

勞工退休基金運用情形

一、勞工退休基金 97 年 1 月迄今整體績效

截至 103 年 8 月底

新制基金	3.6230%
舊制基金	3.1178%

註：舊制基金自 76 年 6 月之績效則為 5.0962%

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

單位：新台幣萬元

至 103 年 8 月底止基金規模與收益		
基金運用規模		1 兆 2,181 億 1,841 萬元
103 年截至 8 月底止 運用總損益及評價後報酬率	自行運用	105 億 6,885 萬元 1.92%
	委託經營	560 億 678 萬元 9.45%
	合計	665 億 7,564 萬元 5.82%

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 8 月之保證收益率為 1.3916%。

2. 舊制勞工退休基金

至 103 年 8 月底止基金規模與收益		
基金運用規模		6,164 億 1,617 萬元
103 年截至 8 月底止 運用總損益及評價後報酬率	自行運用	171 億 7,810 萬元 5.43%
	委託經營	226 億 699 萬元 8.52%
	合 計	397 億 8,509 萬元 6.84%

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

(二) 資產配置

1. 新制勞工退休基金

截至 103 年 8 月底

單位：新台幣元

項 目	餘 額	占基金運用比例(%)
自行運用	543,406,756,606	44.61
轉存金融機構	207,776,649,887	17.06
短期票券	33,355,854,578	2.74
公債、公司債及金融債券	157,105,485,792	12.90
貨幣型基金	0	0.00
股票及受益憑證投資(含期貨)	19,264,923,352	1.58
國外投資	125,903,842,997	10.33
固定收益	109,364,249,002	8.97
權益證券	10,809,098,128	0.89
另類投資	5,730,495,867	0.47
委託經營	674,711,648,809	55.39
國內委託經營	261,201,325,120	21.44
國外委託經營	413,510,323,689	33.95
固定收益	146,654,610,557	12.04
權益證券	216,110,627,307	17.74
另類投資	50,745,085,825	4.17
合 計	1,218,118,405,415	100.00

2. 舊制勞工退休基金

截至 103 年 8 月底

單位：新台幣元

項 目	餘 額	占基金運用比例(%)
自行運用	361,160,816,579	58.59
轉存金融機構	136,964,090,709	22.22
短期票券	26,648,448,280	4.32
公債、金融債券、公司債及證券化商品	59,970,393,696	9.73
貨幣型基金	0	0.00
股票及受益憑證投資(含期貨)	61,878,340,770	10.04
國外投資	75,699,543,124	12.28
固定收益	43,113,947,300	6.99
權益證券	26,430,723,931	4.29
另類投資	6,154,870,893	1.00
委託經營	255,255,354,683	41.41
國內委託經營	101,347,350,957	16.44
國外委託經營	153,908,003,726	24.97
固定收益	53,522,962,614	8.68
權益證券	91,507,334,983	14.85
另類投資	8,877,706,129	1.44
合 計	616,416,171,262	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 103 年 8 月底

單位：新台幣元

項 目	金 額	占基金運用比例 (%)
自行運用	543,406,756,606	44.61
委託經營	674,711,648,809	55.39

2. 舊制勞工退休基金

截至 103 年 8 月底

單位：新台幣元

項 目	金 額	占基金運用比例 (%)
自行運用	361,160,816,579	58.59
委託經營	255,255,354,683	41.41

(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 103 年 8 月底

單位：新台幣元

項 目	金 額	占基金運用比例 (%)
國 內 投 資	678,704,238,729	55.72
國 外 投 資	539,414,166,686	44.28

2. 舊制勞工退休基金

截至 103 年 8 月底

單位：新台幣元

項 目	金 額	占基金運用比例 (%)
國 內 投 資	386,808,624,412	62.75
國 外 投 資	229,607,546,850	37.25

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 103 年 8 月底

項 目	收益率 (%)
國內權益證券	19.27

2. 舊制勞工退休基金

截至 103 年 8 月底

項 目	收益率 (%)
國內權益證券	18.21

(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 103 年 8 月底

單位：新台幣元

項 目	金 額	比 例 (%)
國內權益證券	19,264,923,352	1.58

2. 舊制勞工退休基金

截至 103 年 8 月底

單位：新台幣元

項 目	金 額	比 例 (%)
國內權益證券	61,878,340,770	10.04

註：不含貨幣型基金

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 8 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (102.9.27~103.8.31)		
				投資報酬率 (%)	委託經營排名	大盤報酬率(%)
安泰	7,804,845,205	9,253,164,906	15.17	18.56	—	15.29

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 8 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (103.1.20~103.8.31)		
				投資報酬率 (%)	委託經營排名	大盤報酬率(%)
安泰	5,783,138,827	6,684,931,198	15.59	15.59	—	9.78

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 8 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (100.10.8~103.8.31)		
				投資報酬率 (%)	委託經營排名	大盤報酬率(%)
富邦	6,747,919,987	7,990,618,642	9.42	18.42	2	30.84
群益	7,256,147,326	8,802,813,816	10.29	21.32	1	
合計	14,004,067,313	16,793,432,458	9.88	19.92	—	

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 8 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (101.7.14~103.8.31)		
				投資報酬率 (%)	委託經營排名	大盤報酬率(%)
安泰	3,421,364,679	4,513,612,339	15.31	31.92	1	32.83
保德信	3,423,163,553	4,350,642,316	8.27	27.09	2	
合計	6,844,528,232	8,864,254,655	11.74	29.51	—	

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 8 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (102.3.9~103.8.31)		
				投資報酬率 (%)	委託經營排名	大盤報酬率(%)
保德信	7,790,534,548	8,950,654,065	8.24	14.89	—	17.73

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 8 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (99.11.30~103.8.31)		
				投資報酬率 (%)	委託經營排名	大盤報酬率(%)
永豐	5,000,000,000	5,410,124,967	6.76	8.20	3	12.78
國泰	5,000,000,000	6,421,367,217	7.25	28.43	1	
富邦	5,000,000,000	5,968,764,078	9.06	19.38	2	
滙豐中華	5,000,000,000	5,025,096,451	6.31	0.50	4	
合計	20,000,000,000	22,825,352,713	7.39	14.13	—	

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 8 月 累積投資報酬 (%)	委任迄今 (100.7.15~103.8.31)		
				投資報酬 率(%)	委託經 營排名	大盤/指 標報酬率 (%)
國泰	5,000,000,000	6,864,752,650	11.26	20.14	4	11.26/ 27.30
富邦	5,000,000,000	6,838,000,866	11.88	22.83	3	
復華	11,294,673,623	14,352,111,075	11.66	24.99	2	
滙豐中華	12,034,391,172	15,363,268,475	12.02	25.26	1	
合計	33,329,064,795	43,418,133,066	11.72	23.29	—	

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 8 月 累積投資報酬 (%)	委任迄今 (100.8.10~103.8.31)		
				投資報酬 率(%)	委託經 營排名	大盤報 酬率(%)
保德信	3,000,000,000	3,660,366,191	11.36	22.01	2	25.93
統一	3,000,000,000	3,601,904,948	15.98	20.06	3	
富邦	3,000,000,000	3,260,077,566	9.98	8.67	5	
復華	3,000,000,000	3,884,077,183	11.71	29.47	1	
摩根	3,000,000,000	3,301,987,454	6.72	10.07	4	
合計	15,000,000,000	17,708,413,342	11.18	18.06	—	

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 8 月 累積投資報酬 (%)	委任迄今 (100.11.23~103.8.31)		
				投資報酬 率(%)	委託經 營排名	大盤報 酬率(%)
保德信	2,000,000,000	2,496,098,318	10.85	24.80	3	34.80
統一	2,000,000,000	2,564,918,780	16.12	28.25	2	
富邦	2,000,000,000	2,319,666,738	9.83	15.98	5	
復華	2,000,000,000	2,763,144,640	11.91	38.16	1	
滙豐中華	2,000,000,000	2,404,498,124	8.19	20.22	4	
摩根	2,000,000,000	2,213,704,624	6.72	10.69	6	
合計	12,000,000,000	14,762,031,224	10.67	23.02	—	

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 8 月 累積投資報酬 (%)	委任迄今 (102.4.22~103.8.31)		
				投資報酬 率(%)	委託經 營排名	大盤報 酬率(%)
復華	4,511,827,956	5,419,008,381	12.76	20.11	—	18.98

100 年第二次委託經營 B 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 8 月 累積投資報酬 (%)	委任迄今 (103.8.6~103.8.31)		
				投資報酬 率(%)	委託經 營排名	大盤報 酬率(%)
復華	5,480,000,000	5,545,532,265	1.20	1.20	—	3.23

101 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 8 月 累積投資報酬 (%)	委任迄今 (101.4.18~103.8.31)		
				投資報酬 率(%)	委託經 營排名	大盤/指 標報酬 率(%)
國泰	4,500,000,000	5,662,491,416	12.93	32.84	2	24.39/ 36.79
滙豐中華	9,546,945,283	11,429,364,208	12.38	33.73	1	
合計	14,046,945,283	17,091,855,624	12.36	32.94	—	

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 8 月 累積投資報酬 (%)	委任迄今 (101.7.16~103.8.31)		
				投資報酬 率(%)	委託經 營排名	大盤報 酬率(%)
安泰	5,000,000,000	6,484,493,439	15.22	29.69	2	32.83
保德信	5,000,000,000	5,986,629,151	10.41	19.73	6	
國泰	5,000,000,000	6,338,369,842	16.21	26.77	3	
統一	5,000,000,000	6,949,449,852	19.23	38.99	1	
富邦	5,000,000,000	6,088,283,040	8.77	21.77	4	
滙豐中華	5,000,000,000	6,020,392,926	7.42	20.41	5	
合計	30,000,000,000	37,867,618,250	12.92	26.23	—	

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 8 月 累積投資報酬 (%)	委任迄今 (102.6.7~103.8.31)		
				投資報酬 率(%)	委託經 營排名	大盤報 酬率(%)
國泰	2,500,000,000	2,922,096,335	8.69	16.88	3	16.55
統一	2,500,000,000	3,119,215,944	16.14	24.77	1	
富邦	2,500,000,000	2,755,862,730	5.53	10.23	6	
復華	2,500,000,000	2,955,662,571	13.45	18.23	2	
德盛安聯	2,500,000,000	2,887,626,715	10.10	15.51	4	
摩根	2,500,000,000	2,768,914,939	7.64	10.76	5	
合計	15,000,000,000	17,409,379,234	10.28	16.06	—	

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 8 月 累積投資報酬 (%)	委任迄今 (102.11.22~103.8.31)		
				投資報酬 率(%)	委託經 營排名	大盤報 酬率(%)
國泰	2,500,000,000	2,694,488,664	6.18	7.78	5	16.51
統一	2,500,000,000	2,927,668,919	13.86	17.11	1	
富邦	2,500,000,000	2,679,123,677	5.88	7.16	6	
復華	2,500,000,000	2,893,110,818	13.03	15.72	2	
德盛安聯	2,500,000,000	2,826,687,875	11.33	13.07	3	
摩根	2,500,000,000	2,703,151,840	7.59	8.13	4	
合計	15,000,000,000	16,724,231,793	9.66	11.49	—	

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 8 月 累積投資報酬 (%)	委任迄今 (103.1.20~103.8.31)		
				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	3,358,301,437	11.94	11.94	5	9.78/ 13.04
統一	3,000,000,000	3,381,842,697	12.73	12.73	3	
富邦	3,000,000,000	3,316,802,800	10.56	10.56	6	
復華	3,000,000,000	3,470,823,520	15.69	15.69	1	
群益	3,000,000,000	3,421,906,018	14.06	14.06	2	
滙豐中華	3,000,000,000	3,368,338,767	12.28	12.28	4	
合計	18,000,000,000	20,318,015,239	12.88	12.88	—	

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

單位：新台幣元

投信 名稱	委託金額	目前淨資產	103 年截至 8 月 累積投資報酬 (%)	委任迄今 (103.8.11~103.8.31)		
				投資報酬 率(%)	委託經 營排名	大盤/指 標報酬 率(%)
國泰	7,000,000,000	7,047,504,019	0.68	0.68	3	3.86
統一	7,000,000,000	7,055,019,541	0.79	0.79	2	
復華	7,000,000,000	7,064,399,543	0.92	0.92	1	
合計	21,000,000,000	21,166,923,103	0.79	0.79	—	

2. 舊制勞工退休基金

國內 98 年第二次委託經營(續)

單位：新台幣元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	103 年截至 8 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (102.1.26~103.8.31)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤 報酬率(%)
保德信	3,380,116,383	4,038,227,295	7.85	19.47	2	22.99
富邦	3,208,581,038	3,812,094,525	9.04	18.81	3	
統一	3,514,321,648	4,711,760,683	16.31	34.07	1	
合計	10,103,019,069	12,562,082,503	11.25	24.34	—	

國內 100 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	103 年截至 8 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (100.3.17~103.8.31)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤 報酬率(%)
保德信	5,000,000,000	5,653,100,556	8.23	13.06	5	13.35
群益	5,000,000,000	6,151,022,832	13.74	23.02	2	
復華	5,000,000,000	6,014,594,879	11.60	20.29	3	
國泰	5,000,000,000	5,795,455,665	9.58	15.91	4	
統一	5,000,000,000	6,576,077,075	16.78	31.52	1	
合計	25,000,000,000	30,190,251,007	12.06	20.76	—	

國內 101 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 8 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (101.10.30~103.8.31)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤/指標 報酬率(%)
匯豐中華	2,163,012,619	2,633,388,775	12.49	38.53	—	33.06/41.05

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

單位：新台幣元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	103 年截至 8 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (101.4.30~103.8.31)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤 報酬率(%)
保德信	5,000,000,000	5,945,907,954	9.11	18.92	6	26.14
群益	5,000,000,000	6,127,326,316	10.11	22.55	3	
匯豐中華	5,000,000,000	6,089,611,400	8.48	21.79	4	
安泰	5,000,000,000	6,602,111,821	12.92	32.04	1	
國泰	5,000,000,000	6,089,145,664	10.23	21.78	5	
統一	5,000,000,000	6,335,550,611	15.66	26.71	2	
合計	30,000,000,000	37,189,653,766	11.09	23.97	—	

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	103 年截至 8 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (102.6.7~103.8.31)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤 報酬率(%)
德盛安聯	2,500,000,000	2,887,728,119	10.10	15.51	4	16.55
復華	2,500,000,000	2,955,783,627	13.45	18.23	2	
國泰	2,500,000,000	2,922,210,852	8.70	16.89	3	
富邦	2,500,000,000	2,755,990,218	5.53	10.24	6	
摩根	2,500,000,000	2,769,025,598	7.64	10.76	5	
統一	2,500,000,000	3,119,344,831	16.14	24.77	1	
合計	15,000,000,000	17,410,083,245	10.29	16.07	—	

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	103 年截至 8 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (102.11.22~103.8.31)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤 報酬率(%)
德盛安聯	2,500,000,000	2,826,766,378	11.33	13.07	3	16.51
復華	2,500,000,000	2,893,192,656	13.03	15.73	2	
國泰	2,500,000,000	2,694,564,575	6.19	7.78	5	
富邦	2,500,000,000	2,679,203,997	5.88	7.17	6	
摩根	2,500,000,000	2,703,227,889	7.60	8.13	4	
統一	2,500,000,000	2,927,753,617	13.86	17.11	1	
合計	15,000,000,000	16,724,709,112	9.67	11.50	—	

(二) 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：

投信名稱	收回日期	收回委託金額	經理人	收回理由
100-1P 元大寶來	103.2.13	50 億	謝○○	委託經營投資契約第 23 條規定，收回全數委託資產
101-1 元大寶來	103.2.13	45 億	林○○	委託經營投資契約第 23 條規定，收回全數委託資產
101-1 富邦	103.8.5	45 億	詹○○	委託經營投資契約第 23 條規定，收回全數委託資產

舊制勞工退休基金：

投信名稱	收回日期	收回委託金額	經理人	收回理由
99-1 日盛	103.2.13	40 億元	黃○○	委託經營投資契約第 23 條規定，收回全數委託資產
101-1 元大寶來	103.2.13	10 億元	張○○	委託經營投資契約第 23 條規定，收回全數委託資產

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8月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (101.5.21~103.8.31)		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率(%)
坦伯頓	500,000,000	771,269,012	4.33	66.08	—	52.22

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8月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (101.6.4~103.8.31)		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率(%)
聯博	750,000,000	792,580,829	4.88	5.68	2	4.85
高盛	400,000,000	419,827,514	3.05	4.96	3	
坦伯頓	650,000,000	762,066,888	5.68	17.24	1	
合計	1,800,000,000	1,974,475,231	4.79	9.69	—	

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8月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (102.1.7~103.8.31)		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率(%)
太平洋	615,416,988	636,494,754	5.73	3.42	1	3.01
高盛	479,694,715	492,640,718	3.08	2.70	2	
合計	1,095,111,703	1,129,135,472	4.55	3.11	—	

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 8 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (102. 2. 5~103. 8. 31)		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率(%)
貝萊德	384,277,868	512,555,676	8.77	33.38	1	26.25
摩根	587,857,352	748,534,443	7.41	27.33	2	
合計	972,135,220	1,261,090,119	7.96	29.72	—	

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 8 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (102. 11. 18~103. 8. 31)		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率(%)
景順	471,501,358	539,082,209	13.42	14.33	—	11.14

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 8 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (102. 12. 2~103. 8. 31)		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率(%)
貝萊德	299,329,552	327,029,188	7.31	9.25	2	9.06
道富	349,680,272	382,245,700	7.44	9.31	1	
合計	649,009,824	709,274,888	7.38	9.29	—	

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	103 年截至 8 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (103.8.25~103.8.31)		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率(%)
摩根士丹利	403,049,882	406,905,436	0.96	0.96	2	0.53
瑞萬通博	716,993,858	726,188,487	1.28	1.28	1	
合計	1,120,043,740	1,133,093,923	1.17	1.17	—	

100-1 全球基本面指數被動股票型

單位：美元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	103 年截至 8 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (100.7.1~103.8.31、 100.7.13~103.8.31)		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率(%)
道富	300,000,000	406,422,254	7.28	35.47	2	34.60
貝萊德	300,000,000	416,971,673	7.35	38.98	1	38.43
合計	600,000,000	823,393,927	7.32	37.23	—	—

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 8 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (101.3.6~103.8.31)		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率(%)
Cohen & Steers	550,000,000	655,996,597	13.11	35.69	2	32.18
景順	600,000,000	726,765,583	14.28	36.74	1	
EII	400,000,000	492,662,375	10.02	29.45	3	
合計	1,550,000,000	1,875,424,555	12.64	33.94	—	

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8月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (101.7.31~103.8.31)		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率(%)
Ashmore	300,000,000	308,769,011	7.06	6.30	1	6.59
Bluebay	300,000,000	306,687,594	6.60	4.45	2	
實港	300,000,000	299,116,125	6.34	1.59	4	
Pictet	300,000,000	302,878,981	6.41	2.92	3	
合計	1,200,000,000	1,217,451,711	6.60	3.81	—	

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	103年截至8月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (102.4.18~103.8.31)		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率(%)
道富	500,000,000	557,206,454	9.14	11.19	1	10.86
貝萊德	500,000,000	555,466,373	9.25	10.82	2	
合計	1,000,000,000	1,112,672,827	9.20	11.00	—	

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	103年截至8月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (103.1.22~103.8.31)		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率(%)
瑞萬通博	500,000,000	518,674,888	6.70	6.70	2	8.16
MFS	500,000,000	515,344,382	6.62	6.62	3	
威靈頓	500,000,000	522,358,270	8.60	8.60	1	
合計	1500,000,000	1,556,377,540	7.31	7.31	—	

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	103 年截至 8 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (103.4.25~103.8.31)		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率(%)
Bluebay	200,000,000	201,572,372	1.63	1.63	2	1.96
貝萊德	200,000,000	202,118,267	1.74	1.74	1	
盧米斯	200,000,000	202,047,965	1.61	1.61	3	
合計	600,000,000	605,738,604	1.66	1.66	—	

2. 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 8 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (100.6.21~103.8.31)		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率(%)
富達國際	425,533,349	572,405,795	5.33	32.19	-	31.11

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 8 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (102.1.6~103.8.31)		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率(%)
太平洋	731,384,466	752,053,547	5.42	2.83	1	3.01
盧米斯	712,476,555	726,427,498	4.00	1.96	2	
合計	1,443,861,021	1,478,481,045	4.72	2.40	—	

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 8 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (102.2.5~103.8.31)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
貝萊德	384,953,368	513,426,420	8.78	33.37	-	26.25

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 8 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (102.11.17~103.8.31)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
景順	262,187,756	301,042,434	13.58	14.82	-	11.14

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 8 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (101.3.6~103.8.31)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
貝萊德	300,000,000	381,052,092	7.40	41.96	3	41.70
道富	300,000,000	381,426,128	7.38	42.37	1	
瑞銀環球	300,000,000	379,821,308	7.07	41.73	4	
野村	300,000,000	381,358,859	7.35	42.35	2	
合計	1,200,000,000	1,523,658,387	7.30	42.10	—	

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	103 年截至 8 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (102.6.13~103.8.31)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
貝萊德	300,000,000	329,102,179	9.08	14.82	—	14.90

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 8 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (103.1.22~103.8.31)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
瑞萬通博	150,000,000	159,040,869	6.80	6.80	2	8.16
MFS	150,000,000	158,810,748	6.79	6.79	3	
威靈頓	150,000,000	161,457,923	8.75	8.75	1	
合計	450,000,000	479,309,540	7.45	7.45	—	

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	103 年截至 8 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (103.5.29~103.8.31)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
Lazard	100,000,000	100,455,430	1.35	1.35	2	3.00
Cohen & Steers	100,000,000	101,891,461	2.88	2.88	1	
合計	200,000,000	202,346,891	2.12	2.12	—	

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	103 年截至 8 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (103.8.27~103.8.31)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
PGI	50,000,000	49,925,839	-0.15	-0.15	1	0.06
AMP	50,000,000	49,806,886	-0.39	-0.39	2	
合計	100,000,000	99,732,725	-0.27	-0.27	—	

(二)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

1. 新制勞工退休基金：無
2. 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)

103年8月31日

1. 避險：

種類	避險比例
權益證券避險	0%
匯率避險	7.62%

2. 投資：無

(二)舊制勞工退休基金自營部位

(依交易目的)

103年8月31日

1. 避險：

種類	避險比例
權益證券避險	0%
匯率避險	1.19%

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	營業收入	營業支出
103年8月	12,391,760,600	19,568,613,988	7,176,853,388

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	營業收入	營業支出
103年8月	8,907,871,799	9,380,814,644	472,942,845

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

103年8月份

單位：新台幣元

項 目	金 額
基金收入	217,834,932,005
基金支出	219,850,949,336
現金增(減)數	-2,016,017,331

註：本表採現金基礎。

(二)舊制勞工退休基金

103年8月份

單位：新台幣元

項 目	金 額
基金收入	41,950,965,263
基金支出	41,950,349,994
現金增(減)數	615,269

註：本表採現金基礎。