

由政策局／部門設立的基金

政策局／部門：教育局基金名稱：優質教育基金

(一) 基金的盈餘狀況

最新年結日	2023年8月31日
於最新年結日的基金結餘 (百萬元)	8,734
累計盈餘／(虧損) (百萬元) (截至最新年結日)	3,734

(二) 基金的投資回報率

基金設有投資委員會，聘用專業投資經理管理投資事務。

為基金制定的目標投資回報率	約 4%
實際投資回報率	
2018－19財政年度	1.7%
2019－20財政年度	8.8%
2020－21財政年度	10.5%
2021－22財政年度	-10.3%
2022－23財政年度	4.4%

(三) 基金的投資經理公司資料

	聘請的投資經紀公司名稱／ 外匯基金／其他	佔本金的百分比 (截至最新年結日)
本地投資公司 (即在香港註冊成立的公司)		
1.	東方匯理資產管理香港有限公司	14%
2.	滙豐環球投資管理 (香港) 有限公司	15%
3.	安聯環球投資亞太有限公司	11%
4.	景順投資管理有限公司	9%
外國投資公司 (即並非在香港註冊成立的公司)		
5.	Wellington Management Company LLP	12%
6.	PIMCO Asia Pte Ltd	12%
外匯基金		
7.	外匯基金存款	16%

其他		
8.	銀行存款	11%
	總計	100%

由政策局／部門設立的基金

政策局／部門：教育局基金名稱：香港特別行政區政府獎學基金

(一) 基金的盈餘狀況

最新年結日	2023年8月31日
於最新年結日的基金結餘 (百萬元)	3,250
累計盈餘／(虧損) (百萬元) (截至最新年結日)	180

(二) 基金的投資回報率

基金設有投資委員會，聘用專業投資經理管理投資事務。

為基金制定的目標投資回報率	約4%
實際投資回報率	
2018－19財政年度	1.5%
2019－20財政年度	7.4%
2020－21財政年度	11.8%
2021－22財政年度	-9.3%
2022－23財政年度	5.1%

(三) 基金的投資經理公司資料

	聘請的投資經紀公司名稱／ 外匯基金／其他	佔本金的百分比 (截至最新年結日)
本地投資公司 (即在香港註冊成立的公司)		
1.	威靈頓管理香港有限公司	15%
2.	安聯環球投資亞太有限公司	14%
3.	景順投資管理有限公司	7%
4.	品浩投資管理(亞洲)有限公司	15%
外國投資公司 (即並非在香港註冊成立的公司)		
5.	Northern Trust Global Investments Limited	15%
外匯基金		
6.	外匯基金存款	23%
其他		
7.	銀行存款	11%
	總計	100%

由政策局／部門設立的基金

政策局／部門：教育局

基金名稱：自資專上教育基金

(一) 基金的盈餘狀況

最新年結日	2023年8月31日
於最新年結日的基金結餘 (百萬元)	4,074
累計盈餘／(虧損) (百萬元) (截至最新年結日)	554

(二) 基金的投資回報率

基金設有投資委員會，聘用專業投資經理管理投資事務。

為基金制定的目標投資回報率	約4%
實際投資回報率	
2018－19財政年度	2.1%
2019－20財政年度	5.8%
2020－21財政年度	10.7%
2021－22財政年度	-8.4%
2022－23財政年度	5.3%

(三) 基金的投資經理公司資料

	聘請的投資經紀公司名稱／ 外匯基金／其他	佔本金的百分比 (截至最新年結日)
本地投資公司 (即在香港註冊成立的公司)		
1.	威靈頓管理香港有限公司	30%
2.	景順投資管理有限公司	6%
3.	聯博香港有限公司	14%
外國投資公司 (即並非在香港註冊成立的公司)		
4.	Northern Trust Global Investments Limited	16%
外匯基金		
5.	外匯基金存款	22%
其他		
6.	銀行存款	12%
	總計	100%

由政策局／部門設立的基金

政策局／部門：教育局／大學教育資助委員會基金名稱：研究基金

(一) 基金的盈餘狀況

最新年結日	2023年8月31日
於最新年結日的基金結餘 (百萬元)	52,378
累計盈餘／(虧損) (百萬元) (截至最新年結日)	6,378

(二) 基金的投資回報率

基金沒有制定目標投資回報率。基金的投資全數為外匯基金存款及／或銀行存款。

(三) 基金的投資經理公司資料

	聘請的投資經紀公司名稱／ 外匯基金／其他	佔本金的百分比 (截至最新年結日)
外匯基金		
1.	外匯基金存款	100%
	總計	100%

由政策局／部門設立的基金

政策局／部門：教育局基金名稱：語文基金

(一) 基金的盈餘狀況

最新年結日	2022年8月31日
於最新年結日的基金結餘 (百萬元)	7,112
累計盈餘／(虧損) (百萬元) (截至最新年結日)	2,112

(二) 基金的投資回報率

基金沒有制定目標投資回報率。基金的投資全數為外匯基金存款及／或銀行存款。

(三) 基金的投資經理公司資料

	聘請的投資經紀公司名稱／ 外匯基金／其他	佔本金的百分比 (截至最新年結日)
外匯基金		
1.	外匯基金存款	99%
其他		
2.	銀行存款	1%
	總計	100%

由政策局／部門設立的基金

政策局／部門：教育局基金名稱：資歷架構基金

(一) 基金的盈餘狀況

最新年結日	2022年8月31日
於最新年結日的基金結餘 (百萬元)	2,426
累計盈餘／(虧損) (百萬元) (截至最新年結日)	226

(二) 基金的投資回報率

基金沒有制定目標投資回報率。基金的投資全數為外匯基金存款及／或銀行存款。

(三) 基金的投資經理公司資料

	聘請的投資經紀公司名稱／ 外匯基金／其他	佔本金的百分比 (截至最新年結日)
外匯基金		
1.	外匯基金存款	99%
其他		
2.	銀行存款	1%
	總計	100%

由政策局／部門設立的基金

政策局／部門：教育局基金名稱：資優教育基金

(一) 基金的盈餘狀況

最新年結日	2022年8月31日
於最新年結日的基金結餘 (百萬元)	1,657
累計盈餘／(虧損) (百萬元) (截至最新年結日)	57

(二) 基金的投資回報率

基金沒有制定目標投資回報率。基金的投資全數為外匯基金存款及／或銀行存款。

(三) 基金的投資經理公司資料

	聘請的投資經紀公司名稱／ 外匯基金／其他	佔本金的百分比 (截至最新年結日)
外匯基金		
1.	外匯基金存款	>99%
其他		
2.	銀行存款	<1%
	總計	100%

由政策局／部門設立的基金

政策局／部門：教育局基金名稱：學生活動支援基金

(一) 基金的盈餘狀況

最新年結日	2022年8月31日
於最新年結日的基金結餘 (百萬元)	2,752
累計盈餘／(虧損) (百萬元) (截至最新年結日)	252

(二) 基金的投資回報率

基金沒有制定目標投資回報率。基金的投資全數為外匯基金存款及／或銀行存款。

(三) 基金的投資經理公司資料

	聘請的投資經紀公司名稱／ 外匯基金／其他	佔本金的百分比 (截至最新年結日)
外匯基金		
1.	外匯基金存款	97%
其他		
2.	銀行存款	3%
	總計	100%

由政策局／部門設立的基金

政策局／部門：文化體育及旅遊局基金名稱：衛奕信勳爵文物信託

(一) 基金的盈餘狀況

最新年結日	2023年3月31日
於最新年結日的基金結餘 (百萬元)	74.58
累計盈餘／(虧損) (百萬元) (截至最新年結日)	26.06

(二) 基金的投資回報率

基金設有受託人委員會，聘用專業投資經理管理投資事務。

為基金制定的目標投資回報率	3個月香港銀行同業 拆息利率 + 5% 2019：7.18% 2020：6.11% 2021：5.20% 2022：7.16% 2023：9.78%
實際投資回報率	
2018－19財政年度	15.07%
2019－20財政年度	9.67%
2020－21財政年度	5.23%
2021－22財政年度	-12.13%
2022－23財政年度	5.77%

(三) 基金的投資經理公司資料

	聘請的投資經紀公司名稱／ 外匯基金／其他	佔本金的百分比 (截至最新年結日)
本地投資公司 (即在香港註冊成立的公司)		
1.	東方匯理資產管理香港有限公司	94%
其他		
2.	銀行存款	6%
	總計	100%

由政策局／部門設立的基金

政策局／部門：文化體育及旅遊局基金名稱：戴麟趾爵士康樂基金*

* 包括戴麟趾爵士康樂基金及其轄下的傷殘人士體育資助基金、體育資助基金及香港運動員基金

(一) 基金的盈餘狀況

最新年結日	2023年3月31日
於最新年結日的基金結餘 (百萬元)	433
累計盈餘／(虧損) (百萬元) (截至最新年結日)	85

(二) 基金的投資回報率

基金設有投資委員會監察基金的投資事宜。

為基金制定的目標投資回報率	約4%
實際投資回報率	
2018－19財政年度	3.8%
2019－20財政年度	-2.6%
2020－21財政年度	17.2%
2021－22財政年度	0.3%
2022－23財政年度	-0.9%

註：相關的基金屬長線投資，長遠的目標回報率為約4%，個別財政年度的回報會因應資產估值受當時的經濟及市場情況影響而有所差異，基金過去十年的整體實際平均回報率為4.4%。

(三) 基金的投資經理公司資料

	聘請的投資經紀公司名稱／ 外匯基金／其他	佔本金的百分比 (截至最新年結日)
外匯基金		
1.	外匯基金存款	39%
其他		
2.	盈富基金	20%

附件

3.	SPDR S&P 500 Exchange Traded Fund	23%
4.	銀行存款	18%
	總計	100%

由政策局／部門設立的基金

政策局／部門：文化體育及旅遊局基金名稱：精英運動員發展基金

(一) 基金的盈餘狀況

最新年結日	2023年3月31日
於最新年結日的基金結餘 (百萬元)	10,649
累計盈餘／(虧損) (百萬元) (截至最新年結日)	(2,350)*

* 虧損是包括動用了基金本金的金額。在2011年立法會財務委員會(財委會)批准成立該基金時，考慮到投資回報或不足以應付香港體育學院營運所需，財委會授權當時的民政事務局局长可在考慮體育委員會的意見後，動用基金的部分本金，以應付有關需要，而基金就此亦有動用部分本金。

(二) 基金的投資回報率

基金沒有制定目標投資回報率。基金的投資全數為外匯基金存款及／或銀行存款，基金一直賺取與香港外匯基金表現掛鈎的投資回報。基金會適時檢討有關策略。

(三) 基金的投資經理公司資料

	聘請的投資經紀公司名稱／ 外匯基金／其他	佔本金的百分比 (截至最新年結日)
外匯基金		
1.	外匯基金存款	90%
其他		
2.	銀行存款	10%
	總計	100%

由政策局／部門設立的基金

政策局／部門：民政及青年事務局基金名稱：尤德爵士紀念基金

(一) 基金的盈餘狀況

最新年結日	2023年3月31日
於最新年結日的基金結餘 (百萬元)	106
累計盈餘／(虧損) (百萬元) (截至最新年結日)	14

(二) 基金的投資回報率

基金沒有制定目標投資回報率。基金根據法例設有信託委員會，委員會聘用了專業投資經理協助管理投資事務。信託委員會會定期與投資經理進行會議，參考一系列市場指數，檢討基金投資策略及資產配置，以監管基金的投資表現。

實際投資回報率	
2018－19財政年度	-0.75%
2019－20財政年度	-2.25%
2020－21財政年度	16.11%
2021－22財政年度	0.06%
2022－23財政年度	-1.76%

(三) 基金的投資經理公司資料

	聘請的投資經紀公司名稱／ 外匯基金／其他	佔本金的百分比 (截至最新年結日)
外國投資公司 (即並非在香港註冊成立的公司)		
1.	瑞士信貸銀行 香港分行	98.5%
其他		
2.	銀行存款	1.5%
	總計	100%

由政策局／部門設立的基金

政策局／部門：民政及青年事務局基金名稱：姬達爵士獎學基金

(一) 基金的盈餘狀況

最新年結日	2023年3月31日
於最新年結日的基金結餘 (百萬元)	5
累計盈餘／(虧損) (百萬元) (截至最新年結日)	0.4

(二) 基金的投資回報率

基金沒有制定目標投資回報率。鑒於基金規模較小，局方並沒有成立投資委員會或聘請外部基金經理負責基金的投資事務。基金的所有資產，除了一小部分金額保留在儲蓄帳戶中外，其餘都一直被放置在定期存款中，以產生利息收入，用於支發放獎學金，而每年發放獎學金的金額是基於定期存款所得之年度預估收入而訂定。基金實際投資回報率如下：

實際投資回報率	
2018－19財政年度	1.04%
2019－20財政年度	1.93%
2020－21財政年度	2.40%
2021－22財政年度	0.44%
2022－23財政年度	0.53%

(三) 基金的投資經理公司資料

	聘請的投資經紀公司名稱／ 外匯基金／其他	佔本金的百分比 (截至最新年結日)
其他		
1.	基金的所有資產，除了一小部分金額保留在港幣儲蓄帳戶中外，其餘都一直被放置在定期存款中，以產生利息收入。	100%
	總計	100%

由政策局／部門設立的基金

政策局／部門：勞工及福利局／社會福利署基金名稱：香港展能精英運動員基金

(一) 基金的盈餘狀況

最新年結日	2023年3月31日
於最新年結日的基金結餘 (百萬元)	259.9
累計盈餘／(虧損) (百萬元) (截至最新年結日)	27.6

(二) 基金的投資回報率

基金沒有制定目標投資回報率。基金的投資全數為外匯基金存款、上市股本證券及／或銀行存款。

(三) 基金的投資經理公司資料

	聘請的投資經紀公司名稱／ 外匯基金／其他	佔本金的百分比 (截至最新年結日)
外匯基金		
1.	外匯基金存款	55%
其他		
2.	上市股本證券	27%
3.	銀行存款	18%
	總計	100%

由政策局／部門設立的基金

政策局／部門：勞工及福利局／社會福利署基金名稱：社會工作訓練基金

(一) 基金的盈餘狀況

最新年結日	2023年3月31日
於最新年結日的基金結餘 (百萬元)	19.3
累計盈餘／(虧損) (百萬元) (截至最新年結日)	0.4

(二) 基金的投資回報率

基金沒有制定目標投資回報率。基金的投資全數為外匯基金存款及／或銀行存款。

(三) 基金的投資經理公司資料

	聘請的投資經紀公司名稱／ 外匯基金／其他	佔本金的百分比 (截至最新年結日)
外匯基金		
1.	外匯基金存款	72%
其他		
2.	銀行存款	28%
	總計	100%

由政策局／部門設立的基金

政策局／部門：環境及生態局基金名稱：環境及自然保育基金

(一) 基金的盈餘狀況

最新年結日	2023年3月31日
於最新年結日的基金結餘 (百萬元)	6,150
累計盈餘／(虧損) (百萬元) (截至最新年結日)	1,150

(二) 基金的投資回報率

基金設有投資委員會。基金的投資全數為外匯基金存款及／或銀行存款。

(三) 基金的投資經理公司資料

	聘請的投資經紀公司名稱／ 外匯基金／其他	佔本金的百分比 (截至最新年結日)
外匯基金		
1.	外匯基金存款	99.9%
其他		
2.	銀行存款	0.1%
	總計	100%

由政策局／部門設立的基金

政策局／部門：保安局基金名稱：禁毒基金

(一) 基金的盈餘狀況

最新年結日	2023年3月31日
於最新年結日的基金結餘 (百萬元)	4,104
累計盈餘／(虧損) (百萬元) (截至最新年結日)	754

(二) 基金的投資回報率

基金設有投資小組委員會，聘用專業投資經理管理投資事務。

為基金制定的目標投資回報率	4%
實際投資回報率	
2018－19財政年度	2.7%
2019－20財政年度	-4.3%
2020－21財政年度	22.3%
2021－22財政年度	-2.6%
2022－23財政年度	-3.3%

註：相關基金屬長線投資，長遠的目標回報率為4%，個別財政年度的回報會因應資產估值受當時的經濟及市場情況影響而有所差異，基金過去十年的平均實際回報率為4.2%。

(三) 基金的投資經理公司資料

	聘請的投資經紀公司名稱／ 外匯基金／其他	佔本金的百分比 (截至最新年結日)
本地投資公司 (即在香港註冊成立的公司)		
1.	貝萊德資產管理北亞有限公司	31%
2.	滙豐環球投資管理 (香港) 有限公司	14%
外國投資公司 (即並非在香港註冊成立的公司)		
3.	MFS International (U.K.) Limited	19%
4.	Wellington Management Company LLP	13%

外匯基金		
5.	外匯基金存款	14%
其他		
6.	銀行存款	9%
	總計	100%