

* 勞工退休基金整體績效

勞工退休基金 97 年 1 月迄今整體績效

截至 103 年 1 月底

新制基金	2.1125%
舊制基金	1.9070%

註：舊制基金自 76 年 6 月迄今之績效為 4.8154%

* 基金運用概況表

新制勞工退休基金

1. 基金規模與投資績效

單位：新台幣萬元；%

103 年 1 月底止基金規模與收益		
基金運用規模		1 兆 991 億 3,222 萬元
103 年截至 1 月底止 運用總損益及評價後報酬率	自行運用	7 億 4,169 萬元 0.14%
	委託經營	-84 億 2,134 萬元 -1.54%
	合計	-76 億 7,964 萬元 -0.71%

註 1：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。

註 2：103 年 1 月之保證收益率為 1.3916%。

資產配置

截至 103 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	533,962,178,518	48.58
轉存金融機構	220,330,710,574	20.05
短期票券	48,736,991,296	4.43
公債、公司債及金融債券	147,627,673,109	13.43
貨幣型基金	0	0.00
股票及受益憑證投資(含期貨)	6,437,491,319	0.59
國外投資	110,829,312,220	10.08
固定收益	96,309,816,055	8.76
權益證券	7,299,252,807	0.66
另類投資	7,220,243,358	0.66
委託經營	565,170,039,798	51.42
國內委託經營	225,314,346,670	20.50
國外委託經營	339,855,693,128	30.92
固定收益	127,694,161,019	11.62
權益證券	171,150,814,460	15.57
另類投資	41,010,717,649	3.73
合 計	1,099,132,218,316	100.00

舊制勞工退休基金

1. 基金規模與投資績效

單位：新台幣萬元

至 103 年 1 月底止基金規模與收益		
基金運用規模		6,064 億 5,462 萬元
103 年截至 1 月底止 運用總損益及評價後報酬率	自行運用	-17 億 9,590 萬元 -0.56%
	委託經營	-32 億 8,846 萬元 -1.28%
	合 計	-50 億 8,436 萬元 -0.88%

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

資產配置

截至 103 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	345,739,230,947	57.01
轉存金融機構	132,103,264,088	21.78
短期票券	30,091,383,799	4.96
公債、金融債券、公司債及證券化商品	56,141,414,940	9.26
貨幣型基金	0	0.00
股票及受益憑證投資(含期貨)	53,594,721,378	8.84
國外投資	73,808,446,742	12.17
固定收益	41,445,057,035	6.83
權益證券	26,768,269,072	4.42
另類投資	5,595,120,635	0.92
委託經營	260,715,392,392	42.99
國內委託經營	126,556,798,106	20.87
國外委託經營	134,158,594,286	22.12
固定收益類	56,038,793,065	9.24
權益證券	78,119,801,221	12.88
合 計	606,454,623,339	100.00

2. 基金自營投資與委外投資比例

新制勞工退休基金

截至 103 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	533,962,178,518	48.58
委託經營	565,170,039,798	51.42

舊制勞工退休基金

截至 103 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	345,739,230,947	57.01
委託經營	260,715,392,392	42.99

3. 基金國內投資與國外投資比例

新制勞工退休基金

截至 103 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	648,447,212,968	59.00
國 外 投 資	450,685,005,348	41.00

舊制勞工退休基金

截至 103 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	398,487,582,311	65.71
國 外 投 資	207,967,041,028	34.29

* 基金自營投資概況

1. 基金自營投資績效 (國內權益證券)

新制勞工退休基金

截至 103 年 1 月底

單位：%

項 目	收益率 (%)
國內權益證券 (ETF)	-2.20

舊制勞工退休基金

截至 103 年 1 月底

單位：%

項 目	收益率 (%)
國內權益證券	-3.07

2. 基金自營股票及受益憑證投資比例概況

新制勞工退休基金

截至 103 年 1 月底

單位：新台幣元

項 目	金 額	比 例 (%)
國內權益證券 (ETF)	6,437,491,319	0.59

舊制勞工退休基金

截至 103 年 1 月底

單位：新台幣元

項 目	金 額	占基金運用比例 (%)
國內權益證券	53,594,721,378	8.84

註：不含貨幣型基金

* 基金國內委外投資概況表

1. 基金國內委外投資績效、績效指標及排名表

新制勞工退休基金

96 年第一次委託經營安泰 (續約 2)

單位：新台幣元；%

投信名稱	委託金額	目前淨資產	103 年截至 1 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (102.9.27~103.1.31)		
				投資報酬率 (%)	委託經營排名	大盤/指標 報酬率(%)
安泰	7,804,845,205	7,890,362,699	-1.79	1.10	1	3.40
合計	7,804,845,205	7,890,362,699	-1.79	1.10	—	

97 年第一次委託經營安泰 (續約 2)

單位：新台幣元；%

投信名稱	委託金額	目前淨資產	103 年截至 1 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (103.1.20~103.1.31)		
				投資報酬率 (%)	委託經營排名	大盤/指標 報酬率(%)
安泰	5,783,138,827	5,698,531,929	-1.46	-1.46	1	-1.55
合計	5,783,138,827	5,698,531,929	-1.46	-1.46	—	

97 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	103 年截至 1 月 累積投資報酬 (%)	委任迄今 (100.10.8~103.1.31)		
				投資報酬率(%)	委託經營排名	大盤/指標報酬率(%)
富邦	6,747,919,987	7,125,002,989	-2.43	5.59	2	17.34
群益	7,256,147,326	7,763,537,863	-2.73	6.99	1	
合計	14,004,067,313	14,888,540,852	-2.59	6.32	—	

98 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	103 年截至 1 月 累積投資報酬 (%)	委任迄今 (101.7.14~103.1.31)		
				投資報酬率(%)	委託經營排名	大盤/指標報酬率(%)
安泰	3,421,364,679	3,843,915,128	-1.80	12.35	2	19.12
保德信	3,423,163,553	3,946,463,201	-1.79	15.29	1	
合計	6,844,528,232	7,790,378,329	-1.80	13.82	—	

99 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	103 年截至 1 月 累積投資報酬 (%)	委任迄今 (102.3.9~103.1.31)		
				投資報酬率(%)	委託經營排名	大盤/指標報酬率(%)
保德信	7,790,534,548	8,111,948,513	-1.91	4.13	1	5.58
合計	7,790,534,548	8,111,948,513	-1.91	4.13	—	

99 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	103 年截至 1 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (99.11.30~103.1.31)		
				投資報酬率(%)	委託經營排名	大盤/指標報酬率(%)
永豐	5,000,000,000	4,940,521,749	-2.51	-1.19	3	1.14
國泰	5,000,000,000	5,955,138,654	-0.54	19.10	1	
富邦	5,000,000,000	5,342,044,330	-2.39	6.84	2	
滙豐中華	5,000,000,000	4,649,686,008	-1.63	-7.01	4	
合計	20,000,000,000	20,887,390,741	-1.73	4.44	—	

100 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	103 年截至 1 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (100.7.15~103.1.31)		
				投資報酬率(%)	委託經營排名	大盤/指標報酬率(%)
國泰	5,000,000,000	6,036,836,912	-2.16	5.65	5	-0.22/ 11.79
富邦	5,000,000,000	6,018,681,768	-1.53	8.11	4	
復華	5,000,000,000	6,366,463,564	-1.62	10.12	2	
滙豐中華	12,034,391,172	13,546,076,494	-1.23	10.44	1	
元大寶來 (原寶來)	5,000,000,000	6,248,839,006	-0.25	9.24	3	
合計	32,034,391,172	38,216,897,744	-1.33	8.71	—	

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；以就業 99 指數為指定指標。

100 年第二次委託經營第一期

單位：新台幣元；%

投信名稱	委託金額	目前淨資產	103 年截至 1 月 累積投資報酬 (%)	委任迄今 (100. 8. 10~103. 1. 31)		
				投資報酬 率(%)	委託經 營排名	大盤/指 標報酬 率(%)
保德信	3,000,000,000	3,250,389,305	-1.11	8.35	2	12.94
統一	3,000,000,000	3,042,517,896	-2.03	1.42	4	
富邦	3,000,000,000	2,898,736,033	-2.21	-3.38	5	
復華	3,000,000,000	3,451,358,093	-0.73	15.05	1	
摩根	3,000,000,000	3,076,217,463	-0.58	2.54	3	
合計	15,000,000,000	15,719,218,790	-1.31	4.79	—	

100 年第二次委託經營第二期

單位：新台幣元；%

投信名稱	委託金額	目前淨資產	103 年截至 1 月 累積投資報酬 (%)	委任迄今 (100. 11. 23~103. 1. 31)		
				投資報酬 率(%)	委託經 營排名	大盤/指 標報酬 率(%)
保德信	2,000,000,000	2,223,923,318	-1.24	11.20	2	20.89
統一	2,000,000,000	2,165,887,449	-1.94	8.29	4	
富邦	2,000,000,000	2,065,454,337	-2.21	3.27	5	
復華	2,000,000,000	2,451,903,988	-0.70	22.60	1	
滙豐中華	2,000,000,000	2,210,407,631	-0.54	10.52	3	
摩根	2,000,000,000	2,062,303,905	-0.58	3.12	6	
合計	12,000,000,000	13,179,880,628	-1.19	9.83	—	

100 年第二次委託經營 A 帳戶

單位：新台幣元；%

投信 名稱	委託金額	目前淨資產	103 年截至 1 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (102.4.22~103.1.31)		
				投資報 酬率 (%)	委託經 營排名	大盤/指標 報酬率(%)
復華	4,511,827,956	4,763,594,548	-0.88	5.58	1	6.71
合計	4,511,827,956	4,763,594,548	-0.88	5.58	—	

101 年第一次委託(相對報酬)

單位：新台幣元；%

投信 名稱	委託金額	目前淨資產	103 年截至 1 月 累積投資報酬 (%)	委任迄今 (101.4.18~103.1.31)		
				投資報酬 率(%)	委託經 營排名	大盤/指 標報酬 率(%)
國泰	4,500,000,000	4,902,222,777	-2.23	15.01	3	11.56/ 19.14
富邦	4,500,000,000	4,878,251,732	-2.05	13.25	4	
滙豐中華	4,500,000,000	4,991,923,787	-1.20	17.57	2	
元大寶來 (原寶來)	4,500,000,000	5,049,007,145	-1.88	19.78	1	
合計	18,000,000,000	19,821,405,441	-1.84	16.39	—	

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。

101 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	103 年截至 1 月 累積投資報酬 (%)	委任迄今 (101.7.16~103.1.31)		
				投資報酬 率(%)	委託經 營排名	大盤/指 標報酬 率(%)
安泰	5,000,000,000	5,528,133,222	-1.77	10.56	2	19.12
保德信	5,000,000,000	5,365,297,533	-1.05	7.31	6	
國泰	5,000,000,000	5,391,431,753	-1.15	7.83	5	
統一	5,000,000,000	5,780,638,973	-0.82	15.61	1	
富邦	5,000,000,000	5,457,086,274	-2.50	9.14	4	
滙豐中華	5,000,000,000	5,517,037,158	-1.56	10.34	3	
合計	30,000,000,000	33,039,624,913	-1.48	10.13	—	

102 年第一次委託經營第一期

單位：新台幣元；%

投信名稱	委託金額	目前淨資產	103 年截至 1 月 累積投資報酬 (%)	委任迄今 (102.6.7~103.1.31)		
				投資報酬 率(%)	委託經 營排名	大盤/指 標報酬 率(%)
國泰	2,500,000,000	2,658,439,446	-1.11	6.34	1	4.53
統一	2,500,000,000	2,621,543,341	-2.39	4.86	2	
富邦	2,500,000,000	2,507,134,365	-4.00	0.29	6	
復華	2,500,000,000	2,594,205,348	-0.43	3.77	3	
德盛安 聯	2,500,000,000	2,592,608,811	-1.15	3.70	4	
摩根	2,500,000,000	2,550,497,877	-0.85	2.02	5	
合計	15,000,000,000	15,524,429,188	-1.66	3.50	—	

102 年第一次委託經營第二期

單位：新台幣元；%

投信名稱	委託金額	目前淨資產	103 年截至 1 月 累積投資報酬 (%)	委任迄今 (102.11.22~103.1.31)		
				投資報酬 率(%)	委託經 營排名	大盤/指 標報酬 率(%)
國泰	2,500,000,000	2,513,078,775	-0.96	0.52	4	4.48
統一	2,500,000,000	2,527,014,849	-1.72	1.08	2	
富邦	2,500,000,000	2,425,710,234	-4.13	-2.97	6	
復華	2,500,000,000	2,562,020,270	0.09	2.48	1	
德盛安 聯	2,500,000,000	2,515,428,137	-0.93	0.62	3	
摩根	2,500,000,000	2,490,032,886	-0.89	-0.40	5	
合計	15,000,000,000	15,033,285,151	-1.42	0.22	—	

102 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	103 年截至 1 月 累積投資報酬 (%)	委任迄今 (103.1.20~103.1.31)		
				投資報酬 率(%)	委託經 營排名	大盤/指 標報酬 率(%)
保德信	3,000,000,000	2,962,952,339	-1.23	-1.23	2	-1.55/ -1.55
統一	3,000,000,000	2,952,507,580	-1.58	-1.58	3	
富邦	3,000,000,000	2,928,075,852	-2.40	-2.40	6	
復華	3,000,000,000	2,964,712,240	-1.18	-1.18	1	
群益	3,000,000,000	2,941,991,533	-1.93	-1.93	4	
滙豐中 華	3,000,000,000	2,938,550,239	-2.05	-2.05	5	
合計	18,000,000,000	17,688,789,783	-1.73	-1.73	—	

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。

舊制勞工退休基金

國內 97 年第 1 次委託(續)

單位：新台幣元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	103 年截至 1 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (100.3.17~103.1.31)		
				投資 報酬率(%)	排名	大盤/指標 報酬率(%)
保德信	3,313,984,536	3,460,490,776	-1.29	4.42	1	1.66
群益	3,472,017,296	3,459,605,417	-2.33	-0.36	2	
合計	6,786,001,832	6,920,096,193	-1.81	1.98	—	

國內 98 年第 2 次委託(續)

單位：新台幣元

投信名稱	委託金額 (新台幣元)	目前淨資產 (新台幣元)	103 年截至 1 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (102.1.26~103.1.31)		
				投資 報酬率(%)	排名	大盤/指標 報酬率(%)
保德信	3,380,116,383	3,671,759,166	-1.94	8.63	2	10.30
富邦	3,208,581,038	3,413,199,266	-2.37	6.38	3	
統一	3,514,321,648	3,974,077,851	-1.90	13.08	1	
合計	10,103,019,069	11,059,036,283	-2.06	9.46	—	

國內 99 年第 1 次委託

單位：新台幣元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	103 年截至 1 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (99.8.13~103.1.31)		
				投資 報酬率(%)	排名	大盤/指標 報酬率(%)
保德信	4,000,000,000	3,846,663,345	-2.12	-3.83	6	8.08
群益	4,000,000,000	3,979,215,496	-2.53	-0.52	5	
復華	4,000,000,000	4,077,055,588	0.23	1.93	3	
國泰	4,000,000,000	4,240,780,880	-1.35	6.02	1	
永豐	4,000,000,000	4,203,957,793	-2.43	5.10	2	
日盛	4,000,000,000	4,073,547,870	-1.16	1.84	4	
合計	24,000,000,000	24,421,220,972	-1.56	1.76	—	

國內 100 年第 1 次委託

單位：新台幣元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	103 年截至 1 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (100.3.17~103.1.31)		
				投資 報酬率(%)	排名	大盤/指標 報酬率(%)
保德信	5,000,000,000	5,120,821,157	-1.96	2.42	5	1.66
群益	5,000,000,000	5,273,615,818	-2.48	5.47	3	
復華	5,000,000,000	5,351,860,882	-0.70	7.04	2	
國泰	5,000,000,000	5,214,734,036	-1.40	4.29	4	
統一	5,000,000,000	5,525,429,789	-1.88	10.51	1	
合計	25,000,000,000	26,486,461,682	-1.68	5.95	—	

國內 101 年第 1 次委託(相對報酬)

單位：新台幣元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	103 年截至 1 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (101.10.30~103.1.31)		
				投資 報酬率(%)	排名	大盤/指 標報酬率 (%)
匯豐中華	1,000,000,000	1,148,025,574	-1.19	21.69	2	22.85
元大寶來	1,000,000,000	1,163,404,356	-1.79	23.93	1	
合計	2,000,000,000	2,311,429,930	-1.49	22.81	—	

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 2 次委託

單位：新台幣元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	103 年截至 1 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (101.4.30~103.1.31)		
				投資 報酬率(%)	排名	大盤/指標 報酬率(%)
保德信	5,000,000,000	5,401,184,554	-0.89	8.02	5	13.13
群益	5,000,000,000	5,410,684,997	-2.77	8.21	4	
匯豐中華	5,000,000,000	5,555,530,142	-1.04	11.11	2	
安泰	5,000,000,000	5,732,319,415	-1.95	14.65	1	
國泰	5,000,000,000	5,445,321,433	-1.42	8.91	3	
統一	5,000,000,000	5,368,793,938	-1.99	7.38	6	
合計	30,000,000,000	32,913,834,479	-1.68	9.71	—	

國內 102 年第 1 次委託第 1 期

單位：新台幣元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	103 年截至 1 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (102.6.7~103.1.31)		
				投資 報酬率(%)	排名	大盤/指標 報酬率(%)
德盛安聯	2,500,000,000	2,592,648,123	-1.15	3.71	4	4.53
復華	2,500,000,000	2,594,260,453	-0.43	3.77	3	
國泰	2,500,000,000	2,658,483,863	-1.11	6.34	1	
富邦	2,500,000,000	2,507,195,046	-4.00	0.29	6	
摩根	2,500,000,000	2,550,540,998	-0.85	2.02	5	
統一	2,500,000,000	2,621,591,291	-2.39	4.86	2	
合計	15,000,000,000	15,524,719,774	-1.66	3.50	—	

國內 102 年第 1 次委託第 2 期

單位：新台幣元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	103 年截至 1 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (102.11.22~103.1.31)		
				投資 報酬率(%)	排名	大盤/指標 報酬率(%)
德盛安聯	2,500,000,000	2,515,443,501	-0.93	0.62	3	4.48
復華	2,500,000,000	2,562,032,105	0.09	2.48	1	
國泰	2,500,000,000	2,513,089,905	-0.96	0.52	4	
富邦	2,500,000,000	2,425,728,338	-4.13	-2.97	6	
摩根	2,500,000,000	2,490,043,706	-0.89	-0.40	5	
統一	2,500,000,000	2,527,026,402	-1.72	1.08	2	
合計	15,000,000,000	15,033,363,957	-1.42	0.22	—	

2. 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

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

*基金國外委外投資概況表

1. 基金國外委外投資績效、績效指標及排名表

新制勞工退休基金

97 -1 全球股票型續約

單位：美元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	103年截至1月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (101.5.21~103.1.31)		
				投資報酬率(%)	排名	大盤/指標報酬率(%)
坦伯頓	500,000,000	710,502,487.25	-3.89	52.99	—	36.24
合計	500,000,000	710,502,487.25	-3.89	52.99	—	

97-1 全球債券型續約

單位：美元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	103年截至1月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (101.6.4~103.1.31)		
				投資報酬率(%)	排名	大盤/指標報酬率(%)
聯博	750,000,000	764,386,349.94	1.15	1.92	3	1.34
高盛	400,000,000	408,975,472.77	0.39	2.24	2	
坦伯頓	650,000,000	716,324,012.38	-0.66	10.20	1	
合計	1,800,000,000	1,889,685,835.09	0.29	4.98	—	

97-2 全球增值債券型續約

單位：美元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	103年截至1月 累積投資報酬 (%)	委任迄今 (102.1.7~103.1.31)		
				投資報酬 率(%)	排名	大盤/指標報酬 率(%)
太平洋	615,416,988.32	605,738,759.45	0.62	-1.59	2	-0.44
高盛	479,694,715.54	479,573,639.92	0.34	-0.03	1	
合計	1,095,111,703.86	1,085,312,399.37	0.50	-0.90	—	

97-2 全球增值股票型續約

單位：美元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	103年截至1月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (102.2.5~103.1.31)		
				投資報酬 率(%)	排名	大盤/指標報酬 率(%)
貝萊德	384,277,868.70	454,988,204.24	-3.45	18.40	1	13.05
摩根	587,857,352.00	669,469,510.30	-3.93	13.88	2	
合計	972,135,220.70	1,124,457,714.54	-3.74	15.67	—	

98-1 亞太（日本除外）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1月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (102.11.18~103.1.31)		
				投資報酬 率(%)	排名	大盤/指標報酬 率(%)
景順	471,501,358	452,214,652.70	-4.85	-4.09	—	-5.55
合計	471,501,358	452,214,652.70	-4.85	-4.09	—	

98-1 全球被動股票型續約

單位：美元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	103年截至1月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (102.12.2~103.1.31)		
				投資報酬率(%)	排名	大盤/指標 報酬率(%)
貝萊德	299,329,552.00	292,443,427.80	-4.04	-2.30	2	-2.34
道富	349,680,272.54	341,676,780.97	-3.96	-2.29	1	
合計	649,009,824.54	634,120,208.77	-4.00	-2.29	—	

99-1 全球新興市場股票型

單位：美元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	103年截至1月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (99.8.24~103.1.31)		
				投資報酬率(%)	排名	大盤/指標 報酬率(%)
摩根士丹利	350,000,000	351,301,138.94	-5.49	7.89	2	3.13
瑞萬通博	450,000,000	464,751,027.26	-6.50	12.69	1	
合計	800,000,000	816,052,166.20	-6.07	10.74	—	

100-1 全球基本面指數股票型

單位：美元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	103年截至1月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (100.7.1~103.1.31、 100.7.13~103.1.31)		
				投資報酬率(%)	排名	大盤/指標 報酬率(%)
道富	300,000,000	364,664,561.06	-3.74	21.55	2	20.58
貝萊德	300,000,000	373,430,425.40	-3.86	24.47	1	24.01
合計	600,000,000	738,094,986.47	-3.80	23.01	—	—

註：其中道富委託日100.7.1 貝萊德委託日100.7.13

100-1 全球不動產股票型

單位：美元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	103年截至1月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (101.3.6~103.1.31)		
				投資報酬率(%)	排名	大盤/指標 報酬率(%)
Cohen & Steers	400,000,000	441,149,045.22	-0.93	18.85	1	15.36
景順	450,000,000	496,035,946.59	-1.07	18.37	2	
EII	400,000,000	442,476,743.86	-1.19	16.26	3	
合計	1,250,000,000	1,379,661,735.67	-1.06	17.65	—	

101-1 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1月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (101.7.31~103.1.31)		
				投資報酬率(%)	排名	大盤/指標 報酬率(%)
Ashmore	300,000,000	281,802,878.99	-2.29	-2.99	1	-2.64
Bluebay	300,000,000	280,549,981.67	-2.48	-4.45	2	
Stone Harbour	300,000,000	273,685,005.63	-2.70	-7.05	4	
Pictet	300,000,000	278,992,174.08	-1.99	-5.19	3	
合計	1,200,000,000	1,115,030,040.37	-2.36	-4.92	—	

101-1 全球低波動股

單位：美元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	103年截至1月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (102.4.18~103.1.31)		
				投資報酬率(%)	排名	大盤/指標 報酬率(%)
道富	500,000,000.00	488,319,345.43	-4.35	-2.56	1	-2.90
貝萊德	500,000,000.00	486,433,993.38	-4.32	-2.95	2	
合計	1,000,000,000.00	974,753,338.81	-4.34	-2.76	—	

102-1 全球高股利股票型

單位：美元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	103 年截至 1 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (103.1.22~103.1.31)		
				投資報 酬率(%)	排名	大盤/指標 報酬率(%)
瑞萬通博	150,000,000	142,633,291.49	-4.91	-4.91	3	-3.66
MFS	150,000,000	145,448,621.73	-3.03	-3.03	1	
威靈頓	150,000,000	143,971,929.02	-4.02	-4.02	2	
合計	450,000,000	432,053,842.24	-3.99	-3.99	—	

舊制勞工退休基金

96年續約國外委託經營(平衡型)

單位：美元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	103年截至1月 累積投資報酬 (%)	委任迄今 (100.6.21~103.1.31)		
				投資 報酬率(%)	排名	大盤/指標 報酬率(%)
富達國際	425,533,349.13	535,422,054.60	-1.48	23.65	-	20.69

97年續約國外委託經營(全球增值債券型)

單位：美元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	103年截至1月 累積投資報酬 (%)	委任迄今 (102.1.6~103.1.31)		
				投資 報酬率(%)	排名	大盤/指標 報酬率(%)
太平洋	731,384,465.68	716,731,718.30	0.47	-2.00	2	-0.44
盧米斯	712,476,555.58	703,907,300.81	0.78	-1.20	1	
合計	1,443,861,021.26	1,420,639,019.11	0.62	-1.61	-	

97年續約國外委託經營(全球增值股票型)

單位：美元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	103年截至1月 累積投資報酬 (%)	委任迄今 (102.2.5~103.1.31)		
				投資 報酬率(%)	排名	大盤/指標 報酬率(%)
貝萊德	384,953,368.29	455,726,530.10	-3.45	18.38	-	13.05

98 年續約國外委託經營(亞太股票型)

單位：美元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	103 年截至 1 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (102.11.17~103.1.31)		
				投資 報酬率(%)	排名	大盤/指標 報酬率(%)
景順	262,187,755.53	252,660,343.56	-4.67	-3.63	-	-5.55

100 年國外委託經營(全球基本面指數股票型)

單位：美元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	103 年截至 1 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (101.3.6~103.1.31)		
				投資 報酬率(%)	排名	大盤/指標 報酬率(%)
貝萊德	300,000,000	341,343,926.35	-3.79	27.16	4	26.94
道富	300,000,000	341,712,866.38	-3.80	27.55	1	
瑞銀環球	300,000,000	340,970,192.54	-3.88	27.24	3	
野村	300,000,000	341,526,247.53	-3.86	27.48	2	
合計	1,200,000,000	1,365,553,232.80	-3.83	27.36	—	

101 年國外委託經營(全球低波動指數股票型)

單位：美元

信名稱	委託金額	目前淨資產	103 年截至 1 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (102.6.13~103.1.31)		
				投資 報酬率(%)	排名	大盤/指標 報酬率(%)
貝萊德	100,000,000	100,694,954.37	-4.34	0.70	—	0.66

102 年國外委託經營(全球高股利增值股票型) 單位：美元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	103 年截至 1 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (103.1.22~103.1.31)		
				投資 報酬率(%)	排名	大盤/指標 報酬率(%)
瑞萬通博	100,000,000	95,088,942.51	-4.91	-4.91	3	-3.66
全盛	100,000,000	96,963,635.96	-3.04	-3.04	1	
威靈頓	100,000,000	95,979,538.80	-4.02	-4.02	2	
合計	300,000,000	288,032,117.27	-3.99	-3.99	—	

2. 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

新制勞工退休基金：無

舊制勞工退休基金：無

* 基金投資衍生性金融商品概況表

新制勞工退休基金自營部位

(依交易目的)

103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	8.77%

二、投資：無

舊制勞工退休基金自營部位

(依交易目的)

103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	2.22%

二、投資：無