

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(107 年 6 月)績效

基金別	收益率	台灣 10 年期 公債殖利率	台灣 加權股價指數	MSCI 全球股票指數	Barclays 全球債券指數
新制基金	1.51%	1.01%	1.82%	-0.43%	-1.46%
舊制基金	2.20%				

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(106 年)績效

基金別	收益率	台灣 10 年期 公債殖利率	台灣 加權股價指數	MSCI 全球股票指數	Barclays 全球債券指數
新制基金	7.93%	1.06%	15.01%	23.97%	7.39%
舊制基金	7.74%				

(三) 近三年(104~106 年)平均績效

基金別	收益率	台灣 10 年期 公債殖利率	台灣 加權股價指數	MSCI 全球股票指數	Barclays 全球債券指數
新制基金	4.00%	1.10%	4.57%	9.30%	2.02%
舊制基金	4.15%				

(四) 近五年(102~106 年)平均績效

基金別	收益率	台灣 10 年期 公債殖利率	台灣 加權股價指數	MSCI 全球股票指數	Barclays 全球債券指數
新制基金	4.64%	1.27%	6.69%	10.80%	0.79%
舊制基金	5.13%				

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 107 年 6 月底止基金規模與收益			
基金運用規模			2 兆 633 億 1,573 萬元
107 年截至 6 月底止 運用總損益及評價後報酬率	自行運用	國內固定收益	31 億 8,854 萬元 1.07%
		國內權益證券 及國外投資	37 億 3,110 萬元 1.47%
	委託經營		226 億 7,297 萬元 2.06%
	合 計		295 億 9,261 萬元 1.51%

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÷107 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 3：107 年 6 月之保證收益率為 1.0541%。

2. 舊制勞工退休基金

至 107 年 6 月底止基金規模與收益			
基金運用規模			9,181 億 3,089 萬元
107 年截至 6 月底止 運用總損益及評價後報酬率	自行運用	國內固定收益	13 億 5,932 萬元 0.91%
		國內權益證券 及國外投資	21 億 19 萬元 1.11%
	委託經營		144 億 4,101 萬元 3.65%
	合 計		179 億 52 萬元 2.20%

註：評價後報酬率係以當期報酬率（即收益÷107 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 107 年 6 月底

單位：新台幣元

項 目	餘 額	占基金運用比例(%)
自行運用	891,501,592,350	43.21
轉存金融機構	406,956,291,982	19.72
短期票券	54,919,726,972	2.66
公債、公司債、金融債券及特別股	168,065,179,492	8.15
股票及受益憑證投資(含期貨)	80,611,416,400	3.91
國外投資	180,948,977,504	8.77
固定收益	121,379,431,847	5.88
權益證券	27,623,801,689	1.34
另類投資	31,945,743,968	1.55
委託經營	1,171,814,135,321	56.79
國內委託經營	294,129,977,795	14.25
國外委託經營	877,684,157,526	42.54
固定收益	228,248,056,161	11.06
權益證券	451,431,375,011	21.88
另類投資	198,004,726,354	9.60
合 計	2,063,315,727,671	100.00

2. 舊制勞工退休基金

截至 107 年 6 月底

單位：新台幣元

項 目	餘 額	占基金運用比例(%)
自行運用	494,145,770,939	53.82
轉存金融機構	171,693,462,294	18.70
短期票券	50,056,631,982	5.46
公債、金融債券、公司債及證券化商品	85,059,871,181	9.26
股票及受益憑證投資(含期貨)	83,455,059,296	9.09
國外投資	103,880,746,186	11.31
固定收益	55,877,171,766	6.09
權益證券	36,928,506,708	4.02
另類投資	11,075,067,712	1.20
委託經營	423,985,115,978	46.18
國內委託經營	119,373,285,110	13.00
國外委託經營	304,611,830,868	33.18
固定收益	80,860,413,748	8.81
權益證券	176,113,220,489	19.18
另類投資	47,638,196,631	5.19
合 計	918,130,886,917	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 107 年 6 月底

單位：新台幣元

項 目	金 額	占基金運用比例(%)
自行運用	891,501,592,350	43.21
委託經營	1,171,814,135,321	56.79

2. 舊制勞工退休基金

截至 107 年 6 月底

單位：新台幣元

項 目	金 額	占基金運用比例(%)
自行運用	494,145,770,939	53.82
委託經營	423,985,115,978	46.18

(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 107 年 6 月底

單位：新台幣元

項 目	金 額	占基金運用比例(%)
國 內 投 資	1,004,682,592,641	48.69
國 外 投 資	1,058,633,135,030	51.31

2. 舊制勞工退休基金

截至 107 年 6 月底

單位：新台幣元

項 目	金 額	占基金運用比例(%)
國 內 投 資	509,638,309,863	55.51
國 外 投 資	408,492,577,054	44.49

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 107 年 6 月底

項 目	收益率(%)
國內權益證券	-0.44

2. 舊制勞工退休基金

截至 107 年 6 月底

項 目	收益率(%)
國內權益證券	0.73

(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 107 年 6 月底 單位：新台幣元

項 目	金 額	比 例 (%)
國內權益證券	80,611,416,400	3.91

2. 舊制勞工退休基金

截至 107 年 6 月底 單位：新台幣元

項 目	金 額	比 例 (%)
國內權益證券	83,455,059,296	9.09

四、基金國內委外投資概況表

(一)基金國內委外投資績效、績效指標及排名表

1. 新制勞工退休基金

96 年第一次委託經營 (續約 3)

單位：新台幣元

投信 名稱	委託金額	目前淨資產	107 年截至 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (105.9.27~107.6.30)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤/目標 報酬率(%)
野村	15,000,000,000	17,815,588,039	8.81	18.77	—	17.86/10.51

97 年第一次委託經營（續約 3）

單位：新台幣元

投信 名稱	委託金額	目前淨資產	107 年截至 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (106.1.20~107.6.30)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤/目標 報酬率(%)
野村	7,198,313,969	8,589,821,180	8.75	19.33	—	16.30/8.66

98 年第一次委託經營（續約 2）

單位：新台幣元

投信 名稱	委託金額	目前淨資產	107 年截至 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (104.7.14~107.6.30)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤/目標 報酬率(%)
野村	10,576,888,916	12,671,236,446	6.50	19.80	1	19.96/ 17.73
保德信	4,365,128,502	5,096,400,197	-1.04	16.75	2	
合計	14,942,017,418	17,767,636,643	4.22	18.91	—	

99 年第二次委託經營（續約）

單位：新台幣元

投信 名稱	委託金額	目前淨資產	107 年截至 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (103.12.1~107.6.30)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤/目標 報酬率(%)
國泰	7,366,621,977	9,584,267,973	4.94	34.06	—	17.96/21.52

100 年第一次委託經營(續約)(相對報酬)

單位：新台幣元

投信 名稱	委託金額	目前淨資產	107 年截至 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (104.7.15~107.6.30)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤/指標 報酬率(%)
復華	14,358,076,699	19,517,074,062	6.29	35.93	1	19.85/ 29.87
滙豐中華	15,278,501,877	19,575,230,464	3.21	28.12	2	
合計	29,636,578,576	39,092,304,526	4.72	31.91	—	

註：本次委託為相對報酬委託經營，採分批撥款，上述績效係採幾何報酬率計算；以就業 99 指數為指定指標。

100 年第二次委託經營(續約)

單位：新台幣元

投信 名稱	委託金額	目前淨資產	107 年截至 6 月 累積投資報酬 (%)	委任迄今 (104.8.10~107.6.30)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤/目標 報酬率(%)
復華	17,101,520,990	23,221,691,194	10.77	35.79	—	28.36/17.28

101 年第一次委託經營(續約)(相對報酬)

單位：新台幣元

投信 名稱	委託金額	目前淨資產	107 年截至 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (105.4.18~107.6.30)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤/指標 報酬率(%)
國泰	5,387,135,656	7,318,861,637	3.17	35.86	1	24.56/ 36.10
滙豐中華	10,927,481,593	14,505,442,466	1.08	32.74	2	
合計	16,314,617,249	21,824,304,103	1.77	33.77	—	

註：本次委託為相對報酬委託經營，採分批撥款，上述績效係採幾何報酬率計算；以加權股價報酬指數為指定指標。

101 年第二次委託經營(續約)

單位：新台幣元

投信 名稱	委託金額	目前淨資產	107 年截至 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (105.7.18~107.6.30)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤/目標 報酬率(%)
野村	6,850,998,495	8,338,824,952	8.75	21.72	2	21.08/ 11.65
統一	7,019,680,328	9,990,322,210	17.28	42.32	1	
合計	13,870,678,823	18,329,147,162	13.24	32.14	—	

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	107 年截至 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (106.6.7~107.6.30)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤/目標 報酬率(%)
統一	3,126,252,099	4,256,357,274	22.46	36.15	1	6.18/ 6.41
復華	6,481,866,342	8,103,567,561	14.42	25.02	2	
合計	9,608,118,441	12,359,924,835	17.07	28.64	—	

102 年第二次委託經營(續約) (相對報酬)

單位：新台幣元

投信 名稱	委託金額	目前淨資產	107 年截至 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (107.1.22~107.6.30)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤/指標 報酬率(%)
統一	7,009,597,591	7,738,070,435	10.39	10.39	1	-2.82/ -1.89
復華	12,838,542,112	13,018,363,802	1.40	1.40	3	
群益	6,918,664,544	7,046,786,804	1.85	1.85	2	
滙豐中華	7,206,530,255	7,035,825,291	-2.37	-2.37	4	
合計	33,973,334,502	34,839,046,332	2.55	2.55	—	

註：本次委託為相對報酬委託經營，上述績效係採幾何報酬率計算；以加權股價報酬指數為指定指標。

103 年第一次委託經營第一期

單位：新台幣元

投信 名稱	委託金額	目前淨資產	107 年截至 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (103.8.11~107.6.30)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤/目標 報酬率(%)
國泰	7,000,000,000	8,383,770,244	1.47	19.77	3	19.27/ 23.41
統一	7,000,000,000	9,011,067,803	12.25	28.73	2	
復華	7,000,000,000	9,225,218,002	10.88	31.79	1	
合計	21,000,000,000	26,620,056,049	8.17	26.76	—	

103 年第一次委託經營第二期

單位：新台幣元

投信 名稱	委託金額	目前淨資產	107 年截至 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (103.10.8~107.6.30)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤/目標 報酬率(%)
台新	7,000,000,000	8,483,481,098	1.07	21.19	2	19.87/ 22.43
保德信	7,000,000,000	7,974,952,502	0.19	13.93	3	
群益	7,000,000,000	8,669,704,513	4.22	23.85	1	
合計	21,000,000,000	25,128,138,113	1.85	19.66	—	

103 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	107 年截至 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (106.12.1~107.6.30)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤/指標 報酬率(%)
國泰	3,000,000,000	3,108,619,893	3.51	3.62	3	2.62/ 3.71
統一	3,000,000,000	3,123,178,670	4.15	4.11	1	
復華	3,000,000,000	3,093,097,966	3.14	3.10	4	
滙豐中華	3,000,000,000	3,085,316,531	2.39	2.84	5	
安聯	3,000,000,000	3,116,085,512	3.75	3.87	2	
合計	15,000,000,000	15,526,298,572	3.39	3.51	—	

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

104 年第一次委託經營第一期

單位：新台幣元

投信 名稱	委託金額	目前淨資產	107 年截至 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (104.3.31~107.6.30)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤/目標 報酬率(%)
永豐	2,500,000,000	3,130,178,810	10.35	25.21	3	13.81/ 19.50
國泰	2,500,000,000	3,099,313,477	8.64	23.97	4	
統一	2,500,000,000	3,735,494,582	23.56	49.42	1	
復華	2,500,000,000	3,640,763,163	20.15	45.63	2	
滙豐中華	2,500,000,000	2,942,013,031	1.94	17.68	6	
安聯	2,500,000,000	2,976,946,760	9.36	19.08	5	
合計	15,000,000,000	19,524,709,823	12.53	30.16	—	

104 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	107 年截至 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (105.12.28~107.6.30)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤/目標 報酬率(%)
永豐	2,500,000,000	2,872,028,829	5.99	14.88	5	18.97/ 9.03
國泰	2,500,000,000	2,971,540,756	9.12	18.86	4	
統一	2,500,000,000	3,663,622,504	26.81	46.54	2	
復華	2,500,000,000	3,775,032,073	19.62	51.00	1	
滙豐中華	2,500,000,000	2,788,781,682	1.96	11.55	6	
安聯	2,500,000,000	2,993,833,724	9.02	19.75	3	
合計	15,000,000,000	19,064,839,568	12.41	27.10	—	

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	107 年截至 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (107.2.7~107.6.30)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤/目標 報酬率(%)
台新	2,500,000,000	2,544,278,030	1.77	1.77	6	4.16/ 2.34
安聯	2,500,000,000	2,771,906,417	10.88	10.88	2	
保德信	2,500,000,000	2,551,225,041	2.05	2.05	5	
國泰	2,500,000,000	2,509,976,539	0.40	0.40	7	
復華	2,500,000,000	2,827,381,706	13.10	13.10	1	
群益	2,500,000,000	2,572,157,517	2.89	2.89	4	
滙豐中華	2,500,000,000	2,580,603,701	3.22	3.22	3	
合計	17,500,000,000	18,357,528,951	4.90	4.90	—	

2. 舊制勞工退休基金

國內 98 年第二次委託經營(續約 2)

單位：新台幣元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	107 年截至 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (105.1.26~107.6.30)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤/目標 報酬率(%)
富邦	4,927,262,338	6,177,424,935	3.94	25.37	2	37.28/14.44
統一	5,071,927,246	7,285,808,272	17.34	43.65	1	
合計	9,999,189,584	13,463,233,207	10.79	34.64	—	

國內 100 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	107 年截至 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (104.3.17~107.6.30)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤/目標 報酬率(%)
群益	3,094,525,480	3,560,845,546	7.79	20.53	3	13.92/19.74
復華	6,134,978,456	8,132,478,091	12.35	32.56	1	
統一	6,511,946,664	8,401,455,393	17.50	29.02	2	
合計	15,741,450,600	20,094,779,030	13.58	27.82	—	

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	107 年截至 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (105.10.31~107.6.30)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤/指標 報酬率(%)
匯豐中華	5,684,367,652	6,721,792,140	1.09	18.25	—	16.44/22.17

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	107 年截至 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (105.5.3~107.6.30)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤/目標 報酬率(%)
野村	16,650,814,154	22,884,092,801	13.37	37.44	—	29.35/12.87

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	107 年截至 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (106.6.7~107.6.30)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤/目標 報酬率(%)
統一	3,126,679,953	4,256,966,561	22.45	36.15	1	6.18/6.41
復華	12,007,032,629	15,009,422,188	14.39	25.01	2	
合計	15,133,712,582	19,266,388,749	16.08	27.31	—	

國內 104 年第一次委託經營第一期

單位：新台幣元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	107 年截至 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (104.3.31~107.6.30)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤/目標 報酬率(%)
永豐	2,500,000,000	3,130,475,405	10.35	25.22	3	13.81/19.50
國泰	2,500,000,000	3,099,587,800	8.64	23.98	4	
統一	2,500,000,000	3,735,836,561	23.56	49.43	1	
復華	2,500,000,000	3,641,009,603	20.15	45.64	2	
匯豐中華	2,500,000,000	2,942,353,310	1.94	17.69	6	
安聯	2,500,000,000	2,977,239,714	9.36	19.09	5	
合計	15,000,000,000	19,526,502,393	12.53	30.18	—	

國內 104 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	107 年截至 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (105.12.28~107.6.30)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤/目標 報酬率(%)
永豐	2,500,000,000	2,872,179,326	5.99	14.89	5	18.97/9.03
國泰	2,500,000,000	2,971,682,332	9.12	18.87	4	
統一	2,500,000,000	3,663,810,495	26.81	46.55	2	
復華	2,500,000,000	3,775,201,344	19.62	51.01	1	
匯豐中華	2,500,000,000	2,788,943,312	1.96	11.56	6	
安聯	2,500,000,000	2,993,994,767	9.02	19.76	3	
合計	15,000,000,000	19,065,811,576	12.42	27.11	—	

國內 106 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	107 年截至 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (107. 2. 7~107. 6. 30)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤/目標 報酬率(%)
台新	2,500,000,000	2,544,306,650	1.77	1.77	6	4.16/2.34
安聯	2,500,000,000	2,771,939,219	10.88	10.88	2	
保德信	2,500,000,000	2,551,249,401	2.05	2.05	5	
國泰	2,500,000,000	2,510,003,174	0.40	0.40	7	
復華	2,500,000,000	2,827,413,554	13.10	13.10	1	
群益	2,500,000,000	2,572,192,037	2.89	2.89	4	
匯豐中華	2,500,000,000	2,580,647,204	3.23	3.23	3	
合計	17,500,000,000	18,357,751,239	4.90	4.90	—	

(二) 107 年 6 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	107 年截至 6 月 累積投資報酬率(%)	委任迄今 (105.6.6~107.6.30)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
聯博	793,101,125	799,728,110	-2.20	0.84	1	0.38
富蘭克林 坦伯頓	744,405,663	739,068,754	-2.87	-0.72	2	
合計	1,537,506,788	1,538,796,864	-2.52	0.08	—	

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	107 年截至 6 月 累積投資報酬率(%)	委任迄今 (106.1.6~107.6.30)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
太平洋	819,586,290	872,821,673	-1.45	6.50	—	5.39

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	107 年截至 6 月 累積投資報酬率(%)	委任迄今 (106.2.6~107.6.30)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
貝萊德	967,348,593	1,197,956,462	-1.06	23.84	1	19.21
摩根	802,177,668	953,893,095	-0.83	18.91	2	
合計	1,769,526,261	2,151,849,557	-0.96	21.61	—	

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	107 年截至 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (106.11.17~107.6.30)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
景順	902,621,073	870,261,573	-5.49	-3.32	—	-1.66

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	107 年截至 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (106.12.4~107.6.30)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
貝萊德	535,489,288	545,335,371	-0.19	1.84	1	1.57
道富	728,826,441	741,952,014	-0.16	1.80	2	
合計	1,264,315,729	1,287,287,385	-0.17	1.82	—	

99-1 全球新興市場主動股票型（續約）

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	107 年截至 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (103.8.25~107.6.30)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
摩根士丹利	403,049,882	412,508,626	-9.32	2.35	2	7.46
瑞萬通博	716,993,858	774,059,587	-7.14	7.96	1	
合計	1,120,043,740	1,186,568,213	-7.91	5.94	—	

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	107 年截至 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (105.7.1~107.6.30)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
道富	662,180,574	845,162,152	-2.21	32.63	2	32.19
貝萊德	666,301,910	851,766,477	-2.15	32.81	1	
合計	1,328,482,484	1,696,928,629	-2.18	32.72	—	

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	107 年截至 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (106.3.6~107.6.30)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
Cohen & Steers	1,051,936,411	1,162,692,292	0.31	11.66	1	10.17
景順	984,104,927	1,089,308,086	0.26	10.69	2	
合計	2,036,041,338	2,252,000,378	0.28	11.16	—	

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	107 年截至 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (106.7.31~107.6.30)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
Ashmore	454,453,121	445,676,432	-4.06	-1.93	2	-1.06
Pictet	454,291,634	447,870,517	-3.08	-1.41	1	
合計	908,744,755	893,546,949	-3.57	-1.67	—	

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	107 年截至 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (107.4.18~107.6.30)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
道富	698,231,848	678,888,023	-2.77	-2.77	2	-2.83
貝萊德	694,293,722	675,194,861	-2.75	-2.75	1	
合計	1,392,525,570	1,354,082,884	-2.76	-2.76	—	

102-1 全球高股利增值股票型

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	107 年截至 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (103.1.22~107.6.30)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
瑞萬通博	500,000,000	773,193,492	1.97	59.06	1	21.88
MFS	500,000,000	610,031,508	-3.95	26.21	3	
威靈頓	500,000,000	634,738,927	-2.09	31.97	2	
合計	1,500,000,000	2,017,963,927	-1.16	39.13	—	

102-1 全球信用主動債券型

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	107 年截至 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (103.4.25~107.6.30)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
Bluebay	400,000,000	423,138,030	-2.48	6.04	2	5.18
貝萊德	400,000,000	420,726,075	-3.19	5.38	3	
盧米斯	400,000,000	425,476,545	-3.17	6.59	1	
合計	1,200,000,000	1,269,340,650	-2.95	6.00	—	

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	107 年截至 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (104.8.11~107.6.30)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
北美信託	650,000,000	884,218,628	1.18	34.69	1	33.95
LGIM	650,000,000	883,289,456	1.09	34.33	2	
Geode	650,000,000	882,004,914	1.15	34.19	3	
合計	1,950,000,000	2,649,512,998	1.14	34.40	—	

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	107 年截至 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (104.9.25~107.6.30)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
Cohen & Steers	350,000,000	424,583,219	-1.04	21.14	4	24.70
麥格理	550,000,000	617,041,845	-1.43	22.41	3	
Magellan	650,000,000	735,954,060	-1.02	33.71	1	
RREEF	350,000,000	419,758,207	-1.56	24.50	2	
合計	1,900,000,000	2,197,337,331	-1.24	25.46	—	

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	107 年截至 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (104.11.13~107.6.30)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
NNIP	300,000,000	306,182,966	-4.59	6.52	3	10.76
Brandywine	500,000,000	525,086,018	-2.60	14.78	1	
盧米斯	300,000,000	322,588,437	-3.30	10.51	2	
合計	1,100,000,000	1,153,857,421	-3.33	10.73	—	

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	107 年截至 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (105.7.20~107.6.30)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標/目標 報酬率(%)
安聯	450,000,000	482,959,224	-2.85	7.75	3	2.73 /12.47
摩根	650,000,000	733,656,416	0.49	17.85	1	
德意志	500,000,000	530,547,361	-1.13	6.85	4	
柏瑞	500,000,000	554,930,770	-2.33	12.21	2	
合計	2,100,000,000	2,302,093,771	-1.28	11.36	—	

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	107 年截至 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (105.8.24~107.6.30)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
貝萊德	500,000,000	603,769,194	-2.04	22.80	1	21.81
北美信託	400,000,000	467,526,494	-4.89	14.23	3	
領航	500,000,000	586,476,679	-5.35	21.22	2	
合計	1,400,000,000	1,657,772,367	-4.10	19.40	—	

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	107 年截至 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (106.6.22~107.6.30)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
貝萊德	250,000,000	262,983,660	-1.02	9.97	4	10.04
德意志	250,000,000	263,055,340	-1.17	10.09	1	
道富	250,000,000	263,157,141	-0.90	10.06	3	
北美信託	250,000,000	263,315,971	-1.00	10.08	2	
合計	1,000,000,000	1,052,512,112	-1.02	10.05	—	

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	107 年截至 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (106.7.25~107.6.30)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標/目標 報酬率(%)
American Century	400,000,000	398,099,369	-0.80	-0.34	3	1.31 /3.65
富達	400,000,000	389,097,910	-3.77	-3.47	4	
富蘭克林 坦伯頓	400,000,000	403,955,005	0.56	1.55	1	
TCW	400,000,000	403,378,275	0.18	1.40	2	
合計	1,600,000,000	1,594,530,559	-0.96	-0.22	—	

註：本批次為絕對報酬型。

2. 舊制勞工退休基金

96 年續約 2 國外委託經營(平衡型)

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	107 年截至 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (104.6.22~107.6.30)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
富達國際	683,555,210	780,950,030	0.77	14.16	—	18.36

97 年續約 2 國外委託經營(全球增值債券型)

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	107 年截至 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (106.1.6~107.6.30)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
太平洋	923,576,760	984,311,797	-1.45	6.58	1	5.39
盧米斯	698,763,197	741,656,705	-1.69	6.14	2	
合計	1,622,339,957	1,725,968,502	-1.55	6.39	—	

97 年續約 2 國外委託經營(全球增值股票型)

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	107 年截至 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (106.2.6~107.6.30)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
貝萊德	756,337,413	936,787,535	-1.07	23.86	—	19.21

98 年續約 2 國外委託經營(亞太股票型)

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	107 年截至 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (106.11.17~107.6.30)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
景順	507,323,526	490,905,722	-5.49	-3.24	—	-1.66

100 年續約國外委託經營(全球基本面指數股票型)

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	107 年截至 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (106.3.6~107.6.30)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
貝萊德	405,588,950	459,084,818	-2.17	13.19	4	12.77
道富	408,539,391	462,833,210	-2.23	13.29	3	
瑞銀	406,994,133	462,114,317	-2.11	13.54	1	
野村	407,549,840	462,461,833	-2.16	13.47	2	
合計	1,628,672,314	1,846,494,178	-2.17	13.37	—	

101 年國外委託經營(全球低波動指數股票型)

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	107 年截至 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (107.6.13~107.6.30)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
貝萊德	671,455,711.11	652,531,682	-2.82	-2.82	—	-2.76

102 年國外委託經營(全球高股利增值股票型)

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	107 年截至 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (103.1.22~107.6.30)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
瑞萬通博	200,000,000	293,582,107	1.95	58.92	1	21.88
MFS	200,000,000	248,808,602	-3.96	25.96	3	
威靈頓	400,000,000	506,011,859	-2.08	31.92	2	
合計	800,000,000	1,048,402,568	-1.44	37.62	—	

102 年國外委託經營(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	107 年截至 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (103.5.29~107.6.30)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
Lazard	300,000,000	402,396,579	-0.71	38.56	1	12.46
Cohen & Steers	100,000,000	109,375,963	-0.97	10.43	2	
合計	400,000,000	511,772,542	-0.77	27.26	—	

102 年國外委託經營(全球不動產有價證券型)

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	107 年截至 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (103.8.27~107.6.30)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
PGI	300,000,000	362,456,978	1.89	22.64	1	15.71
AMP	100,000,000	112,978,099	0.10	12.49	2	
合計	400,000,000	475,435,077	1.46	19.27	—	

105 年國外委託經營(全球多元資產型)

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	107 年截至 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (105.7.20~107.6.30)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標/目標 報酬率(%)
安聯	150,000,000	160,983,606	-2.85	7.75	3	2.73/12.47
摩根	150,000,000	176,344,356	0.53	17.92	1	
德意志	150,000,000	160,183,273	-1.19	6.82	4	
柏瑞	150,000,000	168,199,995	-2.33	12.26	2	
合計	600,000,000	665,711,230	-1.44	11.19	—	

註：本批次為絕對報酬型。

106 年國外委託經營(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	107 年截至 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (106.6.22~107.6.30)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
貝萊德	150,000,000	156,004,822	-1.09	9.92	4	10.04
德意志	150,000,000	156,159,227	-1.15	10.13	2	
道富	150,000,000	156,300,340	-0.93	10.18	1	
北美信託	150,000,000	156,021,815	-1.03	9.93	3	
合計	600,000,000	624,486,204	-1.05	10.04	—	

106 年國外委託經營(絕對報酬債券型)

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	107 年截至 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (106.7.25~107.6.30)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標/目標 報酬率(%)
American Century	150,000,000	149,498,399	-0.79	-0.33	3	1.31/3.64
富達	150,000,000	144,458,129	-3.99	-3.69	4	
Franklin	150,000,000	152,497,214	0.62	1.66	1	
TCW	150,000,000	152,100,290	0.16	1.40	2	
合計	600,000,000	598,554,032	-1.00	-0.24	—	

註：本批次為絕對報酬型。

(二)107 年 6 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)

107 年 6 月 30 日

1. 避險：

種類	避險比例
權益證券避險	0%
匯率避險	6.07%

2. 投資：無

(二)舊制勞工退休基金自營部位

(依交易目的)

107 年 6 月 30 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
107 年 6 月	12,046,218,611	30,977,699,614	18,931,481,003

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
107 年 6 月	5,133,142,918	14,548,601,251	9,415,458,333

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

107 年 6 月份		單位：新台幣元
項 目	金 額	
基金收入	283,430,983,392	
基金支出	287,380,565,355	
現金增(減)數		-3,949,581,963

註：本表採現金基礎。

(二)舊制勞工退休基金

107 年 6 月份		單位：新台幣元
項 目	金 額	
基金收入	35,973,935,657	
基金支出	35,973,345,693	
現金增(減)數		589,964

註：本表採現金基礎。