

勞工退休基金運用績效參考資料（至 97 年 5 月底止）

一、舊制勞工退休基金規模與運用情形

截至 97 年 5 月底舊制勞退基金累積餘額為 4,675 億 5,521 萬元。運用情形如下：

（一）、基金規模與收益

單位：新台幣 萬元；%

至 97 年 5 月底止基金規模與收益	
目前基金運用規模	4,675 億 5,521 萬元
本年度運用淨收益 (評價後報酬率)	-25 億 7,747 萬元 (-0.57215%)

（二）、截至 97 年 5 月底資產配置

單位：新台幣 元；%

項 目	餘 額	占基金運用比例
轉存金融機構 (含國外委託經營預備金)	200,859,157,238 元	42.96%
政府機關及公營事業經建貸款	8,898,245,614 元	1.90%
股票及受益憑證投資	41,566,862,395 元	8.89%
公債、金融債券、公司債	53,079,359,559 元	11.35%
證券化商品	182,846,780 元	0.04%
短期票券	30,573,447,361 元	6.54%
黃金存摺	43,906,250 元	0.01%
國外投資	24,677,797,623 元	5.28%
國內委託經營	83,632,003,835 元	17.89%
國外委託經營	24,041,587,174 元	5.14%
合 計	467,555,213,829 元	100.00%

(三)、國內股票投資比率表(市價法)

(截至 97.5.31 止)

投資類別	投資比率(%)
金融保險	16.05
半導體業	14.33
光電業	7.92
鋼鐵工業	7.86
電腦及週邊	7.66
其他電子業	7.42
塑膠工業	6.44
通信網路業	4.49
電子零組件業	3.84
ETF	3.58
開放型基金	3.41
航運業	3.22
化學工業	2.33
油電燃氣業	1.82
建材營造	1.51
其他	1.48
水泥工業	1.36
橡膠工業	1.14
紡織纖維	1.10
電子通路業	0.90
食品工業	0.66
資訊服務業	0.39
造紙工業	0.39
貿易百貨	0.16
電機機械	0.15
玻璃陶瓷	0.14
汽車工業	0.14
電器電纜股	0.07
觀光事業	0.03
生技醫療業	0.01
合計	100.00

(四)、國內委託經營各受託投信績效統計

95 年 6 月辦理國內委託經營，委託金額為 240 億元；96 年 6 月辦理 91 年委託第 2 次續約及 93 年委託續約，委託金額計為 170 億元（其中 91 年續約部分 30 億元，93 年度續約部分為 140 億元），又 96 年 9 月增加委託額度 105 億元，另 97 年 3 月再度辦理委託經營，委託金額為 300 億元，目前委託總金額為 815 億元。

95 年委託經營

單位：新台幣 元；%

投 信 名 稱	委託投資金額	目 前 淨 資 產	投 資 報 酬 率
95 年委託統一投信	30 億元	2,849,248,439 元	-5.03%
95 年委託元大投信	30 億元	3,806,079,085 元	26.87%
95 年委託群益投信	30 億元	3,544,827,377 元	18.16%
95 年委託復華投信	30 億元	3,988,997,654 元	32.97%
95 年委託日盛投信	30 億元	2,954,152,517 元	-1.53%
95 年委託安泰投信	30 億元	4,074,060,944 元	35.80%
95 年委託匯豐中華投信	30 億元	3,593,307,744 元	19.78%
95 年委託永豐投信	30 億元	3,940,719,182 元	31.36%
合 計	240 億元	28,751,392,942 元	19.80%

註：執行期間係自 95 年 6 月 21 日至 97 年 5 月 31 日止。

91 年第 2 次續約及 93 年續約

單位：新台幣 元；%

投 信 名 稱	委託投資金額	目 前 淨 資 產	投 資 報 酬 率
91 年委託第 2 次續約復華投信	30 億元	2,845,315,751 元	-5.16%
93 年委託續約元大投信	30 億元	2,551,316,106 元	-14.96%
93 年委託續約復華投信	30 億元	2,871,410,878 元	-4.29%
93 年委託續約日盛投信	20 億元	1,804,832,058 元	-9.76%
93 年委託續約富邦投信	60 億元	5,828,642,543 元	-2.86%
合 計	170 億元	15,901,517,336 元	-6.46%

註：執行期間係自 96 年 6 月 21 日至 97 年 5 月 31 日止。

95 年委託經營 A 帳戶

單位：新台幣元；%

投 信 名 稱	委託投資金額	目 前 淨 資 產	投 資 報 酬 率
95 年委託安泰投信 A 帳戶	30 億元	2,854,340,465 元	-4.86%
95 年委託匯豐中華投信 A 帳戶	30 億元	2,580,650,234 元	-13.98%
95 年委託永豐投信 A 帳戶	25 億元	2,377,089,455 元	-4.92%
95 年委託復華投信 A 帳戶	20 億元	2,095,535,798 元	4.78%
合 計	105 億元	9,907,615,952 元	-5.64%

註：執行期間係自 96 年 9 月 3 日至 97 年 5 月 31 日止。

97 年委託經營

單位：新台幣元；%

投 信 名 稱	委託投資金額	目 前 淨 資 產	投 資 報 酬 率
97 年委託保德信投信	30 億元	3,008,699,539 元	0.29%
97 年委託匯豐中華投信	30 億元	2,904,826,924 元	-3.17%
97 年委託保誠投信	30 億元	3,033,808,703 元	1.13%
97 年委託群益投信	30 億元	3,001,563,881 元	0.05%
97 年委託復華投信	30 億元	3,036,152,298 元	1.21%
97 年委託元大投信	30 億元	2,949,685,147 元	-1.68%
97 年委託安泰投信	30 億元	2,981,444,612 元	-0.62%
97 年委託永豐投信	30 億元	3,118,950,194 元	3.97%
97 年委託國泰投信	30 億元	2,953,459,402 元	-1.55%
97 年委託富邦投信	30 億元	3,017,146,604 元	0.57%
合 計	300 億元	30,005,737,304 元	0.02%

註：執行期間係自 97 年 3 月 17 日至 97 年 5 月 31 日止。

(五)、國內委託經營績效統計

單位：新台幣 元；%

項 目 \ 委託年別	91年第2次續約 及93年續約 (96年6月21日～ 97年5月31日)	95年委託 (95年6月21日～ 97年5月31日)	95年委託A帳戶 (96年9月3日～ 97年5月31日)	97年委託 (97年3月17日～ 97年5月31日)
基金委託金額	17,000,000,000 元	24,000,000,000 元	10,500,000,000 元	30,000,000,000 元
委託資產淨值	15,901,517,336 元	28,751,392,942 元	9,907,615,952 元	30,005,737,304 元
總損益金額	-1,098,482,664 元	4,751,392,942 元	-592,384,048 元	5,737,304 元
總損益比率	-6.46%	19.80%	-5.64%	0.02%
折合應達 累計報酬率	11.33%	23.33%	8.93%	2.48%

註：上表係以「市價法」評價。

(六)、國外委託經營各受託投信績效統計

96年6月行政院勞工委員會辦理國外委託經營，委託金額為8億美元，各家受託投信機構績效如下：

96年國外委託

單位：美元；%

投 信 名 稱	委託投資金額	目 前 淨 資 產	投 資 報 酬 率
96年景順德國	2 億元	195,488,788.23 元	-2.26%
96年瑞銀環球	2 億元	204,079,118.64 元	2.04%
96年富達國際	2 億元	212,630,306.52 元	6.32%
96年德盛安聯	2 億元	199,134,880.88 元	-0.43%
合 計	8 億元	811,333,094.27 元	1.42%

註：執行期間係自96年6月21日至97年5月31日止。

(七)、96 年國外委託投資績效

單位：美元；%

資 產 淨 值	811,333,094.27 元
總 投 資 損(-) 益	(註) 11,333,094.27 元
報 酬 率	1.42%

註：1. 執行期間係自 96 年 6 月 21 日至 97 年 5 月 31 日止。

2. 股票部分為 MSCI 全球國家之未避險原幣別指數 (Morgan Stanley Capital International, world index-all countries, Unhedged)。同期間 (96/6/21-97/5/31)市場報酬率為-1.6296%。

3. 債券部分為 Citigroup 全球政府債券之已避險至美金指數(Citigroup World Government Bond Index; hedged to USD)。同期間(96/6/21-97/5/31)市場報酬率 6.3210%。

4. 未含美元兌台幣兌換損益。

二、新制勞工退休基金規模與運用情形

勞工退休金新制於 94 年 7 月 1 日開辦迄今，截至 97 年 5 月開單之提繳事業單位家數達 379,385 家，提繳勞退新制勞工人數約達 4,568,756 人。

(一)、基金運用餘額、收益

單位：新台幣萬元；%

至 97 年 5 月底止基金運用餘額與收益	
基金運用餘額	2,779 億 5,126 萬元
本年度運用總損益 (評價後報酬率)	-17 億 9,097 萬元 (-0.7018%)

註：評價後報酬率係以當期報酬率（即收益÷97 年之日平均餘額）列示

(二)、截至 97 年 5 月底資產配置

單位：新台幣元；%

項 目	餘 額	占基金運用比例
轉存金融機構	183,026,061,045	65.85%
短期票券	2,355,967,985	0.85%
股票及受益憑證	173,653,218	0.06%
公債、公司債及金融債券	11,129,242,967	4.00%
國外投資	559,496,984	0.20%
國內委託經營	57,907,863,456	20.84%
國外委託經營	22,798,971,737	8.20%
合 計	277,951,257,392	100.00%

(三)、國內投資股票投資比率表

(截至 97.5.31 止)

投 資 類 別	投 資 比 率(%)
水泥工業	1.44
食品工業	1.74
塑膠工業	2.39
紡織纖維	1.48
電機機械	0.52
電器電纜	0.05
化學工業	3.66
生技醫療	0.00
玻璃陶瓷	0.14
造紙工業	0.70
鋼鐵工業	5.09
橡膠工業	1.66
汽車工業	0.60
半導體業	12.70
電腦及週邊設備	10.49
光電業	11.12
通信網路	6.69
電子零組件	3.45
電子通路	2.75
資訊服務	0.80
其他電子業	5.38
建材營造	1.74
航運業	3.05
觀光事業	0.52
金融保險	19.29
貿易百貨	0.72
油電燃氣	0.09
其他	1.25
ETF	0.49
合計	100.00

(四)、國內委託經營各受託投信績效統計

自 96 年 9 月 27 日迄 97 年 5 月 31 日共辦理 2 次委託經營，累積委託總金額為 600 億元，分別為 96 年 9 月委託金額 300 億元，97 年 1 月委託金額 300 億元。

96 年第一次委託

單位：新台幣元；%

投信名稱	委託投資金額	目前淨資產	投資報酬率
永豐投信	3,000,000,000	2,544,508,544	-15.18
元大投信	3,000,000,000	2,390,536,712	-20.32
日盛投信	3,000,000,000	2,665,637,296	-11.15
安泰投信	3,000,000,000	2,821,272,711	-5.96
保德信投信	3,000,000,000	2,812,096,157	-6.26
保誠投信	3,000,000,000	2,664,976,376	-11.17
國泰投信	3,000,000,000	2,664,049,642	-11.2
富邦投信	3,000,000,000	2,536,105,245	-15.46
復華投信	3,000,000,000	2,745,624,975	-8.48
群益投信	3,000,000,000	2,723,542,340	-9.22
合計	30,000,000,000	26,568,349,998	-11.44

註：執行期間係自 96 年 9 月 27 日至 97 年 5 月 31 日止。

註：大華投信於 97 年 3 月 12 日更名為永豐投信。

97 年第一次委託

單位：新台幣元；%

投信名稱	委託投資金額	目前淨資產	投資報酬率
元大投信	2,500,000,000	2,501,429,094	0.06
友邦投信	2,500,000,000	2,573,192,871	2.93
日盛投信	2,500,000,000	2,569,296,022	2.77
安泰投信	2,500,000,000	2,593,508,945	3.74
金復華投信	2,500,000,000	2,532,864,727	1.31
保誠投信	2,500,000,000	2,539,265,603	1.57
保德信投信	2,500,000,000	2,607,030,940	4.28
國泰投信	2,500,000,000	2,607,801,040	4.31
富邦投信	2,500,000,000	2,541,065,692	1.64
復華投信	2,500,000,000	2,563,580,542	2.54
群益投信	2,500,000,000	2,554,578,253	2.18
寶來投信	2,500,000,000	2,763,307,247	10.53
合計	30,000,000,000	30,946,920,976	3.16

註：執行期間係自 97 年 1 月 18 日至 97 年 5 月 31 日止。

(五)、國內委託經營績效統計

單位：新台幣元；%

委託年別 項目	96 年第一次委託 (96 年 9 月 27 日~ 97 年 5 月 31 日)	97 年第一次委託 (97 年 1 月 18 日~ 97 年 4 月 30 日)
基金委託金額	30,000,000,000	30,000,000,000
委託資產淨值	26,568,349,998	30,946,920,976
總損益金額	-3,431,650,002	946,920,976
總損益比率	-11.44%	3.16%
折合應達累計報酬率	8.13%	4.43%

註：上表係以「市價法」評價。

(六)、國外委託經營各受託投信績效統計

自 97 年 5 月 20 日辦理國外委託經營，委託金額為 7.5 億美元，各家受託投信機構績效如下：

97 年國外委託

單位：美元；%

投信名稱	委託投資金額	目前淨資產	投資報酬率
聯博	2.5 億元	244,666,651.81	-2.13%
牛頓	2.5 億元	247,947,967.58	-0.82%
坦伯頓	2.5 億元	246,979,794.87	-1.21%
合計	7.5 億元	739,594,414.26	-1.387%

註：執行期間係自 97 年 5 月 20 日至 97 年 5 月 31 日止。

(七)、97 年國外委託投資績效

單位：美元；%

資 產 淨 值	739,594,414.26
總 投 資 損 (-) 益	(註) -10,405,585.74
報 酬 率	-1.387%

註：1. 執行期間係自 97 年 5 月 20 日至 97 年 5 月 31 日止。

2. 投資指標為 FTSE 全球指數 (FTSE ALL World index-Total Return ; Net Dividends Reinvested ; Unhedged ; Index measured in USD) 。同期間 (97/5/20-97/5/31) 指標報酬率為-2.13%，目標報酬率為-0.13% (目標報酬率為指標報酬率加 2%) 。

3. 未含美元兌新台幣之兌換損益。