

勞工退休基金運用情形

一、勞工退休基金整體績效

(一) 本年度迄今(108年6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
新制基金	7.47%	0.77%	10.32%	16.23%	5.57%
舊制基金	8.46%				

註：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。

(二) 近一年(107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
新制基金	-2.07%	0.94%	-8.60%	-9.42%	-1.20%
舊制基金	-2.15%				

(三) 近三年(105~107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
新制基金	2.77%	0.95%	5.27%	6.60%	2.70%
舊制基金	3.13%				

(四) 近五年(103~107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
新制基金	2.80%	1.17%	2.47%	4.26%	1.08%
舊制基金	3.17%				

二、基金運用概況表

(一) 基金規模與投資績效

1. 新制勞工退休基金

至 108 年 6 月底止基金規模與收益			
基金運用規模			2 兆 3,371 億 1,490 萬元
108 年截至 6 月底止 運用總損益及評價後報酬率	自行運用	國內固定收益	36 億 7,880 萬元 1.04%
		國內權益證券 及國外投資	203 億 8,961 萬元 7.31%
	委託經營		1,450 億 2,049 萬元 11.39%
	合 計		1,690 億 8,890 萬元 7.47%

註 1：勞工退休金條例施行細則第 34 條規定收益率事項應另以本局公告為準。

註 2：評價後報酬率係以當期報酬率（即收益÷108 年之日平均餘額）列示，惟國內固定收益係以年化報酬率列示。

註 3：108 年 6 月之保證收益率為 1.0541%。

2. 舊制勞工退休基金

至 108 年 6 月底止基金規模與收益			
基金運用規模			9,533 億 8,050 萬元
108 年截至 6 月底止 運用總損益及評價後報酬率	自行運用	國內固定收益	11 億 8,635 萬元 0.95%
		國內權益證券 及國外投資	236 億 7,739 萬元 10.92%
	委託經營		468 億 4,342 萬元 10.48%
	合 計		717 億 716 萬元 8.46%

註：評價後報酬率係以當期報酬率（即收益÷108 年之日平均餘額）列示，惟國內固定收益係以年化報酬率列示。

(二) 資產配置

1. 新制勞工退休基金

截至 108 年 6 月底

單位：新台幣元

項 目	餘 額	占基金運用比例(%)
自行運用	1,034,430,089,871	44.26
轉存金融機構	493,687,628,913	21.11
短期票券	48,763,722,981	2.09
公債、公司債、金融債券及特別股	201,815,278,581	8.64
股票及受益憑證投資(含期貨)	89,769,052,704	3.84
國外投資	200,394,406,692	8.58
固定收益	137,819,511,683	5.90
權益證券	30,997,936,619	1.33
另類投資	31,576,958,390	1.35
委託經營	1,302,684,806,377	55.74
國內委託經營	324,948,403,234	13.90
國外委託經營	977,736,403,143	41.84
固定收益	239,977,680,004	10.27
權益證券	509,296,470,387	21.79
另類投資	228,462,252,752	9.78
合 計	2,337,114,896,248	100.00

2. 舊制勞工退休基金

截至 108 年 6 月底

單位：新台幣元

項 目	餘 額	占基金運用比例(%)
自行運用	485,687,220,663	50.94
轉存金融機構	156,473,393,526	16.41
短期票券	41,700,301,975	4.37
公債、金融債券、公司債及證券化商品	70,756,117,709	7.42
股票及受益憑證投資(含期貨)	94,006,433,296	9.86
國外投資	122,750,974,157	12.88
固定收益	63,436,124,631	6.65
權益證券	41,831,627,263	4.40
另類投資	17,483,222,263	1.83
委託經營	467,693,280,880	49.06
國內委託經營	108,626,785,083	11.40
國外委託經營	359,066,495,797	37.66
固定收益	100,685,711,848	10.56
權益證券	200,471,702,046	21.03
另類投資	57,909,081,903	6.07
合 計	953,380,501,543	100.00

(三) 基金自營投資與委外投資比例

1. 新制勞工退休基金

截至 108 年 6 月底

單位：新台幣元

項 目	金 額	占基金運用比例(%)
自行運用	1,034,430,089,871	44.26
委託經營	1,302,684,806,377	55.74

2. 舊制勞工退休基金

截至 108 年 6 月底

單位：新台幣元

項 目	金 額	占基金運用比例(%)
自行運用	485,687,220,663	50.94
委託經營	467,693,280,880	49.06

(四)基金國內投資與國外投資比例

1. 新制勞工退休基金

截至 108 年 6 月底

單位：新台幣元

項 目	金 額	占基金運用比例 (%)
國 內 投 資	1,158,984,086,413	49.58
國 外 投 資	1,178,130,809,835	50.42

2. 舊制勞工退休基金

截至 108 年 6 月底

單位：新台幣元

項 目	金 額	占基金運用比例 (%)
國 內 投 資	471,563,031,589	49.46
國 外 投 資	481,817,469,954	50.54

三、基金自營投資概況

(一)基金自營投資績效 (國內權益證券)

1. 新制勞工退休基金

截至 108 年 6 月底

項 目	收益率 (%)
國內權益證券	8.25

2. 舊制勞工退休基金

截至 108 年 6 月底

項 目	收益率 (%)
國內權益證券	10.63

(二)基金自營股票及受益憑證投資比例概況

1. 新制勞工退休基金

截至 108 年 6 月底 單位：新台幣元

項 目	金 額	比 例 (%)
國內權益證券	89,769,052,704	3.84

2. 舊制勞工退休基金

截至 108 年 6 月底 單位：新台幣元

項 目	金 額	比 例 (%)
國內權益證券	94,006,433,296	9.86

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

1. 新制勞工退休基金

96 年第一次委託經營(續約 3)

單位：新台幣元

投信 名稱	委託金額	目前淨資產	108 年截至 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (105.9.27~108.6.30)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤/目標 報酬率(%)
野村	15,000,000,000	17,634,518,607	4.65	17.56	—	16.71/16.76

97 年第一次委託經營(續約 3)

單位：新台幣元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	108 年截至 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (106.1.20~108.6.30)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤/目標 報酬率(%)
野村	7,198,313,969	8,499,425,139	4.61	18.08	—	15.16/14.91

98 年第一次委託經營(續約 3)

單位：新台幣元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	108 年截至 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (107.7.16~108.6.30)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤/目標 報酬率(%)
野村	12,940,861,671	12,606,171,831	4.67	-2.59	2	-1.23/6.01
保德信	5,153,416,157	5,020,944,148	5.59	-2.57	1	
合計	18,094,277,828	17,627,115,979	4.93	-2.58	—	

99 年第二次委託經營(續約 2)

單位：新台幣元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	108 年截至 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (107.12.3~108.6.30)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤/目標 報酬率(%)
國泰	9,241,043,825	9,345,791,179	0.94	1.13	—	8.52/3.66

100 年第一次委託經營(續約)(相對報酬)

單位：新台幣元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	108 年截至 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (104.7.15~108.6.30)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤/指標 報酬率(%)
復華	14,358,076,699	19,108,017,300	8.26	33.08	1	18.68/32.82
滙豐中華	15,278,501,877	19,422,137,051	7.70	27.12	2	
合計	29,636,578,576	38,530,154,351	7.98	30.01	—	

註：本次委託為相對報酬委託經營，以就業 99 指數為指定指標。

100 年第二次委託經營(續約)

單位：新台幣元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	108 年截至 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (104.8.10~108.6.30)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤/目標 報酬率(%)
復華	17,101,520,990	21,583,246,405	7.15	26.21	—	27.11/23.53

101 年第一次委託經營(續約)(相對報酬)

單位：新台幣元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	108 年截至 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (105.4.18~108.6.30)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤/指標 報酬率(%)
國泰	5,387,135,656	7,526,087,921	10.66	39.70	1	23.34/40.41
滙豐中華	10,927,481,593	14,914,351,695	11.22	36.48	2	
合計	16,314,617,249	22,440,439,616	11.03	37.55	—	

註：本次委託為相對報酬委託經營，以加權股價報酬指數為指定指標。

101 年第二次委託經營(續約)

單位：新台幣元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	108 年截至 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (105.7.18~108.6.30)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤/目標 報酬率(%)
野村	6,850,998,495	8,249,597,727	4.62	20.41	2	19.90/17.90
統一	8,019,680,328	10,215,314,085	4.66	31.64	1	
合計	14,870,678,823	18,464,911,812	4.64	26.06	—	

102 年第一次委託經營(續約)

單位：新台幣元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	108 年截至 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (106.6.7~108.6.30)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤/目標 報酬率(%)
統一	4,126,252,099	5,167,270,630	4.85	33.76	1	5.14/12.67
復華	6,481,866,342	7,543,385,553	4.52	16.38	2	
合計	10,608,118,441	12,710,656,183	4.65	22.29	—	

102 年第二次委託經營(續約) (相對報酬)

單位：新台幣元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	108 年截至 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (107.1.22~108.6.30)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤/指標 報酬率(%)
統一	7,009,597,591	7,728,628,291	10.70	10.26	1	-3.77/1.22
復華	10,038,542,112	9,825,389,317	11.76	-1.15	4	
群益	6,918,664,544	7,270,343,828	9.21	5.08	2	
滙豐中華	5,006,530,255	4,886,592,623	9.93	-1.08	3	
合計	28,973,334,502	29,710,954,059	10.53	2.42	—	

註：本次委託為相對報酬委託經營，以加權股價報酬指數為指定指標。

103 年第一次委託經營第一期(續約)

單位：新台幣元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	108 年截至 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (107.8.13~108.6.30)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤/目標 報酬率(%)
統一	9,046,774,993	9,110,704,795	5.69	0.71	1	-2.30/5.54
復華	8,967,102,893	8,253,559,762	6.56	-7.96	2	
合計	18,013,877,886	17,364,264,557	6.10	-3.61	—	

103 年第一次委託經營第二期(續約)

單位：新台幣元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	108 年截至 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (107.10.8~108.6.30)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤/目標 報酬率(%)
台新	7,934,673,726	8,567,426,947	8.01	7.97	1	2.03/4.60
群益	8,622,603,994	8,957,978,867	5.19	3.89	2	
合計	16,557,277,720	17,525,405,814	6.55	5.85	—	

103 年第二次委託經營(相對報酬)

單位：新台幣元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	108 年截至 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (106.12.1~108.6.30)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤/指標 報酬率(%)
國泰	3,000,000,000	3,230,629,544	9.97	7.69	2	1.61/8.81
統一	3,000,000,000	3,244,475,954	9.48	8.15	1	
復華	3,000,000,000	3,208,550,905	9.78	6.95	3	
滙豐中華	3,000,000,000	3,182,430,398	10.20	6.08	4	
安聯	3,000,000,000	3,181,193,913	11.05	6.04	5	
合計	15,000,000,000	16,047,280,714	10.09	6.98	—	

註：本次委託為相對報酬委託經營，採分批撥款，上述績效係採幾何報酬率計算；以臺灣高薪 100 報酬指數為指定指標。

104 年第一次委託經營 (續約)

單位：新台幣元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	108 年截至 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (108.4.1~108.6.30)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤/目標 報酬率(%)
統一	8,286,046,084	8,252,479,690	-0.41	-0.41	3	0.84/1.60
復華	3,651,168,229	3,703,048,757	1.42	1.42	1	
安聯	2,973,766,298	3,001,434,598	0.93	0.93	2	
合計	14,910,980,611	14,956,963,045	0.31	0.31	—	

106 年第一次委託經營

單位：新台幣元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	108 年截至 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (107.2.7~108.6.30)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤/目標 報酬率(%)
台新	5,000,000,000	4,945,681,903	4.82	-6.32	7	3.14/8.43
安聯	5,000,000,000	5,578,675,732	10.38	14.17	1	
保德信	5,000,000,000	5,188,323,983	6.11	2.76	4	
國泰	5,000,000,000	4,936,475,389	0.84	-3.32	6	
復華	5,000,000,000	5,199,274,876	5.18	4.03	3	
群益	5,000,000,000	5,054,842,409	5.90	1.05	5	
滙豐中華	5,000,000,000	5,302,842,816	6.65	7.19	2	
合計	35,000,000,000	36,206,117,108	5.72	2.77	—	

107 年第一次委託經營(相對報酬)

單位：新台幣元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	108 年截至 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (107.10.24~108.6.30)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤/指標 報酬率(%)
台新	2,000,000,000	2,237,311,302	10.83	11.87	1	9.78/8.06
安聯	2,000,000,000	2,213,685,611	10.89	10.68	2	
保德信	2,000,000,000	2,176,684,369	10.06	8.83	5	
統一	2,000,000,000	2,173,484,242	10.49	8.67	7	
國泰	2,000,000,000	2,174,405,309	9.63	8.72	6	
復華	2,000,000,000	2,200,588,591	10.53	10.03	3	
群益	2,000,000,000	2,179,016,286	9.06	8.95	4	
合計	14,000,000,000	15,355,175,710	10.21	9.68	—	

註：本批次委託為相對報酬委託經營，以臺灣永續報酬指數為指定指標。

107 年第二次委託經營

單位：新台幣元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	108 年截至 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (108.5.24~108.6.30)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤/目標 報酬率(%)
安聯	3,000,000,000	3,040,494,063	1.35	1.35	3	4.10/0.65
施羅德	3,000,000,000	3,031,019,528	1.03	1.03	4	
統一	3,000,000,000	3,029,493,997	0.98	0.98	6	
野村	3,000,000,000	3,054,156,178	1.81	1.81	2	
國泰	3,000,000,000	3,026,703,196	0.89	0.89	7	
復華	3,000,000,000	3,054,576,468	1.82	1.82	1	
群益	3,000,000,000	3,030,334,296	1.01	1.01	5	
合計	21,000,000,000	21,266,777,726	1.27	1.27	—	

2. 舊制勞工退休基金

國內 98 年第二次委託經營(續約 3)

單位：新台幣元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	108 年截至 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (108.1.28~108.6.30)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤/目標 報酬率(%)
富邦	5,957,934,152	6,092,098,786	2.25	2.25	2	7.64/2.71
統一	6,491,384,983	6,744,230,583	3.90	3.90	1	
合計	12,449,319,135	12,836,329,369	3.11	3.11	—	

國內 101 年第一次委託經營(相對報酬)(續約)

單位：新台幣元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	108 截至 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (105.10.31~108.6.30)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤/指標 報酬率(%)
匯豐中華	5,684,367,652	6,901,207,778	11.16	21.41	—	15.30/26.04

註：本次委託為相對報酬委託經營，採分批撥款，上述績效係採幾何報酬率計算；以加權股價報酬指數為指定指標。

國內 101 年第二次委託經營(續約)

單位：新台幣元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	108 年截至 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (105.05.03~108.6.30)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤/目標 報酬率(%)
野村	16,650,814,154	22,085,622,117	4.10	32.64	—	28.08/19.13

國內 102 年第一次委託經營(續約)

單位：新台幣元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	108 年截至 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (106. 6. 7~108. 6. 30)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤/目標 報酬率(%)
統一	4, 126, 679, 953	5, 168, 068, 354	4. 85	33. 77	1	5. 14/12. 67
復華	12, 007, 032, 629	13, 973, 451, 113	4. 35	16. 38	2	
合計	16, 133, 712, 582	19, 141, 519, 467	4. 48	20. 17	—	

國內 104 年第一次委託經營(續約)

單位：新台幣元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	108 年截至 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (108. 4. 1~108. 6. 30)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤/目標 報酬率(%)
統一	8, 286, 785, 149	8, 253, 290, 473	-0. 40	-0. 40	3	0. 84/1. 60
復華	3, 651, 419, 951	3, 703, 331, 556	1. 42	1. 42	1	
安聯	2, 974, 008, 140	3, 001, 700, 397	0. 93	0. 93	2	
合計	14, 912, 213, 240	14, 958, 322, 426	0. 31	0. 31	—	

國內 106 年第一次委託經營

單位：新台幣元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	108 年截至 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (107. 2. 7~108. 6. 30)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤/目標 報酬率(%)
台新	5, 000, 000, 000	4, 945, 751, 720	4. 82	-6. 32	7	3. 14/8. 43
安聯	5, 000, 000, 000	5, 578, 865, 049	10. 38	14. 17	1	
保德信	5, 000, 000, 000	5, 188, 461, 887	6. 11	2. 77	4	
國泰	5, 000, 000, 000	4, 936, 580, 281	0. 84	-3. 32	6	
復華	5, 000, 000, 000	5, 199, 425, 595	5. 18	4. 03	3	
群益	5, 000, 000, 000	5, 055, 077, 401	5. 90	1. 06	5	
匯豐中華	5, 000, 000, 000	5, 303, 073, 394	6. 66	7. 19	2	
合計	35, 000, 000, 000	36, 207, 235, 327	5. 72	2. 77	—	

(二) 108 年 6 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

新制勞工退休基金：無

舊制勞工退休基金：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

新制勞工退休基金：無

舊制勞工退休基金：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

1. 新制勞工退休基金

97-1 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	108 年截至 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (105.6.6~108.6.30)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標報酬率 (%)
聯博	793,101,125	839,830,219	4.79	5.89	2	6.25
富蘭克林 坦伯頓	744,405,663	788,846,418	6.88	5.97	1	
合計	1,537,506,788	1,628,676,637	5.79	5.93	—	

97-2 全球增值債券型 (續約 2)

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	108 年截至 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (106.1.6~108.6.30)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標報酬率 (%)
PIMCO	1,019,586,290	1,137,561,658	6.10	12.56	—	11.55

97-2 全球增值股票型 (續約 2)

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	108 年截至 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (106.2.6~108.6.30)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標報酬率 (%)
貝萊德	967,348,593	1,254,040,593	17.29	29.64	1	26.06
摩根	802,177,668	1,013,703,555	16.45	26.37	2	
合計	1,769,526,261	2,267,744,148	16.91	28.16	—	

98-1 亞太 (日本除外) 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	108 年截至 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (106.11.17~108.6.30)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標報酬率 (%)
景順	902,621,073	873,333,260	9.58	-2.98	—	-0.86

98-1 全球被動股票型 (續約 2)

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	108 年截至 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (106.12.4~108.6.30)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標報酬率 (%)
貝萊德	535,489,288	577,952,721	16.39	7.93	2	7.40
道富	728,826,441	788,580,548	16.47	8.20	1	
合計	1,264,315,729	1,366,533,269	16.44	8.08	—	

99-1 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	108 年截至 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (107.8.27~108.6.30)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標報酬率 (%)
瑞萬通博	757,229,489	806,782,131	12.64	6.54	—	1.75

100-1 全球基本面指數被動股票型 (續約)

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	108 年截至 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (105.7.1~108.6.30)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標報酬率 (%)
道富	662,180,574	864,834,548	13.09	35.71	1	34.70
貝萊德	666,301,910	869,470,949	13.07	35.57	2	
合計	1,328,482,484	1,734,305,497	13.08	35.64	—	

100-1 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	108 年截至 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (106.3.6~108.6.30)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標報酬率 (%)
Cohen & Steers	1,051,936,411	1,310,703,042	16.79	25.87	1	19.10
景順	984,104,927	1,190,682,871	15.82	20.99	2	
合計	2,036,041,338	2,501,385,913	16.33	23.47	—	

101-1 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	108 年截至 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (106.7.31~108.6.30)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標報酬率 (%)
Ashmore	454,453,121	486,745,517	8.36	7.11	2	9.23
Pictet	454,291,634	493,455,560	9.52	8.62	1	
合計	908,744,755	980,201,077	8.94	7.86	—	

101-1 全球低波動指數被動股票型 (續約)

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	108年截至6月 累積投資報酬率(%)	委任迄今 (107.4.18~108.6.30)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標報酬率 (%)
道富	798,231,848	854,307,896	12.36	7.17	2	6.84
貝萊德	794,293,722	850,675,827	12.30	7.24	1	
合計	1,592,525,570	1,704,983,723	12.33	7.20	—	

102-1 全球高股利增值股票型 (續約)

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	108年截至6月 累積投資報酬率(%)	委任迄今 (108.1.22~108.6.30)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標報酬率 (%)
瑞萬通博	756,315,337	860,662,376	13.80	13.80	1	8.65
MFS	603,318,800	641,007,850	6.25	6.25	3	
威靈頓	631,647,315	704,134,591	11.48	11.48	2	
合計	1,991,281,452	2,205,804,817	10.77	10.77	—	

102-1 全球信用主動債券型 (續約)

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	108年截至6月 累積投資報酬率(%)	委任迄今 (108.4.25~108.6.30)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標報酬率 (%)
Bluebay	436,338,464	451,485,529	3.47	3.47	3	3.58
貝萊德	437,231,657	453,407,701	3.70	3.70	1	
盧米斯	442,703,100	458,621,420	3.60	3.60	2	
合計	1,316,273,221	1,363,514,650	3.59	3.59	—	

104-1 全球高品質被動股票型

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	108年截至6月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (104.8.11~108.6.30)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標報酬率 (%)
北美信託	650,000,000	965,904,649	19.25	47.13	1	46.32
LGIM	650,000,000	966,083,573	19.21	46.92	2	
Geode	650,000,000	963,788,950	19.23	46.63	3	
合計	1,950,000,000	2,895,777,172	19.23	46.89	—	

104-2 全球基礎建設有價證券型

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	108年截至6月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (104.9.25~108.6.30)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標報酬率 (%)
Cohen & Steers	350,000,000	468,175,056	20.26	33.58	4	40.52
麥格理	550,000,000	680,816,311	18.04	35.06	3	
Magellan	850,000,000	1,078,619,616	20.02	53.82	1	
RREEF	450,000,000	592,060,649	20.96	41.27	2	
合計	2,200,000,000	2,819,671,632	19.77	41.26	—	

104-1 全球主權信用增值債券型

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	108年截至6月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (104.11.13~108.6.30)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標報酬率 (%)
NNIP	200,000,000	209,717,278	5.12	10.29	3	18.73
Brandywine	500,000,000	546,153,134	6.90	19.39	1	
盧米斯	300,000,000	341,762,739	6.16	17.08	2	
合計	1,000,000,000	1,097,633,151	6.33	15.67	—	

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	108年截至6月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (105.7.20~108.6.30)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標/目標 報酬率(%)
安聯	450,000,000	465,381,125	4.16	3.83	4	5.34/20.08
摩根	900,000,000	1,044,012,951	9.64	24.28	1	
DWS	500,000,000	566,624,891	9.31	14.12	2	
柏瑞	600,000,000	666,164,539	8.91	13.09	3	
合計	2,450,000,000	2,742,183,506	8.43	14.61	—	

註：本批次為絕對報酬型。

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	108年截至6月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (105.8.24~108.6.30)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標報酬率 (%)
貝萊德	500,000,000	595,909,147	8.32	21.20	1	21.76
北美信託	400,000,000	459,089,503	6.96	12.17	3	
領航	500,000,000	570,637,353	6.55	17.94	2	
合計	1,400,000,000	1,625,636,003	7.31	17.09	—	

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	108年截至6月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (106.6.22~108.6.30)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標報酬率 (%)
貝萊德	250,000,000	282,875,871	14.06	18.29	1	17.97
DWS	300,000,000	333,996,820	14.16	18.16	3	
道富	300,000,000	333,787,262	13.97	18.13	4	
北美信託	300,000,000	334,282,020	13.99	18.25	2	
合計	1,150,000,000	1,284,941,973	14.04	18.20	—	

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	108年截至6月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (106.7.25~108.6.30)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標/目標 報酬率(%)
American Century	400,000,000	413,480,233	3.50	3.51	4	3.59/8.43
富達	400,000,000	435,208,988	11.92	7.97	1	
富蘭克林 坦伯頓	400,000,000	415,002,937	3.03	4.33	3	
TCW	400,000,000	427,053,018	4.69	7.35	2	
合計	1,600,000,000	1,690,745,176	5.73	5.80	—	

註：本批次為絕對報酬型。

107-1 絕對報酬股票型

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	108年截至6月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (108.1.23~108.6.30)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標/目標 報酬率(%)
野村	200,000,000	195,209,102	-2.40	-2.40	5	1.11/3.29
景順	200,000,000	212,804,176	6.40	6.40	3	
威靈頓	200,000,000	218,472,277	9.24	9.24	2	
CPR	200,000,000	207,552,565	3.78	3.78	4	
道富	200,000,000	218,838,532	9.42	9.42	1	
合計	1,000,000,000	1,052,876,652	5.29	5.29	—	

註：本批次為絕對報酬型。

2. 舊制勞工退休基金

96 國際平衡型(續約 3)

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	108 年截至 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (108.6.24~108.6.30)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
富達	886,579,222	887,690,543	0.13	0.13	—	0.17

97-1 全球增值債券型(續約 2)

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	108 年截至 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (106.1.6~108.6.30)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
PIMCO	923,576,760	1,041,007,478	6.11	12.71	1	11.56
盧米斯	698,763,197	780,932,265	5.94	11.76	2	
合計	1,622,339,957	1,821,939,743	6.04	12.30	—	

97-1 全球增值股票型(續約 2)

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	108 年截至 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (106.2.6~108.6.30)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
貝萊德	756,337,413	980,739,033	17.31	29.67	—	26.06

98-1 亞太(日本除外)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	108 年截至 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (106.11.17~108.6.30)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
景順	507,323,526	492,195,599	9.57	-2.98	—	-0.86

100-1 全球基本面指數被動股票型(續約)

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	108年截至6月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (106.3.6~108.6.30)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
貝萊德	405,588,950	469,590,816	13.22	15.78	3	14.92
道富	408,539,391	472,992,467	13.23	15.78	4	
瑞銀	406,994,133	472,041,738	13.02	15.98	2	
野村	407,549,840	473,122,396	13.17	16.09	1	
合計	1,628,672,314	1,887,747,417	13.16	15.91	—	

101-1 全球低波動指數被動股票型(續約)

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	108年截至6月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (107.6.13~108.6.30)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
貝萊德	671,455,711	718,217,380	12.36	6.96	—	6.88

102-1 年全球高股利增值股票型(續約)

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	108年截至6月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (108.1.22~108.6.30)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
瑞萬通博	287,169,672	326,795,373	13.80	13.80	1	8.65
MFS	246,618,331	262,103,046	6.28	6.28	3	
威靈頓	503,548,464	561,398,339	11.49	11.49	2	
合計	1,037,336,467	1,150,296,758	10.89	10.89	—	

102-2 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	108年截至6月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (108.5.29~108.6.30)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
Lazard	563,987,041	583,508,656	3.46	3.46	—	3.70

102-2 全球不動產有價證券型

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	108年截至6月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (103.8.27~108.6.30)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
信安環球	300,000,000	404,119,630	17.26	36.74	1	24.59
AMP	100,000,000	124,294,262	18.12	23.76	2	
合計	400,000,000	528,413,892	17.46	32.56	—	

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	108年截至6月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (105.7.20~108.6.30)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標/目標 報酬率(%)
安聯	150,000,000	155,129,789	4.16	3.83	4	5.34/20.08
摩根	300,000,000	347,372,349	9.68	24.70	1	
DWS	150,000,000	171,023,297	9.18	14.05	2	
柏瑞	200,000,000	221,678,598	8.87	13.27	3	
合計	800,000,000	895,204,033	8.39	14.49	—	

註：本批次為絕對報酬型。

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	108 年截至 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (106. 6. 22~108. 6. 30)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
貝萊德	150,000,000	167,490,738	14.00	18.02	4	17.97
DWS	150,000,000	167,706,421	14.17	18.27	1	
道富	150,000,000	167,766,133	13.91	18.26	2	
北美信託	150,000,000	167,562,748	14.01	18.06	3	
合計	600,000,000	670,526,040	14.02	18.15	—	

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	108 年截至 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (106. 7. 25~108. 6. 30)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標/目標 報酬率(%)
American Century	300,000,000	309,304,507	3.53	3.59	4	3.59/8.43
富達	300,000,000	323,154,583	11.36	7.44	1	
富蘭克林 坦伯頓	300,000,000	308,520,064	2.73	4.38	3	
TCW	300,000,000	316,558,994	4.58	7.24	2	
合計	1,200,000,000	1,257,538,148	5.50	5.69	—	

註：本批次為絕對報酬型。

107-1 絕對報酬股票型

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	108 年截至 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (108. 1. 23~108. 6. 30)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標/目標 報酬率(%)
野村	40,000,000	39,042,011	-2.40	-2.40	5	1.11/3.29
景順	40,000,000	42,530,785	6.33	6.33	3	
威靈頓	40,000,000	43,706,827	9.27	9.27	2	
CPR	40,000,000	41,443,709	3.61	3.61	4	
道富	40,000,000	43,763,742	9.41	9.41	1	
合計	200,000,000	210,487,074	5.24	5.24	—	

註：本批次為絕對報酬型。

(二)108年6月被提前收回之國外委外投資帳戶

新制勞工退休基金：無

舊制勞工退休基金：無

六、基金投資衍生性金融商品概況表

(一)新制勞工退休基金自營部位

(依交易目的)

108年6月30日

1. 避險：

種類	避險比例
權益證券避險	0%
匯率避險	6.73%

2. 投資：無

(二)舊制勞工退休基金自營部位

(依交易目的)

108年6月30日

1. 避險：

種類	避險比例
權益證券避險	0%
匯率避險	0%

2. 投資：無

七、勞工退休基金財務收支表

(一)新制勞工退休基金

單位：新台幣元

	餘絀	收入	支出
108年6月	41,426,725,348	62,286,450,625	20,859,725,277

註：上述金額係依權責基礎填列。

(二)舊制勞工退休基金

單位：新台幣元

	餘絀	收入	支出
108年6月	17,222,202,981	18,981,265,130	1,759,062,149

註：上述金額係依權責基礎填列。

八、勞工退休基金投資運用現金收支表

(一)新制勞工退休基金

108年6月份

單位：新台幣元

項 目	金 額
基金收入	247,037,917,597
基金支出	250,612,075,915
現金增(減)數	-3,574,158,318

註：本表採現金基礎。

(二)舊制勞工退休基金

108年6月份

單位：新台幣元

項 目	金 額
基金收入	24,557,205,623
基金支出	24,556,458,482
現金增(減)數	747,141

註：本表採現金基礎。