	
合計	10,000,000,000	12,911,802,486	9.01	29.12	—	

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11月累 積投資報酬(%)	委任迄今(102.8.15~103.11.30)		
				投資報酬 率(%)	排名	大盤報酬率(%)
國泰	5,013,118,929	5,757,906,000	9.45	14.86	—	15.54

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11月累 積投資報酬(%)	委任迄今(102.9.16~103.11.30)		
				投資報酬 率(%)	排名	大盤報酬率(%)
統一	4,000,000,000	4,778,574,833	10.57	19.46	—	12.83

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 11 月累積投資報酬(%)	委任迄今(102.11.29~103.11.30)		
				投資報酬率(%)	排名	大盤報酬率(%)
國泰(A)	4,000,000,000	4,471,837,708	9.59	11.80	—	9.86

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 11 月累積投資報酬(%)	委任迄今(103.9.30~103.11.30)		
				投資報酬率(%)	排名	大盤報酬率(%)
國泰	2,980,000,000	3,022,322,646	1.42	1.42	—	2.53

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 11 月累積投資報酬(%)	委任迄今(101.3.29~103.11.30)		
				投資報酬率(%)	排名	大盤報酬率(%)
統一(A)	4,000,000,000	5,063,818,578	10.12	26.60	—	14.30

(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 11 月 累積投資報酬率 (%)	委任迄今 (103.11.3~103.11.30)		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率(%)
太平洋	118,594,099	118,111,307	-0.41	-0.41	1	-0.54
聯博	222,245,940	221,239,839	-0.45	-0.45	2	
合計	340,840,039	339,351,146	-0.44	-0.44	—	

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 11 月 累積投資報酬率 (%)	委任迄今 (103.11.3~103.11.30)		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率(%)
威靈頓	300,000,000	310,119,715	3.37	3.37	—	2.00

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 11 月 累積投資報酬率 (%)	委任迄今 (101.10.1 ~103.11.30)		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率(%)
瑞萬通博	309,910,147	337,621,747	14.16	8.94	—	5.62

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 11 月 累積投資報酬率 (%)	委任迄今 (99.2.1~103.11.30)		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率(%)
Standish Mellon	200,000,000	233,612,576	1.11	16.81	2	14.28
威靈頓	200,000,000	229,805,128	1.06	14.90	3	
太平洋	200,000,000	247,512,132	2.55	23.76	1	
合計	600,000,000	710,929,836	1.59	18.49	—	

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 11 月 累積投資報酬率 (%)	委任迄今 (101.1.1~103.11.30)		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率(%)
太平洋	200,000,000	214,576,143	2.79	7.29	—	2.91

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 11 月 累積投資報酬率 (%)	委任迄今 (100.11.1、12.1、 101.1.3 註 ~103.11.30)		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率(%)
MFS	400,000,000	562,517,462	8.94	77.01	1	52.59
貝萊德	200,000,000	306,062,177	5.47	53.03	2	56.40
Amundi	100,000,000	180,106,756	6.33	41.54	3	56.03
合計	700,000,000	1,048,686,395	7.24	57.80	—	—

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。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 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	103 年截至 11 月 累積投資報酬率 (%)	委任迄今 (101.10.1、11.1 註 ~103.11.30)		
				投資報 酬率(%)	排名	指標報酬率 (%)
實港	150,000,000	134,340,022	-2.25	-10.44	3	-4.64
博祿貝	150,000,000	139,253,323	-2.30	-7.16	2	-4.44
坦伯頓	150,000,000	144,090,266	2.23	-3.94	1	
合計	450,000,000	417,683,611	-0.77	-7.77	—	—

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。

(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：

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
94 年續約 威靈頓(Wellington)	103.11.03	1.47 億	Nicholas 000	委託經營投資契約第 4 條(d)項規定，續約到期收回部份委託額度

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11月30日

(一) 避險：

種類	避險比例
權益證券避險	0%
匯率避險	21.58%

(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11月	6,814,964,457	10,319,375,077	3,504,410,620

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11月份

單位：新台幣元

項 目	金 額
基金收入	93,426,254,346
基金支出	88,717,567,473
現金增(減)數	4,708,686,873

註：本表採現金基礎。