

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(105年10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	2.70%	0.80%	11.42%	4.79%	6.80%
舊制基金	3.17%				

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。

(二) 近一年(104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	-0.09%	1.38%	-10.41%	-2.36%	-3.15%
舊制基金	-0.58%				

(三) 近三年(102~104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	3.64%	1.48%	2.69%	7.69%	-1.74%
舊制基金	4.35%				

(四) 近五年(100~104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	2.85%	1.41%	-1.46%	6.09%	0.90%
舊制基金	2.88%				

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 105 年 10 月底止基金規模與收益			
基金運用規模		1 兆 6,517 億 4,127 萬元	
105 年截至 10 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	43 億 1,993 萬元 0.99%
		國內權益證券 及國外投資	76 億 6,645 萬元 3.34%
	委託經營		306 億 5,680 萬元 3.72%
	合 計		426 億 4,318 萬元 2.70%

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÷105 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 3：105 年 10 月之保證收益率為 1.0541%。

2. 舊制勞工退休基金

至 105 年 10 月底止基金規模與收益			
基金運用規模		8,047 億 7,944 萬元	
105 年截至 10 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	22 億 395 萬元 0.92%
		國內權益證券 及國外投資	117 億 7,649 萬元 7.47%
	委託經營		82 億 1,590 萬元 2.61%
	合 計		221 億 9,634 萬元 3.17%

註：評價後報酬率係以當期報酬率（即收益÷105 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 105 年 10 月底

單位：新台幣元

項 目	餘 額	占基金運用比例(%)
自行運用	760,649,156,578	46.05
轉存金融機構	312,457,756,841	18.91
短期票券	47,686,807,860	2.89
公債、公司債、金融債券及特別股	161,772,811,528	9.80
股票及受益憑證投資(含期貨)	59,030,120,695	3.57
國外投資	179,701,659,654	10.88
固定收益	132,470,779,705	8.02
權益證券	27,064,815,502	1.64
另類投資	20,166,064,447	1.22
委託經營	891,092,115,652	53.95
國內委託經營	231,905,614,241	14.04
國外委託經營	659,186,501,411	39.91
固定收益	176,943,861,007	10.71
權益證券	321,280,854,147	19.45
另類投資	160,961,786,257	9.75
合 計	1,651,741,272,230	100.00

2. 舊制勞工退休基金

截至 105 年 10 月底

單位：新台幣元

項 目	餘 額	占基金運用比例(%)
自行運用	469,617,676,659	58.35
轉存金融機構	167,639,168,423	20.83
短期票券	28,967,813,600	3.60
公債、金融債券、公司債及證券化商品	98,698,262,878	12.26
股票及受益憑證投資(含期貨)	63,689,050,207	7.91
國外投資	110,623,381,551	13.75
固定收益	64,688,795,758	8.04
權益證券	34,689,676,546	4.31
另類投資	11,244,909,247	1.40
委託經營	335,161,758,361	41.65
國內委託經營	97,740,731,743	12.15
國外委託經營	237,421,026,618	29.50
固定收益	65,263,519,114	8.11
權益證券	132,414,500,549	16.45
另類投資	39,743,006,955	4.94
合 計	804,779,435,020	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 105 年 10 月底

單位：新台幣元

項 目	金 額	占基金運用比例(%)
自行運用	760,649,156,578	46.05
委託經營	891,092,115,652	53.95

2. 舊制勞工退休基金

截至 105 年 10 月底

單位：新台幣元

項 目	金 額	占基金運用比例(%)
自行運用	469,617,676,659	58.35
委託經營	335,161,758,361	41.65

(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 105 年 10 月底

單位：新台幣元

項 目	金 額	占基金運用比例 (%)
國內投資	812,853,111,165	49.21
國外投資	838,888,161,065	50.79

2. 舊制勞工退休基金

截至 105 年 10 月底

單位：新台幣元

項 目	金 額	占基金運用比例 (%)
國內投資	456,735,026,850	56.75
國外投資	348,044,408,170	43.25

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 105 年 10 月底

項 目	收益率 (%)
國內權益證券	16.06

2. 舊制勞工退休基金

截至 105 年 10 月底

項 目	收益率 (%)
國內權益證券	22.05

(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 105 年 10 月底 單位：新台幣元

項 目	金 額	比 例 (%)
國內權益證券	59,030,120,695	3.57

2. 舊制勞工退休基金

截至 105 年 10 月底 單位：新台幣元

項 目	金 額	比 例 (%)
國內權益證券	63,689,050,207	7.91

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	105 年截至 10 月 累積投資報酬 (%)	委任迄今 (105.9.27~105.10.31)		
				投資 報酬率 (%)	委託經 營排名	大盤 報酬率 (%)
野村	15,000,000,000	14,900,732,427	-0.66	-0.66	—	1.04

97 年第一次委託經營 (續約 2)

單位：新台幣元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	105 年截至 10 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (103.1.20~105.10.31)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤 報酬率(%)
野村	5,783,138,827	7,183,224,847	9.20	24.21	—	8.07

98 年第一次委託經營 (續約 2)

單位：新台幣元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	105 年截至 10 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (104.7.14~105.10.31)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤 報酬率(%)
野村	10,576,888,916	10,796,200,256	8.99	2.07	2	2.84
保德信	4,365,128,502	4,579,723,697	9.64	4.92	1	
合計	14,942,017,418	15,375,923,953	9.18	2.90	—	

99 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	105 年截至 10 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (103.12.1~105.10.31)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤 報酬率(%)
國泰	6,366,621,977	6,958,722,725	5.82	9.30	—	1.12

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	105 年截至 10 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (104.7.15~105.10.31)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤/指標 報酬率(%)
復華	14,358,076,699	15,106,164,087	10.83	5.21	2	2.75/ 5.68
滙豐中華	15,278,501,877	16,097,519,693	10.47	5.36	1	
合計	29,636,578,576	31,203,683,780	10.64	5.29	—	

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(續約)

單位：新台幣元

投信 名稱	委託金額	目前淨資產	105 年截至 10 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (104.8.10~105.10.31)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤 報酬率(%)
復華	17,101,520,990	17,942,724,707	6.75	4.92	—	10.04

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	105 年截至 10 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (105.4.18~105.10.31)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤/指標 報酬率(%)
國泰	5,387,135,656	6,039,798,187	12.12	12.12	2	6.78/ 11.20
滙豐中華	10,927,481,593	12,316,034,886	12.71	12.71	1	
合計	16,314,617,249	18,355,833,073	12.51	12.51	—	

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(續約)

單位：新台幣元

投信 名稱	委託金額	目前淨資產	105 年截至 10 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (105.7.18~105.10.31)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤 報酬率(%)
野村	6,850,998,495	6,967,245,503	1.70	1.70	2	3.80
統一	7,019,680,328	7,349,188,192	4.69	4.69	1	
合計	13,870,678,823	14,316,433,695	3.21	3.21	—	

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	105 年截至 10 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (102.6.7~105.10.31)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤 報酬率(%)
國泰	2,500,000,000	2,996,776,407	6.81	19.87	2	14.75
統一	2,500,000,000	2,930,359,092	3.54	17.21	3	
復華	2,500,000,000	3,069,279,051	6.71	22.77	1	
安聯	2,500,000,000	2,854,181,945	4.42	14.17	4	
合計	10,000,000,000	11,850,596,495	5.38	18.51	—	

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	105 年截至 10 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (102.11.22~105.10.31)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤 報酬率(%)
國泰	2,500,000,000	2,763,967,062	6.61	10.56	4	14.70
統一	2,500,000,000	2,733,867,022	3.35	9.35	5	
復華	2,500,000,000	2,998,202,241	6.65	19.93	1	
安聯	2,500,000,000	2,808,035,864	5.43	12.32	2	
摩根	2,500,000,000	2,776,026,780	9.23	11.04	3	
合計	12,500,000,000	14,080,098,969	6.23	12.64	—	

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	105 年截至 10 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (103.1.20~105.10.31)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤/指標 報酬率(%)
保德信	5,000,000,000	5,594,363,628	13.86	17.18	4	8.07/ 20.59
統一	5,000,000,000	5,653,377,741	11.84	18.28	3	
富邦	5,000,000,000	5,423,044,786	9.46	12.80	6	
復華	5,000,000,000	5,894,938,635	15.31	25.25	1	
群益	5,000,000,000	5,446,691,295	9.23	16.24	5	
滙豐中華	5,000,000,000	5,811,017,284	16.61	21.84	2	
合計	30,000,000,000	33,823,433,369	12.73	18.61	—	

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。

103 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	105 年截至 10 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (103.8.11~105.10.31)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤 報酬率(%)
國泰	7,000,000,000	7,500,150,853	8.85	7.15	1	2.25
統一	7,000,000,000	6,803,663,434	4.86	-2.80	3	
復華	7,000,000,000	6,891,674,868	6.08	-1.55	2	
合計	21,000,000,000	21,195,489,155	6.64	0.93	—	

103 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	105 年截至 10 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (103.10.8~105.10.31)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤 報酬率(%)
台新	7,000,000,000	7,349,928,574	7.44	5.00	1	2.76
保德信	7,000,000,000	7,312,508,005	7.93	4.46	2	
群益	7,000,000,000	7,005,827,034	7.46	0.08	3	
合計	21,000,000,000	21,668,263,613	7.61	3.18	—	

104 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	105 年截至 10 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (104.3.31~105.10.31)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤 報酬率(%)
永豐	2,500,000,000	2,540,164,733	6.91	1.61	3	-2.43
國泰	2,500,000,000	2,519,337,337	4.47	0.77	4	
統一	2,500,000,000	2,564,402,053	8.18	2.58	2	
復華	2,500,000,000	2,389,283,362	6.05	-4.43	6	
滙豐中華	2,500,000,000	2,599,383,044	9.92	3.98	1	
安聯	2,500,000,000	2,479,080,037	5.87	-0.84	5	
合計	15,000,000,000	15,091,650,566	6.90	0.61	—	

2. 舊制勞工退休基金

國內 98 年第二次委託經營(續 2)

單位：新台幣元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	105 年截至 10 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (105.1.26~105.10.31)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤 報酬率(%)
富邦	4,927,262,338	5,211,656,517	5.77	5.77	2	17.68
統一	5,071,927,246	5,474,067,798	7.93	7.93	1	
合計	9,999,189,584	10,685,724,315	6.87	6.87	—	

國內 100 年第一次委託經營(續)

單位：新台幣元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	105 年截至 10 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (104.3.17~105.10.31)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤 報酬率(%)
群益	6,094,525,480	5,691,397,850	5.88	-6.61	3	-2.34
復華	6,134,978,456	6,123,673,951	6.09	-0.18	1	
統一	6,511,946,664	6,294,363,570	5.05	-3.34	2	
合計	18,741,450,600	18,109,435,371	5.66	-3.37	—	

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	105 年截至 10 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (105.10.31~105.10.31)		
				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	5,679,161,376	-0.09	-0.09	—	-0.18/-0.18

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	105 年截至 10 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (105.5.3~105.10.31)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤 報酬率(%)
野村	16,650,814,154	17,898,923,606	7.50	7.50	—	10.89

國內 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	105 年截至 10 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (102.6.7~105.10.31)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤 報酬率(%)
安聯	2,500,000,000	2,854,491,312	4.42	14.18	4	14.75
復華	5,000,000,000	5,652,264,269	6.48	22.52	1	
國泰	2,500,000,000	2,997,085,775	6.82	19.88	2	
統一	2,500,000,000	2,930,715,689	3.54	17.23	3	
合計	12,500,000,000	14,434,557,045	5.24	18.35	—	

國內 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	105 年截至 10 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (102.11.22~105.10.31)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤 報酬率(%)
安聯	2,500,000,000	2,808,324,431	5.43	12.33	2	14.70
復華	5,000,000,000	5,580,835,143	6.44	19.70	1	
國泰	2,500,000,000	2,764,212,369	6.61	10.57	4	
摩根	2,500,000,000	2,776,341,701	9.24	11.05	3	
統一	2,500,000,000	2,734,173,728	3.35	9.37	5	
合計	15,000,000,000	16,663,887,372	5.95	12.35	—	

國內 102 年第一次委託經營 A 帳戶

單位：新台幣元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	105 年截至 10 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (104.3.16~105.10.31)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤 報酬率(%)
統一	5,118,273,278	4,935,687,634	4.81	-3.57	-	-3.02

國內 104 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	105 年截至 10 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (104.3.31~105.10.31)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤 報酬率(%)
永豐	2,500,000,000	2,540,268,724	6.91	1.61	3	-2.43
國泰	2,500,000,000	2,519,441,295	4.47	0.78	4	
統一	2,500,000,000	2,564,521,229	8.18	2.58	2	
復華	2,500,000,000	2,389,354,610	6.05	-4.43	6	
匯豐中華	2,500,000,000	2,599,526,937	9.92	3.98	1	
安聯	2,500,000,000	2,479,194,088	5.87	-0.83	5	
合計	15,000,000,000	15,092,306,883	6.90	0.62	—	

(二) 105 年 10 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 全球債券型 (續約 2)

單位：美元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	105 年截至 10 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (105.6.6~105.10.31)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
聯博	793,101,125	791,300,106	-0.23	-0.23	1	-0.77
坦伯頓	744,405,663	741,740,273	-0.36	-0.36	2	
合計	1,537,506,788	1,533,040,379	-0.29	-0.29	—	

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	105年截至10月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (102.1.7~105.10.31)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
太平洋	615,416,988	643,421,616	7.27	4.55	1	2.50
高盛	479,694,715	482,450,560	6.84	0.57	2	
合計	1,095,111,703	1,125,872,176	7.08	2.81	—	

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	105年截至10月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (102.2.5~105.10.31)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
貝萊德	584,277,868	705,241,613	2.47	31.28	1	25.49
摩根	587,857,352	747,645,554	4.10	27.18	2	
合計	1,172,135,220	1,452,887,167	3.30	28.66	—	

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	105年截至10月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (102.11.18~105.10.31)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
景順	571,501,358	612,998,664	15.02	9.42	—	2.39

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	105年截至10月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (102.12.2~105.10.31)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
貝萊德	399,329,552	426,204,605	5.06	9.33	1	8.41
道富	549,680,272	581,080,338	4.78	9.14	2	
合計	949,009,824	1,007,284,943	4.90	9.22	—	

99-1 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	105年截至10月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (103.8.25~105.10.31)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
摩根士丹利	403,049,882	357,292,284	13.54	-11.35	2	-11.75
瑞萬通博	716,993,858	681,440,922	11.48	-4.96	1	
合計	1,120,043,740	1,038,733,206	12.18	-7.26	—	

100-1 全球基本面指數被動股票型 (續約)

單位：美元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	105年截至10月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (105.7.1~105.10.31)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
道富	562,180,574	596,214,839	6.06	6.06	2	6.20
貝萊德	566,301,910	601,075,664	6.14	6.14	1	
合計	1,128,482,484	1,197,290,503	6.10	6.10	—	

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	105年截至10月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (101.3.6~105.10.31)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
Cohen & Steers	750,000,000	929,667,828	3.55	47.67	1	36.48
景順	800,000,000	959,231,480	2.84	40.07	2	
合計	1,550,000,000	1,888,899,308	3.19	43.51	—	

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	105年截至10月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (101.7.31~105.10.31)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
Ashmore	300,000,000	289,533,236	10.31	-0.33	1	0.81
Bluebay	300,000,000	277,235,348	8.51	-5.58	3	
實港	300,000,000	275,903,814	9.47	-6.29	4	
Pictet	300,000,000	291,271,005	9.37	-1.02	2	
合計	1,200,000,000	1,133,943,403	9.42	-3.31	—	

101-1 全球低波動指數被動股票型

單位：美元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	105年截至10月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (102.4.18~105.10.31)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
道富	500,000,000	576,843,733	7.45	15.10	1	14.15
貝萊德	500,000,000	573,822,371	7.33	14.48	2	
合計	1,000,000,000	1,150,666,104	7.39	14.79	—	

102-1 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	105年截至10月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (103.1.22~105.10.31)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
瑞萬通博	500,000,000	584,560,010	5.77	20.26	1	3.73
MFS	500,000,000	506,122,927	5.19	4.71	3	
威靈頓	500,000,000	523,193,214	6.64	8.78	2	
合計	1,500,000,000	1,613,876,151	5.87	11.27	—	

102-1 全球信用債券型

單位：美元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	105年截至10月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (103.4.25~105.10.31)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
Bluebay	400,000,000	402,619,064	7.65	0.90	3	2.10
貝萊德	400,000,000	408,282,176	6.61	2.26	2	
盧米斯	400,000,000	410,545,642	7.36	2.85	1	
合計	1,200,000,000	1,221,446,882	7.20	2.00	—	

104-1 全球高品質被動股票型

單位：美元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	105年截至10月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (104.8.11~105.10.31)		
				投資 報酬率(%)	排名	大盤/指標 報酬率(%)
北美信託	500,000,000	525,091,777	4.49	2.49	1	2.47
LGIM	500,000,000	525,404,225	4.61	2.37	2	
Geode	500,000,000	524,835,943	4.48	2.34	3	
合計	1,500,000,000	1,575,331,945	4.53	2.40	—	

104-2 全球基礎建設股票型

單位：美元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	105年截至10月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (104.9.25~105.10.31)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
Cohen & Steers	350,000,000	366,951,022	10.22	4.70	4	11.41
麥格理	350,000,000	378,398,262	13.42	9.99	3	
Magellan	350,000,000	361,565,003	6.42	10.98	1	
RREEF	350,000,000	371,835,753	12.47	10.29	2	
合計	1,400,000,000	1,478,750,040	10.63	9.05	—	

104-1 全球主權信用增值債券型

單位：美元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	105年截至10月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (104.11.13~105.10.31)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
NNIP	100,000,000	106,917,074	7.94	6.92	3	7.59
Brandywine	200,000,000	210,422,081	11.47	10.60	1	
盧米斯	200,000,000	206,957,322	8.24	7.43	2	
合計	500,000,000	524,296,477	9.21	8.31	—	

105-1 全球多元資產型

單位：美元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	105年截至10月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (105.7.20~105.10.31)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標報酬率 (%)
安聯	450,000,000	446,984,673	-0.28	-0.28	4	0.24
摩根	450,000,000	448,472,616	-0.03	-0.03	2	
德意志	450,000,000	448,822,783	-0.25	-0.25	3	
柏瑞	450,000,000	450,421,529	0.20	0.20	1	
合計	1,800,000,000	1,794,701,601	-0.09	-0.09	—	

105-1 亞太混合指數增值股票型

單位：美元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	105年截至10月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (105.8.24~105.10.31)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標報酬率 (%)
貝萊德	300,000,000	298,042,780	-0.33	-0.33	2	-0.40
北美信託	300,000,000	297,789,394	-0.46	-0.46	3	
領航	300,000,000	298,357,441	0.39	0.39	1	
合計	900,000,000	894,189,615	-0.13	-0.13	—	

2. 舊制勞工退休基金

96年續約2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	105年截至10月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (104.6.22~105.10.31)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
富達國際	783,555,210	790,473,442	4.91	2.06	-	1.78

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	105年截至10月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (102.1.6~105.10.31)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
太平洋	931,384,466	959,349,574	7.50	4.15	1	2.50
盧米斯	712,476,555	726,270,059	7.11	1.94	2	
合計	1,643,861,021	1,685,619,633	7.33	3.07	—	

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	105年截至10月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (102.2.5~105.10.31)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
貝萊德	584,953,368	705,510,367	2.40	31.29	-	25.49

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	105年截至10月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (102.11.17~105.10.31)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
景順	362,187,756	390,253,891	15.08	9.95	-	2.38

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	105 年截至 10 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (101.3.6~105.10.31)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
貝萊德	300,000,000	367,354,938	7.41	36.85	4	36.07
道富	300,000,000	369,902,038	7.27	38.07	1	
瑞銀	300,000,000	368,570,408	7.70	37.54	3	
野村	300,000,000	369,304,472	7.69	37.85	2	
合計	1,200,000,000	1,475,131,856	7.52	37.58	—	

101 年國外委託經營(全球低波動指數股票型)

單位：美元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	105 年截至 10 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (102.6.13~105.10.31)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
貝萊德	500,000,000	557,958,058	7.43	19.00	—	18.25

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	105 年截至 10 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (103.1.22~105.10.31)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
瑞萬通博	150,000,000	179,170,807	5.75	20.32	1	3.73
MFS	200,000,000	206,489,705	4.85	4.54	3	
威靈頓	400,000,000	416,935,700	6.44	8.70	2	
合計	750,000,000	802,596,212	5.65	11.15	—	

102 年國外委託經營(全球基礎建設有價證券型)

單位：美元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	105 年截至 10 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (103.5.29~105.10.31)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
Lazard	300,000,000	314,917,878	8.64	8.44	1	0.48
Cohen & Steers	100,000,000	94,477,160	10.39	-4.61	2	
合計	400,000,000	409,395,038	9.17	1.80	—	

102 年國外委託經營(全球不動產有價證券型)

單位：美元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	105 年截至 10 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (103.8.27~105.10.31)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
PGI	150,000,000	156,453,601	1.08	4.95	1	4.37
AMP	100,000,000	100,247,321	-2.69	-0.18	2	
合計	250,000,000	256,700,922	-0.43	2.78	—	

105 年國外委託經營(全球多元資產型)

單位：美元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	105 年截至 10 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (105.7.20~105.10.31)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
安聯	150,000,000	148,995,210	-0.27	-0.27	4	0.24
摩根	150,000,000	149,480,975	-0.04	-0.04	2	
德意志	150,000,000	149,593,646	-0.24	-0.24	3	
柏瑞	150,000,000	150,174,012	0.23	0.23	1	
合計	600,000,000	598,243,843	-0.08	-0.08	—	

(二)105 年 10 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)

105 年 10 月 31 日

1. 避險：

種類	避險比例
權益證券避險	0%
匯率避險	6.33%

2. 投資：無

(二)舊制勞工退休基金自營部位

(依交易目的)

105 年 10 月 31 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
105年10月	-10,433,996,717	8,723,144,661	19,157,141,378

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
105年10月	-1,781,614,746	-3,093,197,536	-1,311,582,790

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

105年10月份

單位：新台幣元

項 目	金 額
基金收入	210,015,513,857
基金支出	206,452,634,595
現金增(減)數	3,562,879,262

註：本表採現金基礎。

(二)舊制勞工退休基金

105年10月份

單位：新台幣元

項 目	金 額
基金收入	39,036,433,681
基金支出	39,036,419,783
現金增(減)數	13,898

註：本表採現金基礎。