

# 勞工退休基金運用情形

## 一、勞工退休基金整體績效

### (一) 110 年度 1 月迄 10 月績效

| 基金與指標   | 新制基金  | 舊制基金  | 台灣 10 年期<br>公債殖利率 | 台灣加權<br>股價指數 | MSCI 全球<br>股票指數 | Barclays<br>全球債券指數 |
|---------|-------|-------|-------------------|--------------|-----------------|--------------------|
| 收益率/報酬率 | 7.35% | 8.84% | 0.41%             | 15.31%       | 16.79%          | -4.29%             |

註 1：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。

註 2：收益率係評價後收益數÷日平均餘額。

### (二) 近一年(109 年)績效

| 基金與指標   | 新制基金  | 舊制基金  | 台灣 10 年期<br>公債殖利率 | 台灣加權<br>股價指數 | MSCI 全球<br>股票指數 | Barclays<br>全球債券指數 |
|---------|-------|-------|-------------------|--------------|-----------------|--------------------|
| 收益率/報酬率 | 6.94% | 8.50% | 0.43%             | 22.80%       | 16.25%          | 9.20%              |

### (三) 近三年(107~109 年)平均績效

| 基金與指標   | 新制基金  | 舊制基金  | 台灣 10 年期<br>公債殖利率 | 台灣加權<br>股價指數 | MSCI 全球<br>股票指數 | Barclays<br>全球債券指數 |
|---------|-------|-------|-------------------|--------------|-----------------|--------------------|
| 收益率/報酬率 | 5.80% | 6.71% | 0.70%             | 11.45%       | 10.06%          | 4.85%              |

### (四) 近五年(105~109 年)平均績效

| 基金與指標   | 新制基金  | 舊制基金  | 台灣 10 年期<br>公債殖利率 | 台灣加權<br>股價指數 | MSCI 全球<br>股票指數 | Barclays<br>全球債券指數 |
|---------|-------|-------|-------------------|--------------|-----------------|--------------------|
| 收益率/報酬率 | 5.77% | 6.46% | 0.80%             | 12.06%       | 12.26%          | 4.79%              |

## 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 110 年 10 月底止基金規模與收益       |      |                    |                            |
|-----------------------------|------|--------------------|----------------------------|
| 基金運用規模                      |      | 3 兆 829 億 2,935 萬元 |                            |
| 110 年截至 10 月底止<br>運用收益數及收益率 | 自行運用 | 國內固定收益             | 57 億 95 萬元<br>0.78%        |
|                             |      | 國內權益證券<br>及國外投資    | 384 億 9,844 萬元<br>9.67%    |
|                             | 委託經營 |                    | 1,690 億 3,557 萬元<br>10.43% |
|                             | 合 計  |                    | 2,132 億 3,496 萬元<br>7.35%  |

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：收益率係以當期收益率列示，惟國內固定收益係以年化收益率列示。

註 3：110 年 10 月之保證收益率為 0.7858%。

#### 2. 舊制勞工退休基金

| 至 110 年 10 月底止基金規模與收益       |      |                  |                          |
|-----------------------------|------|------------------|--------------------------|
| 基金運用規模                      |      | 9,431 億 4,948 萬元 |                          |
| 110 年截至 10 月底止<br>運用收益數及收益率 | 自行運用 | 國內固定收益           | 12 億 9,700 萬元<br>0.63%   |
|                             |      | 國內權益證券<br>及國外投資  | 319 億 2,740 萬元<br>14.81% |
|                             | 委託經營 |                  | 395 億 3,178 萬元<br>8.60%  |
|                             | 合 計  |                  | 727 億 5,618 萬元<br>8.84%  |

註：收益率係以當期收益率列示，惟國內固定收益係以年化收益率列示。

## (二) 資產配置

### 1. 新制勞工退休基金

截至 110 年 10 月底

單位：新臺幣元

| 項 目             | 餘 額                      | 占基金運用比率(%)    |
|-----------------|--------------------------|---------------|
| <b>自行運用</b>     | <b>1,328,672,816,329</b> | <b>43.10</b>  |
| 轉存金融機構          | 648,996,550,237          | 21.05         |
| 短期票券            | 42,885,553,965           | 1.39          |
| 公債、公司債、金融債券及特別股 | 200,073,568,658          | 6.49          |
| 股票及受益憑證投資(含期貨)  | 179,556,002,337          | 5.82          |
| 國外投資            | 257,161,141,132          | 8.35          |
| 固定收益            | 158,359,297,973          | 5.14          |
| 權益證券            | 51,376,645,353           | 1.67          |
| 另類投資            | 47,425,197,806           | 1.54          |
| <b>委託經營</b>     | <b>1,754,256,534,714</b> | <b>56.90</b>  |
| 國內委託經營          | 416,051,937,435          | 13.49         |
| 國外委託經營          | 1,338,204,597,279        | 43.41         |
| 固定收益            | 351,359,456,732          | 11.40         |
| 權益證券            | 674,709,402,679          | 21.89         |
| 另類投資            | 312,135,737,868          | 10.12         |
| <b>合 計</b>      | <b>3,082,929,351,043</b> | <b>100.00</b> |

## 2. 舊制勞工退休基金

截至 110 年 10 月底

單位：新臺幣元

| 項 目               | 餘 額                    | 占基金運用比率(%)    |
|-------------------|------------------------|---------------|
| <b>自行運用</b>       | <b>472,447,553,695</b> | <b>50.09</b>  |
| 轉存金融機構            | 170,135,348,780        | 18.04         |
| 短期票券              | 47,807,730,795         | 5.07          |
| 公債、金融債券、公司債及證券化商品 | 58,447,765,193         | 6.19          |
| 股票及受益憑證投資(含期貨)    | 85,418,196,605         | 9.06          |
| 國外投資              | 110,638,512,322        | 11.73         |
| 固定收益              | 55,350,590,623         | 5.87          |
| 權益證券              | 39,349,979,366         | 4.17          |
| 另類投資              | 15,937,942,333         | 1.69          |
| <b>委託經營</b>       | <b>470,701,921,992</b> | <b>49.91</b>  |
| 國內委託經營            | 95,484,019,743         | 10.12         |
| 國外委託經營            | 375,217,902,249        | 39.79         |
| 固定收益              | 109,656,136,032        | 11.63         |
| 權益證券              | 181,642,813,777        | 19.26         |
| 另類投資              | 83,918,952,440         | 8.90          |
| <b>合 計</b>        | <b>943,149,475,687</b> | <b>100.00</b> |

### (三) 基金自營投資與委外投資比率

#### 1. 新制勞工退休基金

截至 110 年 10 月底

單位：新臺幣元

| 項 目  | 金 額               | 占基金運用比率(%) |
|------|-------------------|------------|
| 自行運用 | 1,328,672,816,329 | 43.10      |
| 委託經營 | 1,754,256,534,714 | 56.90      |

#### 2. 舊制勞工退休基金

截至 110 年 10 月底

單位：新臺幣元

| 項 目  | 金 額             | 占基金運用比率(%) |
|------|-----------------|------------|
| 自行運用 | 472,447,553,695 | 50.09      |
| 委託經營 | 470,701,921,992 | 49.91      |

#### (四)基金國內投資與國外投資比率

##### 1. 新制勞工退休基金

截至 110 年 10 月底

單位：新臺幣元

| 項 目  | 金 額               | 占基金運用比率 (%) |
|------|-------------------|-------------|
| 國內投資 | 1,487,563,612,632 | 48.24       |
| 國外投資 | 1,595,365,738,411 | 51.76       |

##### 2. 舊制勞工退休基金

截至 110 年 10 月底

單位：新臺幣元

| 項 目  | 金 額             | 占基金運用比率 (%) |
|------|-----------------|-------------|
| 國內投資 | 457,293,061,116 | 48.48       |
| 國外投資 | 485,856,414,571 | 51.52       |

#### 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 110 年 10 月底

| 項 目    | 收益率 (%) |
|--------|---------|
| 國內權益證券 | 17.47   |

##### 2. 舊制勞工退休基金

截至 110 年 10 月底

| 項 目    | 收益率 (%) |
|--------|---------|
| 國內權益證券 | 24.17   |

## (二)基金自營股票及受益憑證投資比率概況

### 1. 新制勞工退休基金

截至 110 年 10 月底 單位：新臺幣元

| 項 目    | 金 額             | 比 率 (%) |
|--------|-----------------|---------|
| 國內權益證券 | 179,556,002,337 | 5.82    |

### 2. 舊制勞工退休基金

截至 110 年 10 月底 單位：新臺幣元

| 項 目    | 金 額            | 比 率 (%) |
|--------|----------------|---------|
| 國內權益證券 | 85,418,196,605 | 9.06    |

## 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 4)

單位：新臺幣元

| 投信<br>名稱 | 委託金額           | 目前淨資產          | 110 年截至 10 月<br>累積投資報酬率<br>(%) | 委任迄今<br>(108.9.27~110.10.31) |            |              |
|----------|----------------|----------------|--------------------------------|------------------------------|------------|--------------|
|          |                |                |                                | 投資<br>報酬率<br>(%)             | 委託經<br>營排名 | 目標報酬率<br>(%) |
| 野村       | 23,580,874,211 | 34,045,201,336 | 21.32                          | 50.05                        | —          | 12.82        |

註：本批次為絕對報酬型，契約目標報酬率係以臺灣證交所公告之最近 4 年年底股票集中市場平均殖利率加計 200 個基本點為基準。

### 97 年第一次委託經營(續約 4)

單位：新臺幣元

| 投信名稱 | 委託金額          | 目前淨資產          | 110 年截至 10 月<br>累積投資報酬率<br>(%) | 委任迄今<br>(109.1.20~110.10.31) |            |              |
|------|---------------|----------------|--------------------------------|------------------------------|------------|--------------|
|      |               |                |                                | 投資<br>報酬率<br>(%)             | 委託經<br>營排名 | 目標<br>報酬率(%) |
| 野村   | 9,193,179,186 | 12,513,793,804 | 21.65                          | 36.12                        | —          | 10.80        |

註：本批次為絕對報酬型，契約目標報酬率係以臺灣證交所公告之最近 4 年年底股票集中市場平均殖利率加計 200 個基本點為基準。

### 98 年第一次委託經營(續約 4)

單位：新臺幣元

| 投信名稱 | 委託金額           | 目前淨資產          | 110 年截至 10 月<br>累積投資報酬率<br>(%) | 委任迄今<br>(110.7.16~110.10.31) |            |              |
|------|----------------|----------------|--------------------------------|------------------------------|------------|--------------|
|      |                |                |                                | 投資<br>報酬率<br>(%)             | 委託經<br>營排名 | 目標報酬率<br>(%) |
| 野村   | 19,093,323,980 | 19,264,721,005 | 0.90                           | 0.90                         | 1          | 1.74         |
| 保德信  | 6,277,574,114  | 6,037,204,271  | -3.83                          | -3.83                        | 2          |              |
| 合計   | 25,370,898,094 | 25,301,925,276 | -0.27                          | -0.27                        | —          |              |

註：本批次為絕對報酬型，110.7.16 第 4 次續約，契約目標報酬率係以臺灣證交所公告之最近 4 年年底股票集中市場平均殖利率加計 200 個基本點為基準。

### 99 年第二次委託經營(續約 2)

單位：新臺幣元

| 投信名稱 | 委託金額          | 目前淨資產          | 110 年截至 10 月<br>累積投資報酬率<br>(%) | 委任迄今<br>(107.12.3~110.10.31) |            |              |
|------|---------------|----------------|--------------------------------|------------------------------|------------|--------------|
|      |               |                |                                | 投資<br>報酬率<br>(%)             | 委託經<br>營排名 | 目標報酬率<br>(%) |
| 國泰   | 8,441,043,825 | 10,950,351,132 | 0.93                           | 36.18                        | —          | 18.03        |

註：本批次為絕對報酬型，契約目標報酬率係以臺灣證交所公告之最近 4 年年底股票集中市場平均殖利率加計 200 個基本點為基準。

### 100 年第一次委託經營(續約 2)(相對報酬)

單位：新臺幣元

| 投信名稱 | 委託金額              | 目前淨資產             | 110 年截至 10 月<br>累積投資報酬率<br>(%) | 委任迄今<br>(108. 7. 15~110. 10. 31) |            |              |
|------|-------------------|-------------------|--------------------------------|----------------------------------|------------|--------------|
|      |                   |                   |                                | 投資<br>報酬率<br>(%)                 | 委託經<br>營排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| 復華   | 11, 295, 508, 988 | 25, 125, 060, 425 | 27. 98                         | 72. 38                           | —          | 67. 77       |

註：本批次為相對報酬型，以臺灣就業 99 指數為指定指標。

### 101 年第一次委託經營(續約 2)(相對報酬)

單位：新臺幣元

| 投信名稱 | 委託金額              | 目前淨資產             | 110 年截至 10 月<br>累積投資報酬率<br>(%) | 委任迄今<br>(109. 4. 20~110. 10. 31) |            |              |
|------|-------------------|-------------------|--------------------------------|----------------------------------|------------|--------------|
|      |                   |                   |                                | 投資<br>報酬率<br>(%)                 | 委託經<br>營排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| 國泰   | 8, 014, 871, 501  | 13, 757, 319, 460 | 16. 65                         | 71. 65                           | 1          | 69. 81       |
| 滙豐中華 | 10, 927, 481, 593 | 18, 137, 467, 059 | 16. 57                         | 65. 98                           | 2          |              |
| 合計   | 18, 942, 353, 094 | 31, 894, 786, 519 | 16. 60                         | 68. 38                           | —          |              |

註：本批次為相對報酬型，以臺灣加權股價報酬指數為指定指標。

### 101 年第二次委託經營(續約 2)

單位：新臺幣元

| 投信名稱 | 委託金額              | 目前淨資產             | 110 年截至 10 月<br>累積投資報酬率<br>(%) | 委任迄今<br>(109. 7. 20~110. 10. 31) |            |              |
|------|-------------------|-------------------|--------------------------------|----------------------------------|------------|--------------|
|      |                   |                   |                                | 投資<br>報酬率<br>(%)                 | 委託經<br>營排名 | 目標報酬率<br>(%) |
| 野村   | 9, 057, 257, 704  | 11, 870, 248, 861 | 21. 55                         | 31. 06                           | 1          | 7. 71        |
| 統一   | 12, 294, 643, 442 | 16, 098, 074, 714 | 17. 94                         | 30. 94                           | 2          |              |
| 合計   | 21, 351, 901, 146 | 27, 968, 323, 575 | 19. 45                         | 30. 99                           | —          |              |

註：本批次為絕對報酬型，契約目標報酬率係以臺灣證交所公告之最近 4 年年底股票集中市場平均殖利率加計 200 個基本點為基準。

## 102 年第二次委託經營(續約)(相對報酬)

單位：新臺幣元

| 投信名稱 | 委託金額           | 目前淨資產          | 110 年截至 10 月<br>累積投資報酬率<br>(%) | 委任迄今<br>(107.1.22~110.10.31) |            |              |
|------|----------------|----------------|--------------------------------|------------------------------|------------|--------------|
|      |                |                |                                | 投資<br>報酬率<br>(%)             | 委託經<br>營排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| 統一   | 7,009,597,591  | 13,759,679,057 | 14.58                          | 96.30                        | 1          | 76.13        |
| 復華   | 10,038,542,112 | 18,359,782,783 | 24.05                          | 84.72                        | 2          |              |
| 滙豐中華 | 4,006,530,255  | 6,876,199,087  | 15.37                          | 68.35                        | 3          |              |
| 合計   | 21,054,669,958 | 38,995,660,927 | 18.98                          | 83.67                        | —          |              |

註：本批次為相對報酬型，以臺灣加權股價報酬指數為指定指標。

## 103 年第一次委託經營第二期(續約)

單位：新臺幣元

| 投信名稱 | 委託金額           | 目前淨資產          | 110 年截至 10 月<br>累積投資報酬率<br>(%) | 委任迄今<br>(107.10.8~110.10.31) |            |              |
|------|----------------|----------------|--------------------------------|------------------------------|------------|--------------|
|      |                |                |                                | 投資<br>報酬率<br>(%)             | 委託經<br>營排名 | 目標報酬率<br>(%) |
| 台新   | 12,934,673,726 | 18,396,482,880 | 11.78                          | 60.22                        | —          | 18.97        |

註：本批次為絕對報酬型，契約目標報酬率係以臺灣證交所公告之最近 4 年年底股票集中市場平均殖利率加計 200 個基本點為基準。

## 103 年第二次委託經營(相對報酬)

單位：新臺幣元

| 投信名稱 | 委託金額           | 目前淨資產          | 110 年截至 10 月<br>累積投資報酬率<br>(%) | 委任迄今<br>(106.12.1~110.10.31) |            |              |
|------|----------------|----------------|--------------------------------|------------------------------|------------|--------------|
|      |                |                |                                | 投資<br>報酬率<br>(%)             | 委託經<br>營排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| 國泰   | 6,000,000,000  | 10,502,088,734 | 24.50                          | 80.10                        | 3          | 82.06        |
| 統一   | 6,000,000,000  | 10,968,248,490 | 23.23                          | 87.78                        | 1          |              |
| 復華   | 6,000,000,000  | 10,543,075,602 | 26.02                          | 79.64                        | 4          |              |
| 滙豐中華 | 6,000,000,000  | 10,434,598,704 | 25.16                          | 77.58                        | 5          |              |
| 安聯   | 6,000,000,000  | 10,694,617,615 | 28.45                          | 81.65                        | 2          |              |
| 合計   | 30,000,000,000 | 53,142,629,145 | 25.44                          | 81.35                        | —          |              |

註：本批次為相對報酬型，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：新臺幣元

| 投信名稱 | 委託金額          | 目前淨資產         | 110 年截至 10 月<br>累積投資報酬率<br>(%) | 委任迄今<br>(108.4.1~110.10.31) |            |              |
|------|---------------|---------------|--------------------------------|-----------------------------|------------|--------------|
|      |               |               |                                | 投資<br>報酬率<br>(%)            | 委託經<br>營排名 | 目標報酬率<br>(%) |
| 復華   | 3,651,168,229 | 5,634,000,509 | 10.74                          | 54.31                       | 2          | 15.97        |
| 安聯   | 2,473,766,298 | 3,899,162,114 | 18.45                          | 56.02                       | 1          |              |
| 合計   | 6,124,934,527 | 9,533,162,623 | 13.77                          | 54.54                       | —          |              |

註：本批次為絕對報酬型，契約目標報酬率係以臺灣證交所公告之最近 4 年年底股票集中市場平均殖利率加計 200 個基本點為基準。

## 106 年第一次委託經營

單位：新臺幣元

| 投信名稱 | 委託金額           | 目前淨資產          | 110 年截至 10 月<br>累積投資報酬率<br>(%) | 委任迄今<br>(107.2.7~110.10.31) |            |              |
|------|----------------|----------------|--------------------------------|-----------------------------|------------|--------------|
|      |                |                |                                | 投資<br>報酬率<br>(%)            | 委託經<br>營排名 | 目標報酬率<br>(%) |
| 台新   | 4,500,000,000  | 6,483,074,726  | 24.63                          | 38.11                       | 4          | 22.86        |
| 安聯   | 7,500,000,000  | 12,102,643,234 | 19.82                          | 85.18                       | 1          |              |
| 保德信  | 5,000,000,000  | 6,697,917,027  | 5.79                           | 32.66                       | 6          |              |
| 國泰   | 4,500,000,000  | 6,150,701,040  | 0.47                           | 35.68                       | 5          |              |
| 群益   | 4,750,000,000  | 6,766,250,592  | 12.50                          | 43.27                       | 3          |              |
| 滙豐中華 | 5,000,000,000  | 7,121,720,920  | 7.19                           | 43.95                       | 2          |              |
| 合計   | 31,250,000,000 | 45,322,307,539 | 12.15                          | 46.79                       | —          |              |

註：本批次為絕對報酬型，契約目標報酬率係以臺灣證交所公告之最近 5 年年底股票集中市場平均殖利率加計 200 個基本點為基準。

## 107 年第一次委託經營(相對報酬)

單位：新臺幣元

| 投信名稱 | 委託金額           | 目前淨資產          | 110 年截至 10 月<br>累積投資報酬率<br>(%) | 委任迄今<br>(107.10.24~110.10.31) |            |              |
|------|----------------|----------------|--------------------------------|-------------------------------|------------|--------------|
|      |                |                |                                | 投資<br>報酬率<br>(%)              | 委託經<br>營排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| 台新   | 6,000,000,000  | 9,807,216,775  | 15.41                          | 93.47                         | 5          | 96.61        |
| 安聯   | 6,000,000,000  | 10,326,152,190 | 22.31                          | 103.85                        | 2          |              |
| 保德信  | 6,000,000,000  | 9,858,208,719  | 18.23                          | 91.34                         | 6          |              |
| 統一   | 4,000,000,000  | 8,244,256,095  | 19.17                          | 107.77                        | 1          |              |
| 國泰   | 6,000,000,000  | 10,056,582,828 | 16.70                          | 96.15                         | 3          |              |
| 復華   | 4,000,000,000  | 7,909,077,656  | 18.87                          | 95.14                         | 4          |              |
| 群益   | 3,000,000,000  | 6,565,888,150  | 16.83                          | 88.03                         | 7          |              |
| 合計   | 35,000,000,000 | 62,767,382,413 | 18.19                          | 96.48                         | —          |              |

註：本批次為相對報酬型，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：新臺幣元

| 投信名稱 | 委託金額           | 目前淨資產          | 110 年截至 10 月<br>累積投資報酬率<br>(%) | 委任迄今<br>(108.5.24~110.10.31) |            |              |
|------|----------------|----------------|--------------------------------|------------------------------|------------|--------------|
|      |                |                |                                | 投資<br>報酬率<br>(%)             | 委託經<br>營排名 | 目標報酬率<br>(%) |
| 安聯   | 6,000,000,000  | 9,324,911,392  | 19.82                          | 62.42                        | 2          | 15.08        |
| 施羅德  | 6,000,000,000  | 9,064,425,688  | 18.38                          | 56.37                        | 5          |              |
| 統一   | 6,000,000,000  | 9,138,431,019  | 18.69                          | 58.46                        | 4          |              |
| 野村   | 11,000,000,000 | 15,688,375,094 | 20.18                          | 70.54                        | 1          |              |
| 國泰   | 11,000,000,000 | 15,221,260,671 | 14.90                          | 59.07                        | 3          |              |
| 復華   | 6,000,000,000  | 8,716,674,503  | 13.14                          | 53.88                        | 6          |              |
| 合計   | 46,000,000,000 | 67,154,078,367 | 17.52                          | 60.22                        | —          |              |

註：本批次為絕對報酬型，契約目標報酬率係以臺灣證交所公告之最近 5 年年底股票集中市場平均殖利率加計 200 個基本點為基準。

## 109 年第一次委託經營

單位：新臺幣元

| 投信名稱 | 委託金額           | 目前淨資產          | 110 年截至 10 月<br>累積投資報酬率<br>(%) | 委任迄今<br>(110.5.13~110.10.31) |            |              |
|------|----------------|----------------|--------------------------------|------------------------------|------------|--------------|
|      |                |                |                                | 投資<br>報酬率<br>(%)             | 委託經<br>營排名 | 目標報酬率<br>(%) |
| 台新   | 8,000,000,000  | 8,125,265,040  | 1.57                           | 1.57                         | 4          | 2.82         |
| 安聯   | 8,000,000,000  | 8,352,727,236  | 4.41                           | 4.41                         | 3          |              |
| 保德信  | 8,000,000,000  | 7,950,927,975  | -0.61                          | -0.61                        | 5          |              |
| 國泰   | 8,000,000,000  | 8,761,137,974  | 9.51                           | 9.51                         | 1          |              |
| 野村   | 8,000,000,000  | 8,550,913,958  | 6.89                           | 6.89                         | 2          |              |
| 合計   | 40,000,000,000 | 41,740,972,183 | 4.35                           | 4.35                         | —          |              |

註：本批次為絕對報酬型，契約目標報酬率係以臺灣證交所公告之最近 5 年年底股票集中市場平均殖利率加計 200 個基本點為基準。

## 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：新臺幣元

| 投信名稱 | 委託金額           | 目前淨資產          | 110 年截至 10 月<br>累積投資報酬率<br>(%) | 委任迄今<br>(108.1.28~110.10.31) |            |              |
|------|----------------|----------------|--------------------------------|------------------------------|------------|--------------|
|      |                |                |                                | 投資<br>報酬率<br>(%)             | 委託經<br>營排名 | 目標報酬率<br>(%) |
| 富邦   | 7,957,934,152  | 12,472,288,821 | 22.09                          | 70.99                        | 1          | 17.07        |
| 統一   | 6,491,384,983  | 10,367,374,396 | 18.00                          | 59.71                        | 2          |              |
| 合計   | 14,449,319,135 | 22,839,663,217 | 20.21                          | 65.40                        | —          |              |

註：本批次為絕對報酬型，契約目標報酬率係以臺灣證交所公告之最近 4 年年底股票集中市場平均殖利率加計 200 個基本點為基準。

國內 101 年第一次委託經營(相對報酬)(續約 2) 單位：新臺幣元

| 投信名稱 | 委託金額          | 目前淨資產         | 110 年截至 10 月<br>累積投資報酬率<br>(%) | 委任迄今<br>(109.11.2~110.10.31) |            |              |
|------|---------------|---------------|--------------------------------|------------------------------|------------|--------------|
|      |               |               |                                | 投資<br>報酬率<br>(%)             | 委託經<br>營排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| 匯豐中華 | 5,685,000,000 | 7,786,473,255 | 16.36                          | 36.97                        | —          | 39.14        |

註：本批次為相對報酬型，以臺灣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 2) 單位：新臺幣元

| 投信名稱 | 委託金額           | 目前淨資產          | 110 年截至 10 月<br>累積投資報酬率<br>(%) | 委任迄今<br>(109.05.04~110.10.31) |            |              |
|------|----------------|----------------|--------------------------------|-------------------------------|------------|--------------|
|      |                |                |                                | 投資<br>報酬率<br>(%)              | 委託經營<br>排名 | 目標報酬率<br>(%) |
| 野村   | 19,272,822,959 | 28,657,691,990 | 20.02                          | 48.69                         | —          | 9.02         |

註：本批次為絕對報酬型，契約目標報酬率係以臺灣證交所公告之最近 4 年年底股票集中市場平均殖利率加計 200 個基本點為基準。

國內 104 年第一次委託經營(續約) 單位：新臺幣元

| 投信名稱 | 委託金額          | 目前淨資產         | 110 年截至 10 月<br>累積投資報酬率<br>(%) | 委任迄今<br>(108.4.1~110.10.31) |            |              |
|------|---------------|---------------|--------------------------------|-----------------------------|------------|--------------|
|      |               |               |                                | 投資<br>報酬率<br>(%)            | 委託經<br>營排名 | 目標報酬率<br>(%) |
| 復華   | 3,651,419,951 | 5,634,700,465 | 10.74                          | 54.32                       | 2          | 15.97        |
| 安聯   | 2,474,008,140 | 3,899,725,392 | 18.45                          | 56.03                       | 1          |              |
| 合計   | 6,125,428,091 | 9,534,425,857 | 13.77                          | 54.54                       | —          |              |

註：本批次為絕對報酬型，契約目標報酬率係以臺灣證交所公告之最近 4 年年底股票集中市場平均殖利率加計 200 個基本點為基準。

## 國內 106 年第一次委託經營

單位：新臺幣元

| 投信名稱 | 委託金額           | 目前淨資產          | 110 年截至 10 月<br>累積投資報酬率<br>(%) | 委任迄今<br>(107.2.7~110.10.31) |            |              |
|------|----------------|----------------|--------------------------------|-----------------------------|------------|--------------|
|      |                |                |                                | 投資<br>報酬率<br>(%)            | 委託經<br>營排名 | 目標報酬率<br>(%) |
| 台新   | 4,500,000,000  | 6,483,565,984  | 24.64                          | 38.13                       | 4          | 22.86        |
| 安聯   | 7,500,000,000  | 12,103,512,577 | 19.83                          | 85.19                       | 1          |              |
| 保德信  | 5,000,000,000  | 6,698,549,323  | 5.80                           | 32.68                       | 6          |              |
| 國泰   | 4,500,000,000  | 6,151,202,557  | 0.47                           | 35.70                       | 5          |              |
| 群益   | 4,750,000,000  | 6,767,157,790  | 12.50                          | 43.29                       | 3          |              |
| 匯豐中華 | 5,000,000,000  | 7,122,475,180  | 7.20                           | 43.97                       | 2          |              |
| 合計   | 31,250,000,000 | 45,326,463,411 | 12.15                          | 46.81                       | —          |              |

註：本批次為絕對報酬型，契約目標報酬率係以臺灣證交所公告之最近 5 年年底股票集中市場平均殖利率加計 200 個基本點為基準。

### (二) 110 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 全球主動債券型 (續約 3)

單位：美元

| 受託機構        | 委託金額          | 目前淨資產         | 110 年截至 10 月<br>累積投資報酬率<br>(%) | 委任迄今<br>(110.6.7~110.10.31) |    |              |
|-------------|---------------|---------------|--------------------------------|-----------------------------|----|--------------|
|             |               |               |                                | 投資報酬率<br>(%)                | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| 聯博          | 907,613,021   | 886,672,115   | -2.31                          | -2.31                       | 1  | -2.16        |
| 富蘭克林<br>坦伯頓 | 851,737,838   | 823,132,576   | -3.36                          | -3.36                       | 2  |              |
| 合計          | 1,759,350,859 | 1,709,804,691 | -2.82                          | -2.82                       | —  |              |

## 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         | 110 年截至 10 月<br>累積投資報酬率<br>(%) | 委任迄今<br>(106.1.6~110.10.31) |    |              |
|-------|---------------|---------------|--------------------------------|-----------------------------|----|--------------|
|       |               |               |                                | 投資報酬率<br>(%)                | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| PIMCO | 1,519,586,290 | 1,735,269,673 | -5.15                          | 20.58                       | —  | 16.96        |

## 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         | 110 年截至 10 月<br>累積投資報酬率<br>(%) | 委任迄今<br>(106.2.6~110.10.31) |    |              |
|------|---------------|---------------|--------------------------------|-----------------------------|----|--------------|
|      |               |               |                                | 投資報酬率<br>(%)                | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| 貝萊德  | 967,348,593   | 1,778,399,253 | 14.74                          | 83.84                       | 2  | 86.43        |
| 摩根   | 802,177,668   | 1,520,318,304 | 17.87                          | 89.52                       | 1  |              |
| 合計   | 1,769,526,261 | 3,298,717,557 | 16.17                          | 86.42                       | —  |              |

### 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       | 110 年截至 10 月<br>累積投資報酬率<br>(%) | 委任迄今<br>(106.11.17~110.10.31) |    |              |
|------|-------------|-------------|--------------------------------|-------------------------------|----|--------------|
|      |             |             |                                | 投資<br>報酬率<br>(%)              | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| 景順   | 602,621,073 | 748,163,784 | 3.81                           | 28.55                         | —  | 28.29        |

### 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         | 110 年截至 10 月<br>累積投資報酬率<br>(%) | 委任迄今<br>(106.12.4~110.10.31) |    |              |
|------|---------------|---------------|--------------------------------|------------------------------|----|--------------|
|      |               |               |                                | 投資<br>報酬率<br>(%)             | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| 貝萊德  | 735,489,288   | 1,079,402,906 | 16.98                          | 60.37                        | 2  | 58.83        |
| 道富   | 928,826,441   | 1,391,813,356 | 17.00                          | 60.71                        | 1  |              |
| 合計   | 1,664,315,729 | 2,471,216,262 | 16.99                          | 60.57                        | —  |              |

### 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       | 110 年截至 10 月<br>累積投資報酬率<br>(%) | 委任迄今<br>(107.8.27~110.10.31) |    |              |
|------|-------------|-------------|--------------------------------|------------------------------|----|--------------|
|      |             |             |                                | 投資<br>報酬率<br>(%)             | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| 瑞萬通博 | 657,229,489 | 805,938,986 | -4.54                          | 19.56                        | —  | 30.73        |

### 100-1 全球基本面指數被動股票型 (續約 2)

單位：美元

| 受託機構 | 委託金額             | 目前淨資產            | 110 年截至 10 月<br>累積投資報酬率<br>(%) | 委任迄今<br>(110. 7. 1~110. 10. 31) |    |              |
|------|------------------|------------------|--------------------------------|---------------------------------|----|--------------|
|      |                  |                  |                                | 投資<br>報酬率<br>(%)                | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| 道富   | 934, 565, 605    | 958, 476, 644    | 2. 56                          | 2. 56                           | 1  | 2. 45        |
| 貝萊德  | 939, 726, 931    | 962, 267, 127    | 2. 40                          | 2. 40                           | 2  |              |
| 合計   | 1, 874, 292, 536 | 1, 920, 743, 771 | 2. 48                          | 2. 48                           | —  |              |

### 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            | 110 年截至 10 月<br>累積投資報酬率<br>(%) | 委任迄今<br>(106. 3. 6~110. 10. 31) |    |              |
|----------------|------------------|------------------|--------------------------------|---------------------------------|----|--------------|
|                |                  |                  |                                | 投資<br>報酬率<br>(%)                | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| Cohen & Steers | 1, 601, 936, 411 | 2, 255, 385, 624 | 18. 72                         | 53. 89                          | 1  | 34. 77       |
| 景順             | 1, 164, 104, 927 | 1, 539, 575, 442 | 18. 71                         | 34. 54                          | 2  |              |
| 合計             | 2, 766, 041, 338 | 3, 794, 961, 065 | 18. 72                         | 44. 71                          | —  |              |

### 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            | 110 年截至 10 月<br>累積投資報酬率<br>(%) | 委任迄今<br>(106. 7. 31~110. 10. 31) |    |              |
|---------|---------------|------------------|--------------------------------|----------------------------------|----|--------------|
|         |               |                  |                                | 投資<br>報酬率<br>(%)                 | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| Ashmore | 354, 453, 121 | 402, 166, 006    | -4. 25                         | 10. 64                           | 2  | 16. 47       |
| Pictet  | 534, 291, 634 | 607, 402, 890    | -5. 59                         | 16. 64                           | 1  |              |
| 合計      | 888, 744, 755 | 1, 009, 568, 896 | -5. 06                         | 13. 52                           | —  |              |

### 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         | 110年截至10月<br>累積投資報酬率<br>(%) | 委任迄今<br>(107.4.18~110.10.31) |    |              |
|------|---------------|---------------|-----------------------------|------------------------------|----|--------------|
|      |               |               |                             | 投資報酬率<br>(%)                 | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| 道富   | 798,231,848   | 991,332,678   | 8.00                        | 24.36                        | 2  | 23.60        |
| 貝萊德  | 794,293,722   | 987,825,093   | 8.08                        | 24.53                        | 1  |              |
| 合計   | 1,592,525,570 | 1,979,157,771 | 8.04                        | 24.44                        | —  |              |

### 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         | 110年截至10月<br>累積投資報酬率<br>(%) | 委任迄今<br>(108.1.22~110.10.31) |    |              |
|------|---------------|---------------|-----------------------------|------------------------------|----|--------------|
|      |               |               |                             | 投資報酬率<br>(%)                 | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| 瑞萬通博 | 1,056,315,337 | 1,618,418,751 | 12.84                       | 66.59                        | 1  | 32.27        |
| MFS  | 603,318,800   | 812,424,376   | 13.23                       | 34.66                        | 3  |              |
| 威靈頓  | 831,647,315   | 1,156,637,238 | 11.45                       | 45.00                        | 2  |              |
| 合計   | 2,491,281,452 | 3,587,480,365 | 12.60                       | 50.28                        | —  |              |

### 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         | 110年截至10月<br>累積投資報酬率<br>(%) | 委任迄今<br>(108.4.25~110.10.31) |    |              |
|---------|---------------|---------------|-----------------------------|------------------------------|----|--------------|
|         |               |               |                             | 投資報酬率<br>(%)                 | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| Bluebay | 586,338,464   | 708,942,575   | -1.27                       | 22.51                        | 1  | 13.97        |
| 貝萊德     | 687,231,657   | 765,576,843   | -3.08                       | 14.61                        | 3  |              |
| 盧米斯     | 692,703,100   | 789,179,554   | -2.72                       | 17.30                        | 2  |              |
| 合計      | 1,966,273,221 | 2,263,698,972 | -2.39                       | 17.98                        | —  |              |

### 104-1 全球高品質被動股票型 (續約)

單位：美元

| 受託機構  | 委託金額          | 目前淨資產         | 110年截至10月<br>累積投資報酬率<br>(%) | 委任迄今<br>(109.8.11~110.10.31) |    |          |
|-------|---------------|---------------|-----------------------------|------------------------------|----|----------|
|       |               |               |                             | 投資<br>報酬率<br>(%)             | 排名 | 指標報酬率(%) |
| 北美信託  | 1,396,617,127 | 1,881,777,553 | 19.31                       | 35.74                        | 2  | 35.20    |
| LGIM  | 1,395,083,447 | 1,875,830,815 | 19.09                       | 35.45                        | 3  |          |
| Geode | 1,395,075,832 | 1,882,592,282 | 19.51                       | 35.94                        | 1  |          |
| 合計    | 4,186,776,406 | 5,640,200,650 | 19.30                       | 35.71                        | —  |          |

### 104-2 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         | 110年截至10月<br>累積投資報酬率<br>(%) | 委任迄今<br>(109.9.25~110.10.31) |    |          |
|----------|---------------|---------------|-----------------------------|------------------------------|----|----------|
|          |               |               |                             | 投資<br>報酬率<br>(%)             | 排名 | 指標報酬率(%) |
| Magellan | 1,437,520,518 | 1,676,354,273 | 8.78                        | 16.61                        | 2  | 26.82    |
| RREEF    | 926,848,763   | 1,182,739,304 | 17.61                       | 27.61                        | 1  |          |
| 合計       | 2,364,369,281 | 2,859,093,577 | 12.27                       | 20.92                        | —  |          |

### 104-1 全球主權信用增值債券型 (續約)

單位：美元

| 受託機構       | 委託金額          | 目前淨資產         | 110年截至10月<br>累積投資報酬率<br>(%) | 委任迄今<br>(109.11.13~110.10.31) |    |          |
|------------|---------------|---------------|-----------------------------|-------------------------------|----|----------|
|            |               |               |                             | 投資<br>報酬率<br>(%)              | 排名 | 指標報酬率(%) |
| Brandywine | 641,176,083   | 645,187,482   | -4.25                       | 0.63                          | 1  | -4.75    |
| 盧米斯        | 371,104,127   | 357,913,997   | -7.12                       | -3.55                         | 2  |          |
| 合計         | 1,012,280,210 | 1,003,101,479 | -5.30                       | -0.91                         | —  |          |

### 105-1 全球多元資產型 (續約)

單位：美元

| 受託機構    | 委託金額          | 目前淨資產         | 110年截至10月<br>累積投資報酬率<br>(%) | 委任迄今<br>(110.7.20~110.10.31) |    |                 |
|---------|---------------|---------------|-----------------------------|------------------------------|----|-----------------|
|         |               |               |                             | 投資<br>報酬率<br>(%)             | 排名 | 指標/目標報酬<br>率(%) |
| Allianz | 478,698,278   | 496,887,589   | 3.80                        | 3.80                         | 2  | 0.01/1.43       |
| 摩根      | 1,645,715,430 | 1,709,386,034 | 3.87                        | 3.87                         | 1  |                 |
| DWS     | 925,711,371   | 934,132,833   | 0.91                        | 0.91                         | 4  |                 |
| 柏瑞      | 765,326,657   | 788,390,889   | 3.01                        | 3.01                         | 3  |                 |
| 合計      | 3,815,451,736 | 3,928,797,345 | 2.97                        | 2.97                         | —  |                 |

註：本批次為絕對報酬型，契約目標報酬率係以 US 3-Month T-Bill (指標報酬率) 加計 500 個基本點為基準。

### 105-1 亞太混合指數增值股票型 (續約)

單位：美元

| 受託機構 | 委託金額        | 目前淨資產       | 110年截至10月<br>累積投資報酬率<br>(%) | 委任迄今<br>(110.8.24~110.10.31) |    |              |
|------|-------------|-------------|-----------------------------|------------------------------|----|--------------|
|      |             |             |                             | 投資<br>報酬率<br>(%)             | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| 貝萊德  | 949,175,052 | 955,698,248 | 0.69                        | 0.69                         | —  | 0.20         |

### 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         | 110年截至10月<br>累積投資報酬率<br>(%) | 委任迄今<br>(106.6.22~110.10.31) |    |              |
|------|---------------|---------------|-----------------------------|------------------------------|----|--------------|
|      |               |               |                             | 投資<br>報酬率<br>(%)             | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| 貝萊德  | 400,000,000   | 574,004,036   | 14.79                       | 63.29                        | 4  | 62.93        |
| DWS  | 470,000,000   | 667,502,069   | 14.96                       | 64.04                        | 3  |              |
| 道富   | 470,000,000   | 668,115,368   | 14.70                       | 64.25                        | 1  |              |
| 北美信託 | 470,000,000   | 667,959,184   | 14.86                       | 64.21                        | 2  |              |
| 合計   | 1,810,000,000 | 2,577,580,657 | 14.83                       | 63.97                        | —  |              |

### 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         | 110年截至10月<br>累積投資報酬率<br>(%) | 委任迄今<br>(106.7.25~110.10.31) |    |                 |
|------------------|---------------|---------------|-----------------------------|------------------------------|----|-----------------|
|                  |               |               |                             | 投資<br>報酬率<br>(%)             | 排名 | 指標/目標<br>報酬率(%) |
| American Century | 400,000,000   | 449,127,491   | 0.32                        | 12.44                        | 3  | 4.88/15.57      |
| 富達               | 900,000,000   | 1,039,064,326 | -1.47                       | 17.74                        | 1  |                 |
| 富蘭克林<br>坦伯頓      | 400,000,000   | 429,945,108   | 0.54                        | 8.08                         | 4  |                 |
| TCW              | 800,000,000   | 893,579,257   | 1.55                        | 15.46                        | 2  |                 |
| 合計               | 2,500,000,000 | 2,811,716,182 | 0.07                        | 14.15                        | —  |                 |

註：本批次為絕對報酬型，契約目標報酬率係以 US 3-Month T-Bill(指標報酬率)加計 250 個基本點為基準。

### 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         | 110年截至10月<br>累積投資報酬率<br>(%) | 委任迄今<br>(108.1.23~110.10.31) |    |                 |
|--------|---------------|---------------|-----------------------------|------------------------------|----|-----------------|
|        |               |               |                             | 投資<br>報酬率<br>(%)             | 排名 | 指標/目標<br>報酬率(%) |
| Nomura | 300,000,000   | 302,052,068   | 10.39                       | 4.51                         | 5  | 2.96/16.84      |
| 景順     | 480,000,000   | 635,754,596   | 17.64                       | 42.51                        | 1  |                 |
| 威靈頓    | 600,000,000   | 740,520,181   | 8.30                        | 33.80                        | 3  |                 |
| CPR    | 480,000,000   | 638,326,672   | 18.99                       | 41.37                        | 2  |                 |
| 道富     | 500,000,000   | 600,035,261   | 13.25                       | 24.41                        | 4  |                 |
| 合計     | 2,360,000,000 | 2,916,688,778 | 13.70                       | 29.11                        | —  |                 |

註：本批次為絕對報酬型，契約目標報酬率係以 USD 3-Month LIBOR(指標報酬率)加計 500 個基本點為基準。

### 108-1 全球新興市場動態多元因子指數增值股票型

單位：美元

| 受託機構   | 委託金額          | 目前淨資產         | 110年截至10月<br>累積投資報酬率<br>(%) | 委任迄今<br>(108.12.18~110.10.31) |    |              |
|--------|---------------|---------------|-----------------------------|-------------------------------|----|--------------|
|        |               |               |                             | 投資<br>報酬率<br>(%)              | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| Amundi | 400,000,000   | 469,830,696   | 2.50                        | 7.88                          | 3  | 8.57         |
| DWS    | 400,000,000   | 452,503,236   | -0.36                       | 6.22                          | 5  |              |
| Nomura | 400,000,000   | 483,081,270   | 6.46                        | 11.55                         | 2  |              |
| 荷寶     | 300,000,000   | 367,509,422   | 5.61                        | 7.59                          | 4  |              |
| 道富     | 300,000,000   | 384,559,457   | 9.14                        | 11.69                         | 1  |              |
| 合計     | 1,800,000,000 | 2,157,484,081 | 4.56                        | 8.92                          | —  |              |

### 109-1 全球美元公司增值債券型

單位：美元

| 受託機構    | 委託金額          | 目前淨資產         | 110年截至10月<br>累積投資報酬率<br>(%) | 委任迄今<br>(110.1.13~110.10.31) |    |              |
|---------|---------------|---------------|-----------------------------|------------------------------|----|--------------|
|         |               |               |                             | 投資<br>報酬率<br>(%)             | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| DWS     | 400,000,000   | 406,170,855   | -0.35                       | -0.35                        | 5  | 0.65         |
| INSIGHT | 400,000,000   | 406,302,626   | -0.09                       | -0.09                        | 1  |              |
| 摩根      | 400,000,000   | 407,030,746   | -0.23                       | -0.23                        | 4  |              |
| PIMCO   | 400,000,000   | 407,024,086   | -0.12                       | -0.12                        | 3  |              |
| WESTERN | 400,000,000   | 406,084,861   | -0.10                       | -0.10                        | 2  |              |
| 合計      | 2,000,000,000 | 2,032,613,174 | -0.18                       | -0.18                        | —  |              |

### 110-1 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       | 110年截至10月<br>累積投資報酬率<br>(%) | 委任迄今<br>(110.9.8~110.10.31) |    |          |
|-------------|-------------|-------------|-----------------------------|-----------------------------|----|----------|
|             |             |             |                             | 投資報酬率(%)                    | 排名 | 指標報酬率(%) |
| CBRE        | 150,000,000 | 149,693,615 | -0.20                       | -0.20                       | 2  | -0.42    |
| Clearbridge | 150,000,000 | 151,940,558 | 1.29                        | 1.29                        | 1  |          |
| Magellan    | 150,000,000 | 146,112,667 | -2.59                       | -2.59                       | 4  |          |
| RREEF       | 150,000,000 | 148,628,727 | -0.91                       | -0.91                       | 3  |          |
| 合計          | 600,000,000 | 596,375,567 | -0.60                       | -0.60                       | —  |          |

### 110-1 全球多元資產型

單位：美元

| 受託機構          | 委託金額          | 目前淨資產         | 110年截至10月<br>累積投資報酬率(%) | 委任迄今<br>(110.10.15~110.10.31) |    |                 |
|---------------|---------------|---------------|-------------------------|-------------------------------|----|-----------------|
|               |               |               |                         | 投資報酬率(%)                      | 排名 | 指標/目標<br>報酬率(%) |
| 富達            | 200,000,000   | 202,159,406   | 1.08                    | 1.08                          | 2  | 0.002/0.23      |
| 摩根            | 200,000,000   | 202,208,731   | 1.10                    | 1.10                          | 1  |                 |
| Ninety One    | 200,000,000   | 199,307,329   | -0.35                   | -0.35                         | 5  |                 |
| Schroders     | 200,000,000   | 201,184,307   | 0.59                    | 0.59                          | 3  |                 |
| T. Rowe Price | 200,000,000   | 200,729,119   | 0.36                    | 0.36                          | 4  |                 |
| 合計            | 1,000,000,000 | 1,005,588,892 | 0.56                    | 0.56                          | —  |                 |

## 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       | 110 年截至 10 月<br>累積投資報酬率<br>(%) | 委任迄今<br>(108.6.24~110.10.31) |    |                  |
|------|-------------|-------------|--------------------------------|------------------------------|----|------------------|
|      |             |             |                                | 投資<br>報酬率<br>(%)             | 排名 | 指標<br>報酬率<br>(%) |
| 富達   | 786,579,222 | 985,073,289 | 7.25                           | 22.49                        | —  | 30.50            |

### 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         | 110 年截至 10 月<br>累積投資報酬率<br>(%) | 委任迄今<br>(106.1.6~110.10.31) |    |                  |
|-------|---------------|---------------|--------------------------------|-----------------------------|----|------------------|
|       |               |               |                                | 投資<br>報酬率<br>(%)            | 排名 | 指標<br>報酬率<br>(%) |
| PIMCO | 1,123,576,760 | 1,324,823,060 | -5.12                          | 20.86                       | 2  | 16.96            |
| 盧米斯   | 798,763,197   | 963,220,577   | -4.97                          | 22.12                       | 1  |                  |
| 合計    | 1,922,339,957 | 2,288,043,637 | -5.06                          | 21.42                       | —  |                  |

### 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         | 110 年截至 10 月<br>累積投資報酬率<br>(%) | 委任迄今<br>(106.2.6~110.10.31) |    |                  |
|------|-------------|---------------|--------------------------------|-----------------------------|----|------------------|
|      |             |               |                                | 投資<br>報酬率<br>(%)            | 排名 | 指標<br>報酬率<br>(%) |
| 貝萊德  | 756,337,413 | 1,390,660,151 | 14.73                          | 83.87                       | —  | 86.43            |

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       | 110 年截至 10 月<br>累積投資報酬率<br>(%) | 委任迄今<br>(106.11.17~110.10.31) |    |                  |
|------|-------------|-------------|--------------------------------|-------------------------------|----|------------------|
|      |             |             |                                | 投資<br>報酬率<br>(%)              | 排名 | 指標<br>報酬率<br>(%) |
| 景順   | 307,323,526 | 379,946,754 | 3.81                           | 28.63                         | —  | 28.29            |

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         | 110 年截至 10 月<br>累積投資報酬率<br>(%) | 委任迄今<br>(106.3.6~110.10.31) |    |                  |
|--------|---------------|---------------|--------------------------------|-----------------------------|----|------------------|
|        |               |               |                                | 投資<br>報酬率<br>(%)            | 排名 | 指標<br>報酬率<br>(%) |
| 貝萊德    | 255,588,950   | 417,751,635   | 19.33                          | 56.23                       | 3  | 54.71            |
| 道富     | 258,539,391   | 424,272,123   | 19.38                          | 56.75                       | 2  |                  |
| 瑞銀     | 256,994,133   | 420,240,996   | 19.45                          | 56.15                       | 4  |                  |
| Nomura | 257,549,840   | 424,591,491   | 19.27                          | 57.21                       | 1  |                  |
| 合計     | 1,028,672,314 | 1,686,856,245 | 19.36                          | 56.59                       | —  |                  |

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       | 110 年截至 10 月<br>累積投資報酬率<br>(%) | 委任迄今<br>(107.6.13~110.10.31) |    |                  |
|------|-------------|-------------|--------------------------------|------------------------------|----|------------------|
|      |             |             |                                | 投資<br>報酬率<br>(%)             | 排名 | 指標<br>報酬率<br>(%) |
| 貝萊德  | 671,455,711 | 834,588,330 | 7.90                           | 24.30                        | —  | 23.67            |

## 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         | 110年截至10月<br>累積投資報酬率<br>(%) | 委任迄今<br>(108.1.22~110.10.31) |    |              |
|------|---------------|---------------|-----------------------------|------------------------------|----|--------------|
|      |               |               |                             | 投資<br>報酬率<br>(%)             | 排名 | 指標<br>報酬率(%) |
| 瑞萬通博 | 287,169,673   | 479,488,021   | 13.12                       | 66.97                        | 1  | 32.27        |
| MFS  | 246,618,331   | 332,539,536   | 13.26                       | 34.84                        | 3  |              |
| 威靈頓  | 503,548,464   | 730,752,525   | 11.48                       | 45.12                        | 2  |              |
| 合計   | 1,037,336,468 | 1,542,780,082 | 12.37                       | 48.73                        | —  |              |

## 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       | 110年截至10月<br>累積投資報酬率<br>(%) | 委任迄今<br>(108.5.29~110.10.31) |    |                  |
|--------|-------------|-------------|-----------------------------|------------------------------|----|------------------|
|        |             |             |                             | 投資<br>報酬率<br>(%)             | 排名 | 指標<br>報酬率<br>(%) |
| Lazard | 713,987,040 | 858,772,064 | 10.42                       | 21.20                        | —  | 19.46            |

## 102-2 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       | 110年截至10月<br>累積投資報酬率<br>(%) | 委任迄今<br>(108.8.27~110.10.31) |    |              |
|----------|-------------|-------------|-----------------------------|------------------------------|----|--------------|
|          |             |             |                             | 投資<br>報酬率(%)                 | 排名 | 指標<br>報酬率(%) |
| 信安<br>環球 | 610,886,182 | 767,544,738 | 19.91                       | 21.54                        | 2  | 16.01        |
| AMP      | 126,937,100 | 161,152,766 | 22.94                       | 26.95                        | 1  |              |
| 合計       | 737,823,282 | 928,697,504 | 20.43                       | 22.53                        | —  |              |

### 105-1 全球多元資產型 (續約)

單位：美元

| 受託機構    | 委託金額          | 目前淨資產         | 110年截至10月<br>累積投資報酬率<br>(%) | 委任迄今<br>(110.7.20~110.10.31) |    |                 |
|---------|---------------|---------------|-----------------------------|------------------------------|----|-----------------|
|         |               |               |                             | 投資<br>報酬率<br>(%)             | 排名 | 指標/目標<br>報酬率(%) |
| Allianz | 155,447,975   | 161,364,970   | 3.81                        | 3.81                         | 2  | 0.01/1.43       |
| 摩根      | 594,592,070   | 617,308,848   | 3.82                        | 3.82                         | 1  |                 |
| DWS     | 311,387,682   | 314,260,594   | 0.92                        | 0.92                         | 4  |                 |
| 柏瑞      | 254,823,294   | 262,492,654   | 3.01                        | 3.01                         | 3  |                 |
| 合計      | 1,316,251,021 | 1,355,427,066 | 2.98                        | 2.98                         | —  |                 |

註：本批次為絕對報酬型，契約目標報酬率係以 USD 3-Month T-Bill (指標報酬率)加計 500 個基點為基準。

### 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       | 110年截至10月<br>累積投資報酬率<br>(%) | 委任迄今<br>(106.6.22~110.10.31) |    |                  |
|------|-------------|-------------|-----------------------------|------------------------------|----|------------------|
|      |             |             |                             | 投資<br>報酬率<br>(%)             | 排名 | 指標<br>報酬率<br>(%) |
| 貝萊德  | 150,000,000 | 231,237,148 | 14.71                       | 62.94                        | 4  | 62.93            |
| DWS  | 150,000,000 | 232,897,604 | 14.96                       | 64.25                        | 2  |                  |
| 道富   | 150,000,000 | 233,236,251 | 14.68                       | 64.41                        | 1  |                  |
| 北美信託 | 150,000,000 | 232,632,032 | 14.82                       | 63.90                        | 3  |                  |
| 合計   | 600,000,000 | 930,003,035 | 14.79                       | 63.87                        | —  |                  |

### 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         | 110年截至10月<br>累積投資報酬率<br>(%) | 委任迄今<br>(106.7.25~110.10.31) |    |                 |
|------------------|---------------|---------------|-----------------------------|------------------------------|----|-----------------|
|                  |               |               |                             | 投資<br>報酬率(%)                 | 排名 | 指標/目標<br>報酬率(%) |
| American Century | 300,000,000   | 335,990,290   | 0.30                        | 12.53                        | 3  | 4.88/15.57      |
| 富達               | 300,000,000   | 354,665,925   | -1.97                       | 17.92                        | 1  |                 |
| 富蘭克林<br>坦伯頓      | 300,000,000   | 319,593,873   | 0.54                        | 8.13                         | 4  |                 |
| TCW              | 300,000,000   | 347,145,381   | 1.81                        | 17.60                        | 2  |                 |
| 合計               | 1,200,000,000 | 1,357,395,469 | 0.13                        | 14.08                        | —  |                 |

註：本批次為絕對報酬型，契約目標報酬率係以 US 3-Month T-Bill(指標報酬率)加計 250 個基點為基準。

## 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       | 110年截至10月<br>累積投資報酬率<br>(%) | 委任迄今<br>(108.1.23~110.10.31) |    |                 |
|--------|-------------|-------------|-----------------------------|------------------------------|----|-----------------|
|        |             |             |                             | 投資<br>報酬率<br>(%)             | 排名 | 指標/目標<br>報酬率(%) |
| Nomura | 40,000,000  | 36,275,184  | 10.59                       | 4.44                         | 5  | 2.96/16.84      |
| 景順     | 80,000,000  | 109,821,946 | 17.40                       | 41.67                        | 1  |                 |
| 威靈頓    | 80,000,000  | 101,041,785 | 8.32                        | 33.90                        | 3  |                 |
| CPR    | 80,000,000  | 110,689,381 | 19.18                       | 41.55                        | 2  |                 |
| 道富     | 80,000,000  | 94,099,033  | 13.28                       | 24.25                        | 4  |                 |
| 合計     | 360,000,000 | 451,927,329 | 14.25                       | 30.06                        | —  |                 |

註：本批次為絕對報酬型，契約目標報酬率係以USD 3-Month LIBOR(指標報酬率)加計500個基點為基準。

## 110-1 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       | 110年截至10月<br>累積投資報酬率<br>(%) | 委任迄今<br>(110.9.8~110.10.31) |    |                 |
|-------------|-------------|-------------|-----------------------------|-----------------------------|----|-----------------|
|             |             |             |                             | 投資<br>報酬率(%)                | 排名 | 指標/目標<br>報酬率(%) |
| CBRE        | 30,000,000  | 29,938,799  | -0.20                       | -0.20                       | 2  | -0.42           |
| ClearBridge | 30,000,000  | 30,391,354  | 1.30                        | 1.30                        | 1  |                 |
| Magellan    | 30,000,000  | 29,223,933  | -2.59                       | -2.59                       | 4  |                 |
| RREEF       | 30,000,000  | 29,726,981  | -0.91                       | -0.91                       | 3  |                 |
| 合計          | 120,000,000 | 119,281,067 | -0.60                       | -0.60                       | —  |                 |

### (二)110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)

110年10月31日

1. 避險：

| 種類     | 避險比率  |
|--------|-------|
| 權益證券避險 | 0%    |
| 匯率避險   | 5.52% |

2. 投資：無

(二)舊制勞工退休基金自營部位

(依交易目的)

110年10月31日

1. 避險：

| 種類     | 避險比率 |
|--------|------|
| 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：新臺幣元

|         | 餘絀             | 收入             | 支出            |
|---------|----------------|----------------|---------------|
| 110年10月 | 51,827,551,281 | 58,940,463,805 | 7,112,912,524 |

## (二)舊制勞工退休基金

單位：新臺幣元

|         | 餘絀             | 收入             | 支出          |
|---------|----------------|----------------|-------------|
| 110年10月 | 17,406,429,939 | 17,945,990,545 | 539,560,606 |

## 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

110年10月份

單位：新臺幣元

| 項 目     | 金 額             |
|---------|-----------------|
| 現金收入    | 222,057,353,636 |
| 現金支出    | 215,331,832,710 |
| 現金增(減)數 | 6,725,520,926   |

### (二)舊制勞工退休基金

110年10月份

單位：新臺幣元

| 項 目     | 金 額            |
|---------|----------------|
| 現金收入    | 27,973,727,163 |
| 現金支出    | 27,974,330,099 |
| 現金增(減)數 | -602,936       |