

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 1 月底

收益率
3.5551%

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 1 月底止基金規模與收益		
基金運用規模		6,270 億 8,699 萬元
104 年截至 1 月底止 運用總損益及評價後報酬率	自行運用	8,424 萬元 0.02%
	委託經營	-2 億 7,259 萬元 -0.19%
	合計	-1 億 8,835 萬元 -0.03%

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 1 月底

單位：新台幣元

項 目	餘 額	占基金運用比例(%)
自行運用	486,300,293,569	77.55
轉存金融機構	111,748,520,717	17.82
短期票券	19,889,233,179	3.17
公債、公司債、金融債券及證券化商品	62,779,150,263	10.01
房屋及土地	1,804,583,346	0.29
政府或公營事業貸款	300,000,000	0.05
被保險人貸款	36,259,133,236	5.78
股票及受益憑證投資(含期貨)	120,628,846,640	19.23
國外投資	132,890,826,188	21.20
固定收益	82,748,409,586	13.20
權益證券	41,886,267,612	6.68
另類投資	8,256,148,990	1.32
委託經營	140,786,695,034	22.45
國內委託經營	36,535,689,058	5.83
國外委託經營	104,251,005,976	16.62
固定收益	52,263,769,170	8.33
權益證券	51,987,236,806	8.29
另類投資	0	0.00
合 計	627,086,988,603	100.00

(三)基金自營投資與委外投資比例

截至 104 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	486,300,293,569	77.55
委託經營	140,786,695,034	22.45

(四)基金國內投資與國外投資比例

截至 104 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	389,945,156,439	62.18
國外投資	237,141,832,164	37.82

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 1 月底

項 目	收益率(%)
國內權益證券	0.68

(二)基金自營股票及受益憑證投資比例概況

截至 104 年 1 月底

單位：新台幣元

項 目	金 額	比例(%)
國內權益證券	120,628,846,640	19.23

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	104 年截至 1 月累積投資報酬(%)	委任迄今(101.7.2~104.1.31)		
				投資報酬率(%)	排名	大盤報酬率(%)
野村	6,000,000,000	7,773,995,975	1.83	29.57	2	28.31
永豐	4,000,000,000	5,319,252,394	0.37	32.98	1	
合計	10,000,000,000	13,093,248,369	1.23	30.93	—	

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 1 月累積投資報酬(%)	委任迄今(102.8.15~104.1.31)		
				投資報酬率(%)	排名	大盤報酬率(%)
國泰	5,013,118,929	5,842,386,015	1.56	16.54	—	17.74

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 1 月累積投資報酬(%)	委任迄今(102.9.16~104.1.31)		
				投資報酬率(%)	排名	大盤報酬率(%)
統一	4,000,000,000	4,892,325,701	0.97	22.31	—	14.98

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 1 月累積投資報酬(%)	委任迄今(102.11.29~104.1.31)		
				投資報酬率(%)	排名	大盤報酬率(%)
國泰(A)	4,000,000,000	4,538,308,122	1.57	13.46	—	11.95

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 1 月累積投資報酬(%)	委任迄今(103.9.30~104.1.31)		
				投資報酬率(%)	排名	大盤報酬率(%)
國泰	2,980,000,000	3,065,443,459	1.60	2.87	—	4.48

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	104 年截至 1 月累積投資報酬(%)	委任迄今(101.3.29~104.1.31)		
				投資報酬率(%)	排名	大盤報酬率(%)
統一(A)	4,000,000,000	5,103,977,392	0.67	27.60	—	16.47

(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 2

單位：美元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	104年截至1月累 積投資報酬率 (%)	委任迄今 (103.11.3~104.1.31)		
				投資報 酬率(%)	排名	指標報酬率 (%)
太平洋	118,594,099	117,719,508	0.04	-0.74	1	-0.89
聯博	222,245,940	220,415,963	0.15	-0.82	2	
合計	340,840,039	338,135,471	0.11	-0.79	—	

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1月累 積投資報酬率 (%)	委任迄今 (103.11.3~104.1.31)		
				投資報 酬率(%)	排名	指標報酬率 (%)
威靈頓	300,000,000	304,376,712	-0.96	1.46	—	-1.46

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1月累 積投資報酬率 (%)	委任迄今 (101.10.1 ~104.1.31)		
				投資報 酬率(%)	排名	指標報酬率 (%)
瑞萬通博	309,910,147	330,030,842	3.25	6.49	—	0.89

99 年全球債券型

單位：美元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	104年截至1月累 積投資報酬率 (%)	委任迄今 (99.2.1~104.1.31)		
				投資報 酬率(%)	排名	指標報酬率 (%)
Standish Mellon	200,000,000	232,680,166	0.27	16.34	2	13.31
威靈頓	200,000,000	228,104,878	-0.04	14.05	3	
太平洋	200,000,000	248,108,680	0.89	24.05	1	
合計	600,000,000	708,893,724	0.38	18.15	—	

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	104年截至1月累 積投資報酬率 (%)	委任迄今 (101.1.1~104.1.31)		
				投資報 酬率(%)	排名	指標報酬率 (%)
太平洋	200,000,000	214,585,379	0.59	7.29	—	2.04

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1月累 積投資報酬率 (%)	委任迄今 (100.11.1、12.1、 101.1.3註 ~104.1.31)		
				投資報 酬率(%)	排名	指標報酬率 (%)
MFS	400,000,000	549,404,185	-1.95	72.88	1	47.40
貝萊德	200,000,000	288,685,926	-2.99	44.34	2	51.09
Amundi	100,000,000	175,014,197	-1.19	37.53	3	50.73
合計	700,000,000	1,013,104,308	-2.12	52.45	—	—

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	104年截至1月累 積投資報酬率 (%)	委任迄今 (101.10.1、11.1註 ~104.1.31)		
				投資報 酬率(%)	排名	指標報酬率 (%)
實港	150,000,000	124,994,368	-0.43	-16.67	3	-10.18
博祿貝	150,000,000	130,731,518	-0.09	-12.85	2	-10.00
坦伯頓	150,000,000	138,914,960	0.76	-7.39	1	
合計	450,000,000	394,640,846	0.10	-12.85	—	—

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)

104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	21.81%

(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1月	-188,354,906	2,280,294,953	2,468,649,859

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1月份

單位：新台幣元

項 目	金 額
基金收入	119,426,471,784
基金支出	107,554,415,937
現金增(減)數	11,872,055,847

註：本表採現金基礎。