

# 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(109 年 1 月)績效

| 基金別  | 收益率    | 台灣 10 年期<br>公債殖利率 | 台灣<br>加權股價指數 | MSCI<br>全球股票指數 | Barclays<br>全球債券指數 |
|------|--------|-------------------|--------------|----------------|--------------------|
| 新制基金 | -0.73% | 0.63%             | -4.18%       | -1.10%         | 1.28%              |
| 舊制基金 | -0.86% |                   |              |                |                    |

註：股、債指數係依據勞動部 103 年 12 月 15 日勞動福 4 字第 1030136646 號函核定之勞動基金投資政策書所載參考指標，且均為原幣別報酬率。

### (二) 近一年(108 年)績效

| 基金別  | 收益率    | 台灣 10 年期<br>公債殖利率 | 台灣<br>加權股價指數 | MSCI<br>全球股票指數 | Barclays<br>全球債券指數 |
|------|--------|-------------------|--------------|----------------|--------------------|
| 新制基金 | 11.45% | 0.72%             | 23.33%       | 26.60%         | 6.84%              |
| 舊制基金 | 13.47% |                   |              |                |                    |

### (三) 近三年(106~108 年)平均績效

| 基金別  | 收益率   | 台灣 10 年期<br>公債殖利率 | 台灣<br>加權股價指數 | MSCI<br>全球股票指數 | Barclays<br>全球債券指數 |
|------|-------|-------------------|--------------|----------------|--------------------|
| 新制基金 | 5.94% | 0.91%             | 9.04%        | 12.44%         | 4.27%              |
| 舊制基金 | 6.42% |                   |              |                |                    |

### (四) 近五年(104~108 年)平均績效

| 基金別  | 收益率   | 台灣 10 年期<br>公債殖利率 | 台灣<br>加權股價指數 | MSCI<br>全球股票指數 | Barclays<br>全球債券指數 |
|------|-------|-------------------|--------------|----------------|--------------------|
| 新制基金 | 4.54% | 0.99%             | 5.21%        | 8.41%          | 2.31%              |
| 舊制基金 | 4.88% |                   |              |                |                    |

## 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 109 年 1 月底止基金規模與收益          |      |                 |                           |
|-------------------------------|------|-----------------|---------------------------|
| 基金運用規模                        |      |                 | 2 兆 4,747 億 1,993 萬元      |
| 109 年截至 1 月底止<br>運用總損益及評價後報酬率 | 自行運用 | 國內固定收益          | 6 億 4,360 萬元<br>1.01%     |
|                               |      | 國內權益證券<br>及國外投資 | -39 億 9,172 萬元<br>-1.26%  |
|                               | 委託經營 |                 | -146 億 7,908 萬元<br>-1.06% |
|                               | 合 計  |                 | -180 億 2,720 萬元<br>-0.73% |

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÷109 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 3：109 年 1 月之保證收益率為 1.0541%。

#### 2. 舊制勞工退休基金

| 至 109 年 1 月底止基金規模與收益          |      |                 |                          |
|-------------------------------|------|-----------------|--------------------------|
| 基金運用規模                        |      |                 | 9,475 億 8,246 萬元         |
| 109 年截至 1 月底止<br>運用總損益及評價後報酬率 | 自行運用 | 國內固定收益          | 1 億 9,830 萬元<br>0.88%    |
|                               |      | 國內權益證券<br>及國外投資 | -36 億 7,575 萬元<br>-1.83% |
|                               | 委託經營 |                 | -38 億 7,945 萬元<br>-0.83% |
|                               | 合 計  |                 | -73 億 5,690 萬元<br>-0.86% |

註：評價後報酬率係以當期報酬率（即收益÷109 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 109 年 1 月底

單位：新台幣元

| 項 目             | 餘 額                      | 占基金運用比例(%)    |
|-----------------|--------------------------|---------------|
| <b>自行運用</b>     | <b>1,081,468,866,851</b> | <b>43.70</b>  |
| 轉存金融機構          | 517,091,812,055          | 20.89         |
| 短期票券            | 35,724,869,183           | 1.45          |
| 公債、公司債、金融債券及特別股 | 208,726,418,048          | 8.43          |
| 股票及受益憑證投資(含期貨)  | 98,989,083,702           | 4.00          |
| 國外投資            | 220,936,683,863          | 8.93          |
| 固定收益            | 147,505,152,243          | 5.96          |
| 權益證券            | 39,118,347,816           | 1.58          |
| 另類投資            | 34,313,183,804           | 1.39          |
| <b>委託經營</b>     | <b>1,393,251,068,026</b> | <b>56.30</b>  |
| 國內委託經營          | 334,854,128,663          | 13.53         |
| 國外委託經營          | 1,058,396,939,363        | 42.77         |
| 固定收益            | 268,352,223,595          | 10.84         |
| 權益證券            | 542,720,164,112          | 21.93         |
| 另類投資            | 247,324,551,656          | 10.00         |
| <b>合 計</b>      | <b>2,474,719,934,877</b> | <b>100.00</b> |

## 2. 舊制勞工退休基金

截至 109 年 1 月底

單位：新台幣元

| 項 目               | 餘 額                    | 占基金運用比例(%)    |
|-------------------|------------------------|---------------|
| <b>自行運用</b>       | <b>465,184,119,866</b> | <b>49.09</b>  |
| 轉存金融機構            | 159,543,348,410        | 16.84         |
| 短期票券              | 41,865,918,231         | 4.42          |
| 公債、金融債券、公司債及證券化商品 | 62,591,098,597         | 6.60          |
| 股票及受益憑證投資(含期貨)    | 83,099,700,892         | 8.77          |
| 國外投資              | 118,084,053,736        | 12.46         |
| 固定收益              | 58,802,241,455         | 6.21          |
| 權益證券              | 41,446,944,272         | 4.37          |
| 另類投資              | 17,834,868,009         | 1.88          |
| <b>委託經營</b>       | <b>482,398,339,270</b> | <b>50.91</b>  |
| 國內委託經營            | 114,009,141,643        | 12.03         |
| 國外委託經營            | 368,389,197,627        | 38.88         |
| 固定收益              | 106,305,607,830        | 11.22         |
| 權益證券              | 187,500,463,224        | 19.79         |
| 另類投資              | 74,583,126,573         | 7.87          |
| <b>合 計</b>        | <b>947,582,459,136</b> | <b>100.00</b> |

### (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 109 年 1 月底

單位：新台幣元

| 項 目     | 金 額               | 占基金運用比例(%) |
|---------|-------------------|------------|
| 自 行 運 用 | 1,081,468,866,851 | 43.70      |
| 委 託 經 營 | 1,393,251,068,026 | 56.30      |

#### 2. 舊制勞工退休基金

截至 109 年 1 月底

單位：新台幣元

| 項 目     | 金 額             | 占基金運用比例(%) |
|---------|-----------------|------------|
| 自 行 運 用 | 465,184,119,866 | 49.09      |
| 委 託 經 營 | 482,398,339,270 | 50.91      |

#### (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 109 年 1 月底

單位：新台幣元

| 項 目     | 金 額               | 占基金運用比例(%) |
|---------|-------------------|------------|
| 國 內 投 資 | 1,195,386,311,651 | 48.30      |
| 國 外 投 資 | 1,279,333,623,226 | 51.70      |

##### 2. 舊制勞工退休基金

截至 109 年 1 月底

單位：新台幣元

| 項 目     | 金 額             | 占基金運用比例(%) |
|---------|-----------------|------------|
| 國 內 投 資 | 461,109,207,773 | 48.66      |
| 國 外 投 資 | 486,473,251,363 | 51.34      |

#### 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 109 年 1 月底

| 項 目    | 收益率(%) |
|--------|--------|
| 國內權益證券 | -4.57  |

##### 2. 舊制勞工退休基金

截至 109 年 1 月底

| 項 目    | 收益率(%) |
|--------|--------|
| 國內權益證券 | -4.88  |

## (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 109 年 1 月底 單位：新台幣元

| 項 目    | 金 額            | 比 例 (%) |
|--------|----------------|---------|
| 國內權益證券 | 98,989,083,702 | 4.00    |

### 2. 舊制勞工退休基金

截至 109 年 1 月底 單位：新台幣元

| 項 目    | 金 額            | 比 例 (%) |
|--------|----------------|---------|
| 國內權益證券 | 83,099,700,892 | 8.77    |

## 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：新台幣元

| 投信<br>名稱 | 委託金額           | 目前淨資產          | 109 年截至 1 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(108.9.27~109.1.31) |            |                 |
|----------|----------------|----------------|--------------------------|-----------------------------|------------|-----------------|
|          |                |                |                          | 投資<br>報酬率(%)                | 委託經<br>營排名 | 大盤/目標<br>報酬率(%) |
| 野村       | 18,580,874,211 | 19,588,604,018 | -3.48                    | 5.42                        | —          | 5.73/2.22       |

### 97 年第一次委託經營(續約 4)

單位：新台幣元

| 投信<br>名稱 | 委託金額          | 目前淨資產         | 109 年截至 1 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(109.1.20~109.1.31) |            |                 |
|----------|---------------|---------------|--------------------------|-----------------------------|------------|-----------------|
|          |               |               |                          | 投資<br>報酬率(%)                | 委託經<br>營排名 | 大盤/目標<br>報酬率(%) |
| 野村       | 9,193,179,186 | 8,893,172,507 | -3.26                    | -3.26                       | —          | -4.92/0.20      |

### 98 年第一次委託經營(續約 3)

單位：新台幣元

| 投信<br>名稱 | 委託金額           | 目前淨資產          | 109 年截至 1 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(107.7.16~109.1.31) |            |                 |
|----------|----------------|----------------|--------------------------|-----------------------------|------------|-----------------|
|          |                |                |                          | 投資<br>報酬率(%)                | 委託經<br>營排名 | 大盤/目標<br>報酬率(%) |
| 野村       | 12,940,861,671 | 14,380,164,154 | -3.55                    | 11.12                       | 1          | 5.80/9.77       |
| 保德信      | 5,153,416,157  | 5,468,670,530  | -2.24                    | 6.12                        | 2          |                 |
| 合計       | 18,094,277,828 | 19,848,834,684 | -3.19                    | 9.70                        | —          |                 |

### 99 年第二次委託經營(續約 2)

單位：新台幣元

| 投信<br>名稱 | 委託金額          | 目前淨資產         | 109 年截至 1 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(107.12.3~109.1.31) |            |                 |
|----------|---------------|---------------|--------------------------|-----------------------------|------------|-----------------|
|          |               |               |                          | 投資<br>報酬率(%)                | 委託經<br>營排名 | 大盤/目標<br>報酬率(%) |
| 國泰       | 6,441,043,825 | 6,730,722,689 | -1.29                    | 2.66                        | —          | 16.25/7.43      |

### 100 年第一次委託經營(續約 2)(相對報酬)

單位：新台幣元

| 投信<br>名稱 | 委託金額           | 目前淨資產          | 109 年截至 1 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(108.7.15~109.1.31) |            |                 |
|----------|----------------|----------------|--------------------------|-----------------------------|------------|-----------------|
|          |                |                |                          | 投資<br>報酬率(%)                | 委託經<br>營排名 | 大盤/指標<br>報酬率(%) |
| 復華       | 19,495,508,988 | 20,791,695,469 | -4.23                    | 6.65                        | —          | 6.20/7.32       |

註：本次委託為相對報酬委託經營，以就業 99 指數為指定指標。

## 100 年第二次委託經營(續約 2)

單位：新台幣元

| 投信<br>名稱 | 委託金額           | 目前淨資產          | 109 年截至 1 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(108.8.12~109.1.31) |            |                 |
|----------|----------------|----------------|--------------------------|-----------------------------|------------|-----------------|
|          |                |                |                          | 投資<br>報酬率(%)                | 委託經<br>營排名 | 大盤/目標<br>報酬率(%) |
| 復華       | 21,522,022,333 | 22,755,960,625 | -3.28                    | 5.73                        | —          | 9.53/3.03       |

## 101 年第一次委託經營(續約)(相對報酬)

單位：新台幣元

| 投信<br>名稱 | 委託金額           | 目前淨資產          | 109 年截至 1 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(105.4.18~109.1.31) |            |                 |
|----------|----------------|----------------|--------------------------|-----------------------------|------------|-----------------|
|          |                |                |                          | 投資<br>報酬率(%)                | 委託經<br>營排名 | 大盤/指標<br>報酬率(%) |
| 國泰       | 5,387,135,656  | 8,575,679,394  | -3.49                    | 59.19                       | 1          | 32.12/55.66     |
| 滙豐中華     | 10,927,481,593 | 16,755,677,645 | -3.56                    | 53.34                       | 2          |                 |
| 合計       | 16,314,617,249 | 25,331,357,039 | -3.54                    | 55.27                       | —          |                 |

註：本次委託為相對報酬委託經營，以加權股價報酬指數為指定指標。

## 101 年第二次委託經營(續約)

單位：新台幣元

| 投信<br>名稱 | 委託金額           | 目前淨資產          | 109 年截至 1 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(105.7.18~109.1.31) |            |                 |
|----------|----------------|----------------|--------------------------|-----------------------------|------------|-----------------|
|          |                |                |                          | 投資<br>報酬率(%)                | 委託經<br>營排名 | 大盤/目標<br>報酬率(%) |
| 野村       | 6,850,998,495  | 9,398,031,315  | -3.53                    | 37.18                       | 2          | 28.44/21.67     |
| 統一       | 8,019,680,328  | 11,046,486,500 | -3.22                    | 42.35                       | 1          |                 |
| 合計       | 14,870,678,823 | 20,444,517,815 | -3.36                    | 39.58                       | —          |                 |

## 102 年第一次委託經營(續約)

單位：新台幣元

| 投信<br>名稱 | 委託金額           | 目前淨資產          | 109 年截至 1 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(106.6.7~109.1.31) |            |                 |
|----------|----------------|----------------|--------------------------|----------------------------|------------|-----------------|
|          |                |                |                          | 投資<br>報酬率(%)               | 委託經<br>營排名 | 大盤/目標<br>報酬率(%) |
| 統一       | 4,126,252,099  | 5,628,173,390  | -4.55                    | 45.69                      | 1          | 12.63/16.44     |
| 復華       | 6,481,866,342  | 8,187,004,509  | -4.47                    | 26.31                      | 2          |                 |
| 合計       | 10,608,118,441 | 13,815,177,899 | -4.50                    | 32.91                      | —          |                 |

## 102 年第二次委託經營(續約) (相對報酬)

單位：新台幣元

| 投信<br>名稱 | 委託金額           | 目前淨資產          | 109 年截至 1 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(107.1.22~109.1.31) |            |                 |
|----------|----------------|----------------|--------------------------|-----------------------------|------------|-----------------|
|          |                |                |                          | 投資<br>報酬率(%)                | 委託經<br>營排名 | 大盤/指標<br>報酬率(%) |
| 統一       | 7,009,597,591  | 8,747,882,717  | -5.29                    | 24.80                       | 1          | 3.09/12.21      |
| 復華       | 10,038,542,112 | 11,082,178,329 | -4.58                    | 11.50                       | 3          |                 |
| 群益       | 6,918,664,544  | 8,130,954,531  | -4.73                    | 17.52                       | 2          |                 |
| 滙豐中華     | 5,006,530,255  | 5,426,934,189  | -3.84                    | 9.86                        | 4          |                 |
| 合計       | 28,973,334,502 | 33,387,949,766 | -4.68                    | 15.09                       | —          |                 |

註：本次委託為相對報酬委託經營，以加權股價報酬指數為指定指標。

## 103 年第一次委託經營第一期(續約)

單位：新台幣元

| 投信<br>名稱 | 委託金額           | 目前淨資產          | 109 年截至 1 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(107.8.13~109.1.31) |            |                 |
|----------|----------------|----------------|--------------------------|-----------------------------|------------|-----------------|
|          |                |                |                          | 投資<br>報酬率(%)                | 委託經<br>營排名 | 大盤/目標<br>報酬率(%) |
| 統一       | 9,046,774,993  | 10,067,247,788 | -4.95                    | 11.28                       | 1          | 4.66/9.30       |
| 復華       | 8,967,102,893  | 9,327,425,931  | -4.52                    | 4.02                        | 2          |                 |
| 合計       | 18,013,877,886 | 19,394,673,719 | -4.75                    | 7.67                        | —          |                 |

## 103 年第一次委託經營第二期(續約)

單位：新台幣元

| 投信<br>名稱 | 委託金額           | 目前淨資產          | 109 年截至 1 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(107.10.8~109.1.31) |            |                 |
|----------|----------------|----------------|--------------------------|-----------------------------|------------|-----------------|
|          |                |                |                          | 投資<br>報酬率(%)                | 委託經<br>營排名 | 大盤/目標<br>報酬率(%) |
| 台新       | 7,934,673,726  | 9,389,051,278  | -2.28                    | 18.33                       | 1          | 9.30/8.37       |
| 群益       | 8,622,603,994  | 9,700,608,222  | -3.94                    | 12.50                       | 2          |                 |
| 合計       | 16,557,277,720 | 19,089,659,500 | -3.13                    | 15.29                       | —          |                 |

### 103 年第二次委託經營(相對報酬)

單位：新台幣元

| 投信<br>名稱 | 委託金額           | 目前淨資產          | 109 年截至 1 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(106.12.1~109.1.31) |            |                 |
|----------|----------------|----------------|--------------------------|-----------------------------|------------|-----------------|
|          |                |                |                          | 投資<br>報酬率(%)                | 委託經<br>營排名 | 大盤/指標<br>報酬率(%) |
| 國泰       | 6,000,000,000  | 6,752,423,418  | -4.47                    | 15.80                       | 1          | 8.85/17.29      |
| 統一       | 6,000,000,000  | 6,721,577,313  | -3.93                    | 15.08                       | 2          |                 |
| 復華       | 6,000,000,000  | 6,672,195,137  | -4.21                    | 13.69                       | 5          |                 |
| 滙豐中華     | 6,000,000,000  | 6,682,486,826  | -4.14                    | 13.72                       | 4          |                 |
| 安聯       | 6,000,000,000  | 6,700,464,546  | -4.12                    | 13.81                       | 3          |                 |
| 合計       | 30,000,000,000 | 33,529,147,240 | -4.17                    | 14.42                       | —          |                 |

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

### 104 年第一次委託經營（續約）

單位：新台幣元

| 投信<br>名稱 | 委託金額           | 目前淨資產          | 109 年截至 1 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(108.4.1~109.1.31) |            |                 |
|----------|----------------|----------------|--------------------------|----------------------------|------------|-----------------|
|          |                |                |                          | 投資<br>報酬率(%)               | 委託經<br>營排名 | 大盤/目標<br>報酬率(%) |
| 統一       | 8,286,046,084  | 9,036,863,353  | -4.58                    | 9.06                       | 3          | 8.03/5.37       |
| 復華       | 3,651,168,229  | 4,210,381,341  | -3.32                    | 15.32                      | 1          |                 |
| 安聯       | 2,973,766,298  | 3,249,199,097  | -3.21                    | 9.26                       | 2          |                 |
| 合計       | 14,910,980,611 | 16,496,443,791 | -3.99                    | 10.63                      | —          |                 |

### 106 年第一次委託經營

單位：新台幣元

| 投信<br>名稱 | 委託金額           | 目前淨資產          | 109 年截至 1 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(107.2.7~109.1.31) |            |                 |
|----------|----------------|----------------|--------------------------|----------------------------|------------|-----------------|
|          |                |                |                          | 投資<br>報酬率(%)               | 委託經<br>營排名 | 大盤/目標<br>報酬率(%) |
| 台新       | 5,000,000,000  | 5,183,047,156  | -2.66                    | -1.83                      | 7          | 10.49/12.10     |
| 安聯       | 5,000,000,000  | 6,149,971,855  | -3.35                    | 25.86                      | 1          |                 |
| 保德信      | 5,000,000,000  | 5,577,422,578  | -2.81                    | 10.47                      | 4          |                 |
| 國泰       | 5,000,000,000  | 5,056,123,165  | -0.46                    | -0.98                      | 6          |                 |
| 復華       | 5,000,000,000  | 5,819,144,240  | -5.43                    | 16.43                      | 2          |                 |
| 群益       | 5,000,000,000  | 5,260,123,773  | -3.70                    | 5.15                       | 5          |                 |
| 滙豐中華     | 5,000,000,000  | 5,625,971,199  | -2.52                    | 13.72                      | 3          |                 |
| 合計       | 35,000,000,000 | 38,671,803,966 | -3.06                    | 9.77                       | —          |                 |

## 107 年第一次委託經營(相對報酬)

單位：新台幣元

| 投信<br>名稱 | 委託金額           | 目前淨資產          | 109 年截至 1 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(107.10.24~109.1.31) |            |                 |
|----------|----------------|----------------|--------------------------|------------------------------|------------|-----------------|
|          |                |                |                          | 投資<br>報酬率(%)                 | 委託經<br>營排名 | 大盤/指標<br>報酬率(%) |
| 台新       | 2,000,000,000  | 2,565,032,085  | -3.95                    | 28.25                        | 1          | 17.59/23.00     |
| 安聯       | 2,000,000,000  | 2,538,308,030  | -4.05                    | 26.92                        | 2          |                 |
| 保德信      | 2,000,000,000  | 2,474,720,529  | -3.93                    | 23.74                        | 6          |                 |
| 統一       | 2,000,000,000  | 2,469,081,840  | -4.23                    | 23.45                        | 7          |                 |
| 國泰       | 2,000,000,000  | 2,495,106,684  | -3.83                    | 24.76                        | 4          |                 |
| 復華       | 2,000,000,000  | 2,497,469,976  | -4.03                    | 24.87                        | 3          |                 |
| 群益       | 2,000,000,000  | 2,493,177,722  | -4.00                    | 24.66                        | 5          |                 |
| 合計       | 14,000,000,000 | 17,532,896,866 | -4.00                    | 25.23                        | —          |                 |

註：本批次委託為相對報酬委託經營，以臺灣永續報酬指數為指定指標。

## 107 年第二次委託經營

單位：新台幣元

| 投信<br>名稱 | 委託金額           | 目前淨資產          | 109 年截至 1 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(108.5.24~109.1.31) |            |                 |
|----------|----------------|----------------|--------------------------|-----------------------------|------------|-----------------|
|          |                |                |                          | 投資<br>報酬率(%)                | 委託經<br>營排名 | 大盤/目標<br>報酬率(%) |
| 安聯       | 3,000,000,000  | 3,308,908,137  | -3.03                    | 10.30                       | 3          | 11.51/4.33      |
| 施羅德      | 3,000,000,000  | 3,246,870,727  | -3.51                    | 8.23                        | 6          |                 |
| 統一       | 3,000,000,000  | 3,293,245,928  | -4.55                    | 9.77                        | 4          |                 |
| 野村       | 3,000,000,000  | 3,492,734,237  | -3.22                    | 16.42                       | 1          |                 |
| 國泰       | 3,000,000,000  | 3,166,345,257  | -4.16                    | 5.54                        | 7          |                 |
| 復華       | 3,000,000,000  | 3,417,823,242  | -2.04                    | 13.93                       | 2          |                 |
| 群益       | 3,000,000,000  | 3,269,155,183  | -4.05                    | 8.97                        | 5          |                 |
| 合計       | 21,000,000,000 | 23,195,082,711 | -3.50                    | 10.45                       | —          |                 |

## 2. 舊制勞工退休基金

### 國內 98 年第二次委託經營(續約 3)

單位：新台幣元

| 投信名稱 | 委託金額           | 目前淨資產          | 109 年截至 1 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(108.1.28~109.1.31) |            |                 |
|------|----------------|----------------|--------------------------|-----------------------------|------------|-----------------|
|      |                |                |                          | 投資<br>報酬率(%)                | 委託經<br>營排名 | 大盤/目標<br>報酬率(%) |
| 富邦   | 5,957,934,152  | 6,567,151,870  | -3.83                    | 10.23                       | 2          | 15.30/6.48      |
| 統一   | 6,491,384,983  | 7,322,356,489  | -3.44                    | 12.80                       | 1          |                 |
| 合計   | 12,449,319,135 | 13,889,508,359 | -3.62                    | 11.57                       | —          |                 |

### 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         | 109 年截至 1 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(105.10.31~109.1.31) |            |                 |
|------|---------------|---------------|--------------------------|------------------------------|------------|-----------------|
|      |               |               |                          | 投資<br>報酬率(%)                 | 委託經<br>營排名 | 大盤/指標<br>報酬率(%) |
| 匯豐中華 | 5,684,367,652 | 7,766,405,035 | -3.58                    | 36.63                        | —          | 23.51/39.72     |

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          | 109 年截至 1 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(105.05.03~109.1.31) |            |                 |
|------|----------------|----------------|--------------------------|------------------------------|------------|-----------------|
|      |                |                |                          | 投資<br>報酬率(%)                 | 委託經<br>營排名 | 大盤/目標<br>報酬率(%) |
| 野村   | 16,650,814,154 | 25,571,104,649 | -3.30                    | 53.57                        | —          | 37.21/22.89     |

### 國內 102 年第一次委託經營(續約)

單位：新台幣元

| 投信名稱 | 委託金額           | 目前淨資產          | 109 年截至 1 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(106.6.7~109.1.31) |            |                 |
|------|----------------|----------------|--------------------------|----------------------------|------------|-----------------|
|      |                |                |                          | 投資<br>報酬率(%)               | 委託經<br>營排名 | 大盤/目標<br>報酬率(%) |
| 統一   | 4,126,679,953  | 5,629,116,876  | -4.54                    | 45.70                      | 1          | 12.63/16.44     |
| 復華   | 12,007,032,629 | 15,183,858,743 | -4.47                    | 26.46                      | 2          |                 |
| 合計   | 16,133,712,582 | 20,812,975,619 | -4.49                    | 30.66                      | —          |                 |

### 國內 104 年第一次委託經營(續約)

單位：新台幣元

| 投信名稱 | 委託金額           | 目前淨資產          | 109 年截至 1 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(108.4.1~109.1.31) |            |                 |
|------|----------------|----------------|--------------------------|----------------------------|------------|-----------------|
|      |                |                |                          | 投資<br>報酬率(%)               | 委託經<br>營排名 | 大盤/目標<br>報酬率(%) |
| 統一   | 8,286,785,149  | 9,037,901,839  | -4.58                    | 9.06                       | 3          | 8.03/5.37       |
| 復華   | 3,651,419,951  | 4,210,762,380  | -3.32                    | 15.32                      | 1          |                 |
| 安聯   | 2,974,008,140  | 3,249,537,890  | -3.21                    | 9.26                       | 2          |                 |
| 合計   | 14,912,213,240 | 16,498,202,109 | -3.99                    | 10.64                      | —          |                 |

### 國內 106 年第一次委託經營

單位：新台幣元

| 投信名稱 | 委託金額           | 目前淨資產          | 109 年截至 1 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(107.2.7~109.1.31) |            |                 |
|------|----------------|----------------|--------------------------|----------------------------|------------|-----------------|
|      |                |                |                          | 投資<br>報酬率(%)               | 委託經<br>營排名 | 大盤/目標<br>報酬率(%) |
| 台新   | 5,000,000,000  | 5,183,231,819  | -2.66                    | -1.82                      | 7          | 10.49/12.10     |
| 安聯   | 5,000,000,000  | 6,150,304,288  | -3.35                    | 25.87                      | 1          |                 |
| 保德信  | 5,000,000,000  | 5,577,679,299  | -2.81                    | 10.47                      | 4          |                 |
| 國泰   | 5,000,000,000  | 5,056,303,130  | -0.46                    | -0.97                      | 6          |                 |
| 復華   | 5,000,000,000  | 5,819,412,799  | -5.43                    | 16.44                      | 2          |                 |
| 群益   | 5,000,000,000  | 5,260,503,491  | -3.70                    | 5.16                       | 5          |                 |
| 匯豐中華 | 5,000,000,000  | 5,626,349,139  | -2.52                    | 13.73                      | 3          |                 |
| 合計   | 35,000,000,000 | 38,673,783,965 | -3.06                    | 9.77                       | —          |                 |

## (二) 109 年 1 月被提前收回之國內委外投資帳戶

### 1. 基金國內委外投資被提前收回帳戶經理人名單及收回原因

新制勞工退休基金：無

舊制勞工退休基金：無

### 2. 受託機構經管本基金帳戶被主管機關懲處之相關資訊

新制勞工退休基金：無

舊制勞工退休基金：無

## 五、基金國外委外投資概況表

### (一) 基金國外委外投資績效、績效指標及排名表

#### 1. 新制勞工退休基金

##### 97-1 全球主動債券型（續約 2）

單位：美元

| 受託機構        | 委託金額          | 目前淨資產         | 109 年截至 1 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(105.6.6~109.1.31) |    |              |
|-------------|---------------|---------------|--------------------------|----------------------------|----|--------------|
|             |               |               |                          | 投資<br>報酬率(%)               | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| 聯博          | 793,101,125   | 859,039,866   | 1.56                     | 8.31                       | 2  | 8.85         |
| 富蘭克林<br>坦伯頓 | 744,405,663   | 812,050,713   | 1.15                     | 9.09                       | 1  |              |
| 合計          | 1,537,506,788 | 1,671,090,579 | 1.36                     | 8.69                       | —  |              |

##### 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         | 109 年截至 1 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(106.1.6~109.1.31) |    |              |
|-------|---------------|---------------|--------------------------|----------------------------|----|--------------|
|       |               |               |                          | 投資<br>報酬率(%)               | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| PIMCO | 1,219,586,290 | 1,373,308,301 | 1.09                     | 15.46                      | —  | 14.29        |

## 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         | 109 年截至 1 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(106.2.6~109.1.31) |    |              |
|------|---------------|---------------|--------------------------|----------------------------|----|--------------|
|      |               |               |                          | 投資<br>報酬率(%)               | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| 貝萊德  | 967,348,593   | 1,334,367,826 | -0.85                    | 37.94                      | 1  | 35.79        |
| 摩根   | 802,177,668   | 1,094,145,450 | -1.20                    | 36.40                      | 2  |              |
| 合計   | 1,769,526,261 | 2,428,513,276 | -1.00                    | 37.24                      | —  |              |

## 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       | 109 年截至 1 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(106.11.17~109.1.31) |    |              |
|------|-------------|-------------|--------------------------|------------------------------|----|--------------|
|      |             |             |                          | 投資<br>報酬率(%)                 | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| 景順   | 602,621,073 | 581,048,743 | -5.07                    | -0.16                        | —  | 1.35         |

## 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         | 109 年截至 1 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(106.12.4~109.1.31) |    |              |
|------|---------------|---------------|--------------------------|-----------------------------|----|--------------|
|      |               |               |                          | 投資<br>報酬率(%)                | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| 貝萊德  | 535,489,288   | 622,852,824   | -1.17                    | 16.31                       | 2  | 15.69        |
| 道富   | 728,826,441   | 849,677,247   | -1.20                    | 16.58                       | 1  |              |
| 合計   | 1,264,315,729 | 1,472,530,071 | -1.19                    | 16.47                       | —  |              |

## 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       | 109 年截至 1 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(107.8.27~109.1.31) |    |              |
|------|-------------|-------------|--------------------------|-----------------------------|----|--------------|
|      |             |             |                          | 投資<br>報酬率(%)                | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| 瑞萬通博 | 757,229,489 | 805,850,258 | -3.25                    | 6.42                        | —  | 3.68         |

### 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         | 109 年截至 1 月<br>累積投資報酬率(%) | 委任迄今<br>(105.7.1~109.1.31) |    |              |
|------|---------------|---------------|---------------------------|----------------------------|----|--------------|
|      |               |               |                           | 投資<br>報酬率(%)               | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| 道富   | 662,180,574   | 906,752,076   | -2.93                     | 42.29                      | 1  | 41.05        |
| 貝萊德  | 666,301,910   | 909,502,492   | -3.08                     | 41.81                      | 2  |              |
| 合計   | 1,328,482,484 | 1,816,254,568 | -3.00                     | 42.05                      | —  |              |

### 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         | 109 年截至 1 月<br>累積投資報酬率(%) | 委任迄今<br>(106.3.6~109.1.31) |    |              |
|----------------|---------------|---------------|---------------------------|----------------------------|----|--------------|
|                |               |               |                           | 投資<br>報酬率(%)               | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| Cohen & Steers | 1,251,936,411 | 1,627,012,913 | 0.04                      | 35.68                      | 1  | 26.55        |
| 景順             | 1,084,104,927 | 1,369,204,956 | -0.12                     | 28.39                      | 2  |              |
| 合計             | 2,336,041,338 | 2,996,217,869 | -0.03                     | 32.13                      | —  |              |

### 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         | 109 年截至 1 月<br>累積投資報酬率(%) | 委任迄今<br>(106.7.31~109.1.31) |    |              |
|---------|-------------|---------------|---------------------------|-----------------------------|----|--------------|
|         |             |               |                           | 投資<br>報酬率(%)                | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| Ashmore | 454,453,121 | 503,861,557   | 0.59                      | 10.87                       | 2  | 14.93        |
| Pictet  | 454,291,634 | 521,224,114   | 0.88                      | 14.73                       | 1  |              |
| 合計      | 908,744,755 | 1,025,085,671 | 0.74                      | 12.80                       | —  |              |

# 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         | 109 年截至 1 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(107.4.18~109.1.31) |    |              |
|------|---------------|---------------|--------------------------|-----------------------------|----|--------------|
|      |               |               |                          | 投資<br>報酬率(%)                | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| 道富   | 798,231,848   | 880,582,700   | -0.74                    | 10.47                       | 2  | 10.11        |
| 貝萊德  | 794,293,722   | 876,546,839   | -0.74                    | 10.50                       | 1  |              |
| 合計   | 1,592,525,570 | 1,757,129,539 | -0.74                    | 10.48                       | —  |              |

# 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         | 109 年截至 1 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(108.1.22~109.1.31) |    |              |
|------|---------------|---------------|--------------------------|-----------------------------|----|--------------|
|      |               |               |                          | 投資<br>報酬率(%)                | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| 瑞萬通博 | 756,315,337   | 938,132,565   | 0.43                     | 24.04                       | 1  | 14.98        |
| MFS  | 603,318,800   | 675,534,362   | -3.00                    | 11.97                       | 3  |              |
| 威靈頓  | 631,647,315   | 752,628,228   | -1.74                    | 19.15                       | 2  |              |
| 合計   | 1,991,281,452 | 2,366,295,155 | -1.26                    | 18.83                       | —  |              |

# 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         | 109 年截至 1 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(108.4.25~109.1.31) |    |              |
|---------|---------------|---------------|--------------------------|-----------------------------|----|--------------|
|         |               |               |                          | 投資<br>報酬率(%)                | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| Bluebay | 586,338,464   | 631,565,720   | 1.61                     | 9.14                        | 1  | 8.10         |
| 貝萊德     | 587,231,657   | 629,667,351   | 1.57                     | 8.68                        | 2  |              |
| 盧米斯     | 592,703,100   | 633,684,021   | 1.43                     | 8.31                        | 3  |              |
| 合計      | 1,766,273,221 | 1,894,917,092 | 1.54                     | 8.71                        | —  |              |

### 104-1 全球高品質被動股票型

單位：美元

| 受託機構  | 委託金額          | 目前淨資產         | 109 年截至 1 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(104.8.11~109.1.31) |    |              |
|-------|---------------|---------------|--------------------------|-----------------------------|----|--------------|
|       |               |               |                          | 投資<br>報酬率(%)                | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| 北美信託  | 650,000,000   | 1,096,723,724 | 0.11                     | 67.06                       | 1  | 66.42        |
| LGIM  | 650,000,000   | 1,095,956,620 | 0.14                     | 66.67                       | 3  |              |
| Geode | 650,000,000   | 1,095,558,457 | 0.15                     | 66.68                       | 2  |              |
| 合計    | 1,950,000,000 | 3,288,238,801 | 0.14                     | 66.80                       | —  |              |

### 104-2 全球基礎建設有價證券型

單位：美元

| 受託機構           | 委託金額          | 目前淨資產         | 109 年截至 1 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(104.9.25~109.1.31) |    |              |
|----------------|---------------|---------------|--------------------------|-----------------------------|----|--------------|
|                |               |               |                          | 投資<br>報酬率(%)                | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| Cohen & Steers | 300,000,000   | 449,476,733   | 1.50                     | 43.41                       | 4  | 51.97        |
| 麥格理            | 500,000,000   | 690,263,008   | 1.39                     | 47.54                       | 3  |              |
| Magellan       | 900,000,000   | 1,206,886,322 | 1.45                     | 64.61                       | 1  |              |
| RREEF          | 500,000,000   | 704,181,701   | 2.31                     | 55.23                       | 2  |              |
| 合計             | 2,200,000,000 | 3,050,807,764 | 1.64                     | 52.84                       | —  |              |

### 104-1 全球主權信用增值債券型

單位：美元

| 受託機構       | 委託金額          | 目前淨資產         | 109 年截至 1 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(104.11.13~109.1.31) |    |              |
|------------|---------------|---------------|--------------------------|------------------------------|----|--------------|
|            |               |               |                          | 投資<br>報酬率(%)                 | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| NNIP       | 150,000,000   | 164,924,275   | 0.21                     | 13.13                        | 3  | 22.87        |
| Brandywine | 550,000,000   | 607,103,022   | -0.71                    | 21.87                        | 1  |              |
| 盧米斯        | 300,000,000   | 351,678,458   | 0.11                     | 20.47                        | 2  |              |
| 合計         | 1,000,000,000 | 1,123,705,755 | -0.33                    | 18.42                        | —  |              |

## 105-1 全球多元資產型

單位：美元

| 受託機構    | 委託金額          | 目前淨資產         | 109 年截至 1 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(105.7.20~109.1.31) |    |                 |
|---------|---------------|---------------|--------------------------|-----------------------------|----|-----------------|
|         |               |               |                          | 投資<br>報酬率(%)                | 排名 | 指標/目標<br>報酬率(%) |
| Allianz | 370,000,000   | 401,406,543   | 0.33                     | 8.25                        | 4  | 6.60/24.28      |
| 摩根      | 1,100,000,000 | 1,305,751,892 | 0.52                     | 30.91                       | 1  |                 |
| DWS     | 600,000,000   | 698,898,642   | -0.18                    | 20.10                       | 2  |                 |
| 柏瑞      | 600,000,000   | 688,409,214   | -1.61                    | 16.87                       | 3  |                 |
| 合計      | 2,670,000,000 | 3,094,466,291 | -0.14                    | 19.90                       | —  |                 |

註：本批次為絕對報酬型。

## 105-1 亞太混合指數增值股票型

單位：美元

| 受託機構 | 委託金額          | 目前淨資產         | 109 年截至 1 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(105.8.24~109.1.31) |    |              |
|------|---------------|---------------|--------------------------|-----------------------------|----|--------------|
|      |               |               |                          | 投資<br>報酬率(%)                | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| 貝萊德  | 500,000,000   | 610,073,873   | -3.09                    | 24.08                       | 1  | 26.84        |
| 北美信託 | 300,000,000   | 358,918,575   | -3.81                    | 12.74                       | 3  |              |
| 領航   | 450,000,000   | 519,630,532   | -3.66                    | 18.00                       | 2  |              |
| 合計   | 1,250,000,000 | 1,488,622,980 | -3.47                    | 18.34                       | —  |              |

## 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         | 109 年截至 1 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(106.6.22~109.1.31) |    |              |
|------|---------------|---------------|--------------------------|-----------------------------|----|--------------|
|      |               |               |                          | 投資<br>報酬率(%)                | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| 貝萊德  | 300,000,000   | 363,131,914   | -0.56                    | 29.35                       | 4  | 29.17        |
| DWS  | 350,000,000   | 419,843,572   | -0.46                    | 29.48                       | 2  |              |
| 道富   | 350,000,000   | 419,552,457   | -0.48                    | 29.42                       | 3  |              |
| 北美信託 | 350,000,000   | 419,989,042   | -0.56                    | 29.52                       | 1  |              |
| 合計   | 1,350,000,000 | 1,622,516,985 | -0.52                    | 29.44                       | —  |              |

## 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         | 109 年截至 1 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(106.7.25~109.1.31) |    |                 |
|------------------|---------------|---------------|--------------------------|-----------------------------|----|-----------------|
|                  |               |               |                          | 投資<br>報酬率(%)                | 排名 | 指標/目標<br>報酬率(%) |
| American Century | 400,000,000   | 423,219,026   | 0.52                     | 5.95                        | 4  | 4.63/10.93      |
| 富達               | 550,000,000   | 607,865,813   | 0.44                     | 12.83                       | 1  |                 |
| 富蘭克林<br>坦伯頓      | 400,000,000   | 423,071,384   | 0.69                     | 6.36                        | 3  |                 |
| TCW              | 550,000,000   | 590,477,551   | 0.72                     | 10.34                       | 2  |                 |
| 合計               | 1,900,000,000 | 2,044,633,774 | 0.59                     | 8.92                        | —  |                 |

註：本批次為絕對報酬型。

## 107-1 絕對報酬股票型

單位：美元

| 受託機構   | 委託金額          | 目前淨資產         | 109 年截至 1 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(108.1.23~109.1.31) |    |                 |
|--------|---------------|---------------|--------------------------|-----------------------------|----|-----------------|
|        |               |               |                          | 投資<br>報酬率(%)                | 排名 | 指標/目標<br>報酬率(%) |
| Nomura | 400,000,000   | 392,569,638   | -1.77                    | -3.19                       | 5  | 2.32/7.44       |
| 景順     | 400,000,000   | 414,786,586   | -1.72                    | 7.29                        | 3  |                 |
| 威靈頓    | 400,000,000   | 437,892,375   | -0.43                    | 15.52                       | 1  |                 |
| CPR    | 400,000,000   | 415,694,402   | -1.55                    | 6.38                        | 4  |                 |
| 道富     | 400,000,000   | 434,954,498   | -0.07                    | 14.58                       | 2  |                 |
| 合計     | 2,000,000,000 | 2,095,897,499 | -1.09                    | 8.08                        | —  |                 |

註：本批次為絕對報酬型。

## 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       | 109 年截至 1 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(108.12.18~109.1.31) |    |              |
|--------|-------------|-------------|--------------------------|------------------------------|----|--------------|
|        |             |             |                          | 投資<br>報酬率(%)                 | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| Amundi | 100,000,000 | 95,250,950  | -5.27                    | -4.75                        | 5  | -2.99        |
| DWS    | 100,000,000 | 95,648,331  | -4.92                    | -4.35                        | 4  |              |
| Nomura | 100,000,000 | 96,254,715  | -4.53                    | -3.75                        | 3  |              |
| 荷寶     | 100,000,000 | 96,734,308  | -4.87                    | -3.27                        | 1  |              |
| 道富     | 100,000,000 | 96,577,278  | -4.43                    | -3.42                        | 2  |              |
| 合計     | 500,000,000 | 480,465,582 | -4.80                    | -3.91                        | —  |              |

## 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       | 109 年截至 1 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(108.6.24~109.1.31) |    |              |
|------|-------------|-------------|--------------------------|-----------------------------|----|--------------|
|      |             |             |                          | 投資<br>報酬率(%)                | 排名 | 指標<br>報酬率(%) |
| 富達   | 886,579,222 | 947,258,237 | 1.29                     | 6.84                        | —  | 6.45         |

### 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         | 109 年截至 1 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(106.1.6~109.1.31) |    |              |
|-------|---------------|---------------|--------------------------|----------------------------|----|--------------|
|       |               |               |                          | 投資<br>報酬率(%)               | 排名 | 指標<br>報酬率(%) |
| PIMCO | 1,023,576,760 | 1,171,353,888 | 1.10                     | 15.65                      | 1  | 14.29        |
| 盧米斯   | 798,763,197   | 901,747,972   | 1.14                     | 14.33                      | 2  |              |
| 合計    | 1,822,339,957 | 2,073,101,860 | 1.12                     | 15.08                      | —  |              |

### 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         | 109 年截至 1 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(106.2.6~109.1.31) |    |              |
|------|-------------|---------------|--------------------------|----------------------------|----|--------------|
|      |             |               |                          | 投資<br>報酬率(%)               | 排名 | 指標<br>報酬率(%) |
| 貝萊德  | 756,337,413 | 1,043,662,453 | -0.85                    | 37.99                      | —  | 35.79        |

### 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       | 109 年截至 1 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(106.11.17~109.1.31) |    |              |
|------|-------------|-------------|--------------------------|------------------------------|----|--------------|
|      |             |             |                          | 投資<br>報酬率(%)                 | 排名 | 指標<br>報酬率(%) |
| 景順   | 307,323,526 | 295,125,262 | -5.07                    | -0.09                        | —  | 1.35         |

### 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         | 109 年截至 1 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(106.3.6~109.1.31) |    |              |
|------|---------------|---------------|--------------------------|----------------------------|----|--------------|
|      |               |               |                          | 投資<br>報酬率(%)               | 排名 | 指標<br>報酬率(%) |
| 貝萊德  | 305,588,950   | 386,430,693   | -3.11                    | 21.19                      | 4  | 20.33        |
| 道富   | 308,539,390   | 391,289,198   | -3.03                    | 21.55                      | 3  |              |
| 瑞銀   | 306,994,134   | 389,752,013   | -2.99                    | 21.61                      | 2  |              |
| 野村   | 307,549,840   | 390,765,314   | -3.08                    | 21.67                      | 1  |              |
| 合計   | 1,228,672,314 | 1,558,237,218 | -3.05                    | 21.50                      | —  |              |

### 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       | 109 年截至 1 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(107.6.13~109.1.31) |    |              |
|------|-------------|-------------|--------------------------|-----------------------------|----|--------------|
|      |             |             |                          | 投資<br>報酬率(%)                | 排名 | 指標<br>報酬率(%) |
| 貝萊德  | 671,455,711 | 740,456,235 | -0.87                    | 10.28                       | —  | 10.21        |

### 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         | 109 年截至 1 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(108.1.22~109.1.31) |    |              |
|------|---------------|---------------|--------------------------|-----------------------------|----|--------------|
|      |               |               |                          | 投資<br>報酬率(%)                | 排名 | 指標<br>報酬率(%) |
| 瑞萬通博 | 287,169,673   | 356,194,567   | 0.43                     | 24.04                       | 1  | 14.98        |
| MFS  | 246,618,331   | 276,288,443   | -3.01                    | 12.03                       | 3  |              |
| 威靈頓  | 503,548,464   | 600,228,265   | -1.74                    | 19.20                       | 2  |              |
| 合計   | 1,037,336,468 | 1,232,711,275 | -1.41                    | 18.83                       | —  |              |

### 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       | 109 年截至 1 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(108.5.29~109.1.31) |    |              |
|--------|-------------|-------------|--------------------------|-----------------------------|----|--------------|
|        |             |             |                          | 投資<br>報酬率(%)                | 排名 | 指標<br>報酬率(%) |
| Lazard | 713,987,040 | 803,461,766 | 2.71                     | 13.39                       | —  | 12.16        |

### 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       | 109 年截至 1 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(108.8.27~109.1.31) |    |              |
|----------|-------------|-------------|--------------------------|-----------------------------|----|--------------|
|          |             |             |                          | 投資<br>報酬率(%)                | 排名 | 指標<br>報酬率(%) |
| 信安<br>環球 | 510,886,182 | 544,070,764 | 1.84                     | 6.95                        | 2  | 6.02         |
| AMP      | 126,937,100 | 136,601,847 | 2.34                     | 7.61                        | 1  |              |
| 合計       | 637,823,282 | 680,672,611 | 1.94                     | 7.06                        | —  |              |

## 105-1 全球多元資產型

單位：美元

| 受託機構 | 委託金額          | 目前淨資產         | 109 年截至 1 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(105.7.20~109.1.31) |    |                 |
|------|---------------|---------------|--------------------------|-----------------------------|----|-----------------|
|      |               |               |                          | 投資<br>報酬率(%)                | 排名 | 指標/目標<br>報酬率(%) |
| 安聯   | 120,000,000   | 130,369,338   | 0.33                     | 8.30                        | 4  | 6.60/24.28      |
| 摩根   | 450,000,000   | 521,026,958   | 0.50                     | 31.38                       | 1  |                 |
| DWS  | 250,000,000   | 282,476,020   | -0.18                    | 19.99                       | 2  |                 |
| 柏瑞   | 200,000,000   | 229,059,894   | -1.62                    | 17.05                       | 3  |                 |
| 合計   | 1,020,000,000 | 1,162,932,210 | -0.11                    | 19.72                       | —  |                 |

註：本批次為絕對報酬型。

## 106-1 全球 ESG 混合指數被動股票型

單位：美元

| 受託機構 | 委託金額        | 目前淨資產       | 109 年截至 1 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(106.6.22~109.1.31) |    |              |
|------|-------------|-------------|--------------------------|-----------------------------|----|--------------|
|      |             |             |                          | 投資<br>報酬率(%)                | 排名 | 指標<br>報酬率(%) |
| 貝萊德  | 150,000,000 | 183,128,278 | -0.57                    | 29.04                       | 4  | 29.17        |
| DWS  | 150,000,000 | 183,772,828 | -0.47                    | 29.61                       | 2  |              |
| 道富   | 150,000,000 | 183,938,716 | -0.49                    | 29.66                       | 1  |              |
| 北美信託 | 150,000,000 | 183,546,847 | -0.56                    | 29.32                       | 3  |              |
| 合計   | 600,000,000 | 734,386,669 | -0.52                    | 29.40                       | —  |              |

## 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         | 109 年截至 1 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(106.7.25~109.1.31) |    |                 |
|------------------|---------------|---------------|--------------------------|-----------------------------|----|-----------------|
|                  |               |               |                          | 投資<br>報酬率(%)                | 排名 | 指標/目標<br>報酬率(%) |
| American Century | 300,000,000   | 316,703,329   | 0.53                     | 6.07                        | 4  | 4.63/10.92      |
| 富達               | 300,000,000   | 339,323,400   | 0.44                     | 12.82                       | 1  |                 |
| 富蘭克林坦伯頓          | 300,000,000   | 314,580,710   | 0.64                     | 6.43                        | 3  |                 |
| TCW              | 300,000,000   | 325,550,986   | 0.73                     | 10.29                       | 2  |                 |
| 合計               | 1,200,000,000 | 1,296,158,425 | 0.58                     | 8.93                        | —  |                 |

註：本批次為絕對報酬型。

## 107-1 絕對報酬股票型

單位：美元

| 受託機構 | 委託金額        | 目前淨資產       | 109 年截至 1 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(108.1.23~109.1.31) |    |                 |
|------|-------------|-------------|--------------------------|-----------------------------|----|-----------------|
|      |             |             |                          | 投資<br>報酬率(%)                | 排名 | 指標/目標<br>報酬率(%) |
| 野村   | 80,000,000  | 78,400,479  | -1.77                    | -3.33                       | 5  | 2.32/7.44       |
| 景順   | 80,000,000  | 83,093,380  | -1.73                    | 7.19                        | 3  |                 |
| 威靈頓  | 80,000,000  | 87,158,100  | -0.42                    | 15.50                       | 1  |                 |
| CPR  | 80,000,000  | 83,121,957  | -1.55                    | 6.30                        | 4  |                 |
| 道富   | 80,000,000  | 86,608,348  | -0.07                    | 14.36                       | 2  |                 |
| 合計   | 400,000,000 | 418,382,264 | -1.09                    | 7.98                        | —  |                 |

註：本批次為絕對報酬型。

### (二)109 年 1 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)

109 年 1 月 31 日

#### 1. 避險：

| 種類     | 避險比例  |
|--------|-------|
| 權益證券避險 | 0%    |
| 匯率避險   | 5.61% |

#### 2. 投資：無

## (二)舊制勞工退休基金自營部位

(依交易目的)

109 年 1 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             |
|-----------|-----------------|----------------|----------------|
| 109 年 1 月 | -17,960,883,540 | 16,389,168,159 | 34,350,051,699 |

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             |
|-----------|----------------|---------------|----------------|
| 109 年 1 月 | -7,356,896,759 | 5,461,594,706 | 12,818,491,465 |

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

| 109 年 1 月份 |                 | 單位：新台幣元       |
|------------|-----------------|---------------|
| 項 目        | 金 額             |               |
| 基金收入       | 210,256,933,755 |               |
| 基金支出       | 208,867,949,122 |               |
| 現金增(減)數    |                 | 1,388,984,633 |

註：本表採現金基礎。

### (二)舊制勞工退休基金

| 109 年 1 月份 |                | 單位：新台幣元  |
|------------|----------------|----------|
| 項 目        | 金 額            |          |
| 基金收入       | 30,348,161,413 |          |
| 基金支出       | 30,348,793,549 |          |
| 現金增(減)數    |                | -632,136 |

註：本表採現金基礎。