

勞工退休基金運用情形

一、勞工退休基金整體績效

(一) 113 年截至 6 月底績效

| 基金與指標 | 新制基金 | 舊制基金 | 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 | Bloomberg 全球債券指數 |
|---------|--------|--------|-------------------|--------------|-----------------|---------------------|
| 收益率/報酬率 | 12.96% | 14.88% | 1.44% | 28.45% | 11.30% | -3.16% |

註 1：股、債指數係依據勞動部 111 年 4 月 29 日勞動福 4 字第 1110145465 號函核定之勞動基金投資政策書所載參考指標，且均為原幣別報酬率。

註 2：收益率係評價後收益數÷日平均餘額。

(二) 近一年(112 年)績效

| 基金與指標 | 新制基金 | 舊制基金 | 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 | Bloomberg 全球債券指數 |
|---------|--------|--------|-------------------|--------------|-----------------|---------------------|
| 收益率/報酬率 | 12.60% | 14.83% | 1.21% | 26.83% | 22.20% | 5.72% |

(三) 近三年(110~112 年)平均績效

| 基金與指標 | 新制基金 | 舊制基金 | 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 | Bloomberg 全球債券指數 |
|---------|-------|-------|-------------------|--------------|-----------------|---------------------|
| 收益率/報酬率 | 5.26% | 5.83% | 0.96% | 6.77% | 5.75% | -5.51% |

(四) 近五年(108~112 年)平均績效

| 基金與指標 | 新制基金 | 舊制基金 | 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 | Bloomberg 全球債券指數 |
|---------|-------|-------|-------------------|--------------|-----------------|---------------------|
| 收益率/報酬率 | 6.51% | 7.90% | 0.81% | 13.01% | 11.72% | -0.32% |

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

| 113年6月底止基金規模與收益 | | | |
|-------------------------|------|-----------------|-------------------------|
| 基金運用規模 | | 4兆3,744億1,260萬元 | |
| 113年截至6月底止 運用收益數及收益率 | 自行運用 | 國內固定收益 | 60億2,799萬元 1.50% |
| | | 國內權益證券 及國外投資 | 1,663億261萬元 18.88% |
| | 委託經營 | | 3,675億3,858萬元 14.84% |
| | 合計 | | 5,398億6,918萬元 12.96% |

註1：勞工退休金條例施行細則第34條規定收益率事項應另以本局公告為準。

註2：收益率係以當期收益率列示，惟國內固定收益係以年化收益率列示。

註3：113年6月之保證收益率為1.7108%。

2. 舊制勞工退休基金

| 113年6月底止基金規模與收益 | | | |
|-------------------------|------|-----------------|-------------------------|
| 基金運用規模 | | 10,519億8,230萬元 | |
| 113年截至6月底止 運用收益數及收益率 | 自行運用 | 國內固定收益 | 21億5,807萬元 1.51% |
| | | 國內權益證券 及國外投資 | 671億3,553萬元 30.46% |
| | 委託經營 | | 607億8,001萬元 11.72% |
| | 合計 | | 1,300億7,361萬元 14.88% |

註：評價後報酬率係以當期報酬率（即收益÷113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

113年6月30日

單位：新臺幣元

| 項 目 | 餘 額 | 占基金運用比率(%) |
|-----------------|--------------------------|---------------|
| 自行運用 | 1,769,860,209,139 | 40.46 |
| 轉存金融機構 | 516,245,296,257 | 11.80 |
| 短期票券 | 101,245,630,135 | 2.31 |
| 公債、公司債、金融債券及特別股 | 234,815,641,594 | 5.37 |
| 股票及受益憑證投資(含期貨) | 227,038,964,038 | 5.19 |
| 國外投資 | 690,514,677,115 | 15.79 |
| 固定收益 | 573,594,259,289 | 13.12 |
| 權益證券 | 58,348,742,796 | 1.33 |
| 另類投資 | 58,571,675,030 | 1.34 |
| 委託經營 | 2,604,552,388,878 | 59.54 |
| 國內委託經營 | 574,618,955,107 | 13.14 |
| 國外委託經營 | 2,029,933,433,771 | 46.40 |
| 固定收益 | 529,847,159,426 | 12.11 |
| 權益證券 | 1,050,558,625,677 | 24.01 |
| 另類投資 | 449,527,648,668 | 10.28 |
| 合 計 | 4,374,412,598,017 | 100.00 |

2. 舊制勞工退休基金

113年6月30日

單位：新臺幣元

| 項 目 | 餘 額 | 占基金運用比率(%) |
|-------------------|--------------------------|---------------|
| 自行運用 | 517,350,921,242 | 49.18 |
| 轉存金融機構 | 153,829,504,638 | 14.62 |
| 短期票券 | 61,651,343,712 | 5.86 |
| 公債、金融債券、公司債及證券化商品 | 73,297,556,036 | 6.97 |
| 股票及受益憑證投資(含期貨) | 114,722,114,063 | 10.91 |
| 國外投資 | 113,850,402,793 | 10.82 |
| 固定收益 | 68,411,505,422 | 6.50 |
| 權益證券 | 36,382,413,782 | 3.46 |
| 另類投資 | 9,056,483,589 | 0.86 |
| 委託經營 | 534,631,377,520 | 50.82 |
| 國內委託經營 | 113,801,200,795 | 10.81 |
| 國外委託經營 | 420,830,176,725 | 40.01 |
| 固定收益 | 102,856,344,686 | 9.78 |
| 權益證券 | 214,044,609,723 | 20.35 |
| 另類投資 | 103,929,222,316 | 9.88 |
| 合 計 | 1,051,982,298,762 | 100.00 |

(三)基金自營投資與委外投資比率

1. 新制勞工退休基金

113年6月30日

單位：新臺幣元

| 項 目 | 金 額 | 占基金運用比率(%) |
|------|-------------------|------------|
| 自行運用 | 1,769,860,209,139 | 40.46 |
| 委託經營 | 2,604,552,388,878 | 59.54 |

2. 舊制勞工退休基金

113年6月30日

單位：新臺幣元

| 項 目 | 金 額 | 占基金運用比率(%) |
|------|-----------------|------------|
| 自行運用 | 517,350,921,242 | 49.18 |
| 委託經營 | 534,631,377,520 | 50.82 |

(四)基金國內投資與國外投資比率

1. 新制勞工退休基金

113年6月30日

單位：新臺幣元

| 項 目 | 金 額 | 占基金運用比率(%) |
|------|-------------------|------------|
| 國內投資 | 1,653,964,487,131 | 37.81 |
| 國外投資 | 2,720,448,110,886 | 62.19 |

2. 舊制勞工退休基金

113年6月30日

單位：新臺幣元

| 項 目 | 金 額 | 占基金運用比率(%) |
|------|-----------------|------------|
| 國內投資 | 517,301,719,244 | 49.17 |
| 國外投資 | 534,680,579,518 | 50.83 |

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

113年截至6月底

| 項 目 | 收益率(%) |
|--------|--------|
| 國內權益證券 | 49.58 |

2. 舊制勞工退休基金

113年截至6月底

| 項 目 | 收益率(%) |
|--------|--------|
| 國內權益證券 | 46.53 |

(二)基金自營股票及受益憑證投資比率概況

1. 新制勞工退休基金

113年6月30日 單位：新臺幣元

| 項 目 | 金 額 | 比 率 (%) |
|--------|-----------------|---------|
| 國內權益證券 | 227,038,964,038 | 5.19 |

2. 舊制勞工退休基金

113年6月30日 單位：新臺幣元

| 項 目 | 金 額 | 比 率 (%) |
|--------|-----------------|---------|
| 國內權益證券 | 114,722,114,063 | 10.91 |

四、基金國內委外投資概況表

(一)基金國內委外投資績效、績效指標及排名表

1. 新制勞工退休基金

96年第一次委託經營(續約5)

單位：新臺幣元

| 投信名稱 | 委託金額 | 目前淨資產 | 113年截至6月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (111.9.27~113.6.30) | | |
|------|----------------|----------------|-----------------------|-----------------------------|----|--------------|
| | | | | 投資報酬率 (%) | 排名 | 目標報酬率 (%) |
| 野村 | 28,072,603,831 | 42,977,243,849 | 23.96 | 53.09 | — | 11.02 |

註：本批次為絕對報酬型，契約目標報酬率係以臺灣證交所公告之最近5年年底股票集中市場平均殖利率加計250個基本點為基準。

97年第一次委託經營(續約5)

單位：新臺幣元

| 投信名稱 | 委託金額 | 目前淨資產 | 113年截至6月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (112.1.30~113.6.30) | | |
|------|---------------|----------------|-----------------------|-----------------------------|----|--------------|
| | | | | 投資報酬率 (%) | 排名 | 目標報酬率 (%) |
| 野村 | 6,829,066,771 | 10,264,898,348 | 26.29 | 50.31 | — | 8.91 |

註：本批次為絕對報酬型，契約目標報酬率係以臺灣證交所公告之最近5年年底股票集中市場平均殖利率加計250個基本點為基準。

98 年第一次委託經營(續約 4)

單位：新臺幣元

| 投信名稱 | 委託金額 | 目前淨資產 | 113 年截至 6 月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (110.7.16~113.6.30) | | |
|------|----------------|----------------|--------------------------|-----------------------------|----|--------------|
| | | | | 投資報酬率 (%) | 排名 | 目標報酬率 (%) |
| 野村 | 19,093,323,980 | 24,981,552,437 | 24.40 | 30.84 | 1 | 16.69 |
| 保德信 | 6,277,574,114 | 7,447,946,630 | 8.39 | 18.64 | 2 | |
| 合計 | 25,370,898,094 | 32,429,499,067 | 20.32 | 27.82 | — | |

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

99 年第二次委託經營(續約 3)

單位：新臺幣元

| 投信名稱 | 委託金額 | 目前淨資產 | 113 年截至 6 月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (111.12.5~113.6.30) | | |
|------|----------------|----------------|--------------------------|-----------------------------|----|--------------|
| | | | | 投資報酬率 (%) | 排名 | 目標報酬率 (%) |
| 國泰 | 10,445,113,310 | 13,313,803,954 | 15.87 | 27.46 | — | 9.86 |

註：本批次為絕對報酬型，契約目標報酬率係以臺灣證交所公告之最近 5 年年底股票集中市場平均殖利率加計 250 個基本點為基準。

100 年第一次委託經營(續約 3)(相對報酬)

單位：新臺幣元

| 投信名稱 | 委託金額 | 目前淨資產 | 113 年截至 6 月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (112.7.15~113.6.30) | | |
|------|----------------|----------------|--------------------------|-----------------------------|----|--------------|
| | | | | 投資報酬率 (%) | 排名 | 指標報酬率 (%) |
| 復華 | 29,101,525,086 | 36,543,467,994 | 19.91 | 25.57 | — | 25.12 |

註：本批次為相對報酬型，以臺灣就業 99 指數為指定指標。

101 年第二次委託經營(續約 2)

單位：新臺幣元

| 投信名稱 | 委託金額 | 目前淨資產 | 113 年截至 6 月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (109.7.20~113.6.30) | | |
|------|----------------|----------------|--------------------------|-----------------------------|----|--------------|
| | | | | 投資報酬率 (%) | 排名 | 目標報酬率 (%) |
| 野村 | 9,057,257,704 | 15,650,638,457 | 25.80 | 72.80 | 1 | 22.66 |
| 統一 | 12,294,643,442 | 21,083,496,100 | 20.36 | 71.49 | 2 | |
| 合計 | 21,351,901,146 | 36,734,134,557 | 22.62 | 72.04 | — | |

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

102年第二次委託經營(續約2) (相對報酬) 單位：新臺幣元

| 投信名稱 | 委託金額 | 目前淨資產 | 113年截至6月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (111.1.24~113.6.30) | | |
|------|----------------|----------------|-----------------------|-----------------------------|----|--------------|
| | | | | 投資報酬率 (%) | 排名 | 指標報酬率 (%) |
| 統一 | 14,437,134,744 | 21,123,629,171 | 31.53 | 46.31 | 1 | 40.95 |
| 復華 | 18,009,802,076 | 24,447,629,535 | 30.57 | 34.45 | 2 | |
| 合計 | 32,446,936,820 | 45,571,258,706 | 31.00 | 39.57 | — | |

註：本批次為相對報酬型，以臺灣加權股價報酬指數為指定指標。

103年第一次委託經營(續約2)

單位：新臺幣元

| 投信名稱 | 委託金額 | 目前淨資產 | 113年截至6月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (111.10.11~113.6.30) | | |
|------|----------------|----------------|-----------------------|------------------------------|----|--------------|
| | | | | 投資報酬率 (%) | 排名 | 目標報酬率 (%) |
| 台新 | 15,841,461,125 | 23,181,272,172 | 18.49 | 46.33 | — | 10.79 |

註：本批次為絕對報酬型，契約目標報酬率係以臺灣證交所公告之最近5年年底股票集中市場平均殖利率加計250個基本點為基準。

103 年第二次委託經營(續約) (相對報酬)

單位：新臺幣元

| 投信名稱 | 委託金額 | 目前淨資產 | 113 年截至 6 月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (110.12.1~113.6.30) | | |
|------|----------------|----------------|--------------------------|-----------------------------|----|--------------|
| | | | | 投資報酬率 (%) | 排名 | 指標報酬率 (%) |
| 國泰 | 14,836,482,661 | 21,768,260,091 | 22.98 | 48.45 | 5 | 52.79 |
| 統一 | 11,353,734,691 | 17,175,776,908 | 23.14 | 51.28 | 1 | |
| 復華 | 10,890,868,617 | 16,353,221,242 | 23.14 | 50.16 | 2 | |
| 滙豐 | 10,790,827,015 | 16,090,490,381 | 22.92 | 49.11 | 3 | |
| 安聯 | 15,017,345,063 | 22,080,572,583 | 22.28 | 48.59 | 4 | |
| 合計 | 62,889,258,047 | 93,468,321,205 | 22.86 | 49.42 | — | |

註：本批次為相對報酬型，以臺灣高薪 100 報酬指數為指定指標。

104 年第一次委託經營 (續約 2)

單位：新臺幣元

| 投信名稱 | 委託金額 | 目前淨資產 | 113 年截至 6 月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (112.4.6~113.6.30) | | |
|------|---------------|----------------|--------------------------|----------------------------|----|--------------|
| | | | | 投資報酬率 (%) | 排名 | 目標報酬率 (%) |
| 復華 | 4,799,121,512 | 6,300,832,556 | 18.32 | 31.29 | 1 | 7.76 |
| 安聯 | 3,601,238,896 | 4,566,494,666 | 17.66 | 26.80 | 2 | |
| 合計 | 8,400,360,408 | 10,867,327,222 | 18.04 | 29.37 | — | |

註：本批次為絕對報酬型，契約目標報酬率係以臺灣證交所公告之最近 5 年年底股票集中市場平均殖利率加計 250 個基本點為基準。

106 年第一次委託經營 (續約)

單位：新臺幣元

| 投信名稱 | 委託金額 | 目前淨資產 | 113 年截至 6 月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (112.2.7~113.6.30) | | |
|------|----------------|----------------|--------------------------|----------------------------|----|--------------|
| | | | | 投資報酬率 (%) | 排名 | 目標報酬率 (%) |
| 安聯 | 14,088,712,403 | 20,558,689,285 | 24.89 | 45.92 | 1 | 8.77 |
| 國泰 | 6,318,453,600 | 8,237,121,271 | 16.31 | 30.37 | 2 | |
| 群益 | 6,382,621,945 | 8,215,972,637 | 10.82 | 28.72 | 3 | |
| 滙豐 | 7,096,535,878 | 8,993,001,164 | 13.78 | 26.72 | 4 | |
| 合計 | 33,886,323,826 | 46,004,784,357 | 18.38 | 35.76 | — | |

註：本批次為絕對報酬型，契約目標報酬率係以臺灣證交所公告之最近 5 年年底股票集中市場平均殖利率加計 250 個基本點為基準。

107 年第一次委託經營(續約)(相對報酬)

單位：新臺幣元

| 投信名稱 | 委託金額 | 目前淨資產 | 113 年截至 6 月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (112.10.24~113.6.30) | | |
|------|----------------|----------------|--------------------------|------------------------------|----|--------------|
| | | | | 投資報酬率 (%) | 排名 | 指標報酬率 (%) |
| 台新 | 8,254,694,051 | 12,164,004,906 | 32.94 | 47.36 | 2 | 47.53 |
| 安聯 | 12,775,472,416 | 18,731,485,965 | 32.95 | 46.62 | 5 | |
| 保德信 | 9,403,481,285 | 13,894,678,959 | 33.92 | 47.76 | 1 | |
| 統一 | 12,635,490,783 | 18,507,216,180 | 32.67 | 46.47 | 6 | |
| 國泰 | 10,445,956,159 | 15,147,531,539 | 31.90 | 45.01 | 7 | |
| 復華 | 7,235,716,436 | 10,650,250,672 | 33.32 | 47.19 | 3 | |
| 群益 | 4,439,275,178 | 6,530,986,092 | 33.34 | 47.12 | 4 | |
| 合計 | 65,190,086,308 | 95,626,154,313 | 32.93 | 46.69 | — | |

註：本批次為相對報酬型，以臺灣永續報酬指數為指定指標。

107 年第二次委託經營(續約)

單位：新臺幣元

| 投信名稱 | 委託金額 | 目前淨資產 | 113 年截至 6 月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (113.5.24~113.6.30) | | |
|------|----------------|----------------|--------------------------|-----------------------------|----|--------------|
| | | | | 投資報酬率 (%) | 排名 | 目標報酬率 (%) |
| 安聯 | 11,613,817,760 | 12,662,271,957 | 9.03 | 9.03 | 1 | 0.63 |
| 施羅德 | 11,400,361,947 | 12,331,258,703 | 8.17 | 8.17 | 4 | |
| 統一 | 11,638,402,860 | 12,499,990,383 | 7.40 | 7.40 | 5 | |
| 野村 | 18,601,693,072 | 20,175,770,433 | 8.46 | 8.46 | 2 | |
| 國泰 | 19,457,627,824 | 21,052,720,497 | 8.20 | 8.20 | 3 | |
| 復華 | 9,724,896,734 | 10,296,741,434 | 5.88 | 5.88 | 6 | |
| 合計 | 82,436,800,197 | 89,018,753,407 | 7.98 | 7.98 | — | |

註：本批次為絕對報酬型，契約目標報酬率係以臺灣證交所公告之最近 5 年年底股票集中市場平均殖利率加計 250 個基本點為基準。

109 年第一次委託經營

單位：新臺幣元

| 投信 名稱 | 委託金額 | 目前淨資產 | 113 年截至 6 月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (110.5.13~113.6.30) | | |
|----------|----------------|----------------|--------------------------|-----------------------------|----|--------------|
| | | | | 投資報酬率 (%) | 排名 | 目標報酬率 (%) |
| 台新 | 8,000,000,000 | 11,088,762,262 | 19.12 | 38.61 | 3 | 18.12 |
| 安聯 | 8,000,000,000 | 10,977,631,570 | 22.44 | 37.22 | 4 | |
| 保德信 | 8,000,000,000 | 9,999,520,879 | 15.77 | 24.99 | 5 | |
| 國泰 | 8,000,000,000 | 12,126,145,755 | 28.04 | 51.58 | 1 | |
| 野村 | 8,000,000,000 | 11,116,391,711 | 24.39 | 38.95 | 2 | |
| 合計 | 40,000,000,000 | 55,308,452,177 | 22.04 | 38.27 | — | |

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

109 年第二次委託經營（相對報酬）

單位：新臺幣元

| 投信 名稱 | 委託金額 | 目前淨資產 | 113 年截至 6 月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (111.5.13~113.6.30) | | |
|----------|----------------|----------------|--------------------------|-----------------------------|----|--------------|
| | | | | 投資報酬率 (%) | 排名 | 指標報酬率 (%) |
| 安聯 | 3,000,000,000 | 5,189,372,546 | 11.22 | 66.86 | 3 | 78.48 |
| 保德信 | 3,000,000,000 | 5,240,781,421 | 10.72 | 69.85 | 2 | |
| 野村 | 3,000,000,000 | 5,374,419,501 | 12.67 | 70.36 | 1 | |
| 國泰 | 3,000,000,000 | 5,205,023,884 | 11.38 | 66.59 | 4 | |
| 富邦 | 3,000,000,000 | 5,134,914,544 | 11.38 | 63.22 | 5 | |
| 合計 | 15,000,000,000 | 26,144,511,896 | 11.48 | 67.38 | — | |

註：本批次為相對報酬型，以臺灣企業社會責任中小型報酬指數為指定指標。

110 年第一次委託經營

單位：新臺幣元

| 投信名稱 | 委託金額 | 目前淨資產 | 113 年截至 6 月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (110.12.15~113.6.30) | | |
|------|----------------|----------------|--------------------------|------------------------------|----|--------------|
| | | | | 投資報酬率 (%) | 排名 | 目標報酬率 (%) |
| 安聯 | 6,000,000,000 | 8,140,060,484 | 24.83 | 32.33 | 3 | 15.86 |
| 保德信 | 6,000,000,000 | 7,681,398,010 | 8.42 | 24.30 | 5 | |
| 國泰 | 6,000,000,000 | 8,292,120,224 | 24.45 | 35.89 | 1 | |
| 第一金 | 6,000,000,000 | 7,284,460,449 | 10.38 | 17.31 | 6 | |
| 野村 | 6,000,000,000 | 7,930,626,931 | 24.40 | 27.09 | 4 | |
| 富邦 | 6,000,000,000 | 8,319,202,236 | 26.77 | 33.44 | 2 | |
| 合計 | 36,000,000,000 | 47,647,868,334 | 19.70 | 28.39 | — | |

註：本批次為絕對報酬型，契約目標報酬率係以臺灣證交所公告之最近 5 年年底股票集中市場平均殖利率加計 250 個基本點為基準。

111 年第一次委託經營

單位：新臺幣元

| 投信名稱 | 委託金額 | 目前淨資產 | 113 年截至 6 月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (112.10.5~113.6.30) | | |
|------|----------------|----------------|--------------------------|-----------------------------|----|--------------|
| | | | | 投資報酬率 (%) | 排名 | 指標報酬率 (%) |
| 安聯 | 2,000,000,000 | 2,395,559,039 | 17.12 | 19.78 | 4 | 4.58 |
| 施羅德 | 2,000,000,000 | 2,566,554,129 | 26.51 | 28.33 | 2 | |
| 國泰 | 2,000,000,000 | 2,703,876,853 | 23.99 | 35.19 | 1 | |
| 第一金 | 2,000,000,000 | 2,293,455,730 | 10.21 | 14.67 | 7 | |
| 野村 | 2,000,000,000 | 2,479,273,075 | 23.31 | 23.96 | 3 | |
| 華南永昌 | 2,000,000,000 | 2,389,259,783 | 12.97 | 19.46 | 5 | |
| 滙豐 | 2,000,000,000 | 2,367,523,385 | 13.38 | 18.38 | 6 | |
| 合計 | 14,000,000,000 | 17,195,501,994 | 18.19 | 22.83 | — | |

註：本批次為絕對報酬型，契約目標報酬率係以臺灣證交所公告之最近 5 年年底股票集中市場平均殖利率加計 250 個基本點為基準。

2. 舊制勞工退休基金

國內 98 年第二次委託經營(續約 4)

單位：新臺幣元

| 投信 名稱 | 委託金額 | 目前淨資產 | 113 年截至 6 月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (111.1.28~113.6.30) | | |
|----------|----------------|----------------|--------------------------|-----------------------------|----|--------------|
| | | | | 投資報酬率 (%) | 排名 | 目標報酬率 (%) |
| 富邦 | 12,256,867,963 | 15,877,123,633 | 26.23 | 29.54 | 2 | 14.76 |
| 統一 | 10,364,185,361 | 13,707,945,568 | 17.72 | 32.26 | 1 | |
| 合計 | 22,621,053,324 | 29,585,069,201 | 22.14 | 30.79 | — | |

註：本批次為絕對報酬型，契約目標報酬率係以臺灣證交所公告之最近 4 年年底股票集中市場平均殖利率加計 250 個基本點為基準。

國內 101 年第一次委託經營(相對報酬)(續約 2)

單位：新臺幣元

| 投信 名稱 | 委託金額 | 目前淨資產 | 113 年截至 6 月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (109.11.2~113.6.30) | | |
|----------|---------------|---------------|--------------------------|-----------------------------|----|--------------|
| | | | | 投資報酬率 (%) | 排名 | 指標報酬率 (%) |
| 滙豐 | 3,685,000,000 | 8,516,802,770 | 27.67 | 96.12 | — | 106.95 |

註：本批次為相對報酬型，以臺灣加權股價報酬指數為指定指標。

國內 101 年第二次委託經營(續約 3)

單位：新臺幣元

| 投信 名稱 | 委託金額 | 目前淨資產 | 113 年截至 6 月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (113.05.04~113.6.30) | | |
|----------|----------------|----------------|--------------------------|------------------------------|----|--------------|
| | | | | 投資報酬率 (%) | 排名 | 目標報酬率 (%) |
| 野村 | 27,357,530,009 | 30,979,939,067 | 13.24 | 13.24 | — | 0.97 |

註：本批次為絕對報酬型，契約目標報酬率係以臺灣證交所公告之最近 5 年年底股票集中市場平均殖利率加計 250 個基本點為基準。

國內 104 年第一次委託經營(續約 2)

單位：新臺幣元

| 投信 名稱 | 委託金額 | 目前淨資產 | 113 年截至 6 月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (112. 4. 6~113. 6. 30) | | |
|----------|---------------|----------------|--------------------------|--------------------------------|----|--------------|
| | | | | 投資報酬率 (%) | 排名 | 目標報酬率 (%) |
| 復華 | 4,800,107,976 | 6,302,052,488 | 18.32 | 31.29 | 1 | 7.76 |
| 安聯 | 3,601,947,821 | 4,567,359,067 | 17.66 | 26.80 | 2 | |
| 合計 | 8,402,055,797 | 10,869,411,555 | 18.04 | 29.37 | — | |

註：本批次為絕對報酬型，契約目標報酬率係以臺灣證交所公告之最近 5 年年底股票集中市場平均殖利率加計 250 個基本點為基準。

國內 106 年第一次委託經營(續約)

單位：新臺幣元

| 投信 名稱 | 委託金額 | 目前淨資產 | 113 年截至 6 月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (112. 2. 7~113. 6. 30) | | |
|----------|----------------|----------------|--------------------------|--------------------------------|----|--------------|
| | | | | 投資報酬率 (%) | 排名 | 目標報酬率 (%) |
| 安聯 | 14,089,937,312 | 20,560,715,205 | 24.89 | 45.92 | 1 | 8.77 |
| 國泰 | 6,319,107,110 | 8,238,167,452 | 16.31 | 30.37 | 2 | |
| 群益 | 6,384,957,618 | 8,222,747,528 | 10.86 | 28.78 | 3 | |
| 滙豐 | 7,097,524,598 | 8,994,390,924 | 13.78 | 26.73 | 4 | |
| 合計 | 33,891,526,638 | 46,016,021,109 | 18.39 | 35.77 | — | |

註：本批次為絕對報酬型，112. 2. 7 加碼安聯 30 億元，契約目標報酬率係以臺灣證交所公告之最近 5 年年底股票集中市場平均殖利率加計 250 個基本點為基準。

國內 109 年第二次委託經營

單位：新臺幣元

| 投信 名稱 | 委託金額 | 目前淨資產 | 113 年截至 6 月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (111. 5. 13~113. 6. 30) | | |
|----------|---------------|---------------|--------------------------|---------------------------------|----|--------------|
| | | | | 投資報酬率 (%) | 排名 | 指標報酬率 (%) |
| 安聯 | 1,000,000,000 | 1,729,949,832 | 11.22 | 66.92 | 3 | 78.48 |
| 保德信 | 1,000,000,000 | 1,747,028,250 | 10.72 | 69.85 | 2 | |
| 野村 | 1,000,000,000 | 1,791,587,193 | 12.67 | 70.37 | 1 | |
| 國泰 | 1,000,000,000 | 1,735,158,336 | 11.38 | 66.64 | 4 | |
| 富邦 | 1,000,000,000 | 1,711,647,664 | 11.38 | 63.32 | 5 | |
| 合計 | 5,000,000,000 | 8,715,371,275 | 11.48 | 67.43 | — | |

註：本批次為相對報酬型，以臺灣企業社會責任中小型報酬指數為指定指標。

國內 111 年第一次委託經營

單位：新臺幣元

| 投信 名稱 | 委託金額 | 目前淨資產 | 113 年截至 6 月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (112.10.5~113.6.30) | | |
|----------|---------------|---------------|--------------------------|-----------------------------|----|--------------|
| | | | | 投資報酬率 (%) | 排名 | 目標報酬率 (%) |
| 安聯 | 500,000,000 | 598,561,188 | 17.16 | 19.71 | 4 | 4.58 |
| 施羅德 | 500,000,000 | 641,681,353 | 26.52 | 28.34 | 2 | |
| 國泰 | 500,000,000 | 676,317,395 | 24.07 | 35.26 | 1 | |
| 第一金 | 500,000,000 | 573,377,670 | 10.21 | 14.68 | 7 | |
| 野村 | 500,000,000 | 620,019,666 | 23.37 | 24.00 | 3 | |
| 華南 永昌 | 500,000,000 | 597,547,033 | 13.00 | 19.51 | 5 | |
| 滙豐 | 500,000,000 | 591,886,976 | 13.38 | 18.38 | 6 | |
| 合計 | 3,500,000,000 | 4,299,391,281 | 18.22 | 22.84 | — | |

(二) 113 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 3)

單位：美元

| 受託機構 | 委託金額 | 目前淨資產 | 113年截至6月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (110.6.7~113.6.30) | | |
|-------------|---------------|---------------|-----------------------|----------------------------|----|--------------|
| | | | | 投資報酬率 (%) | 排名 | 指標報酬率 (%) |
| 聯博 | 907,613,021 | 749,339,209 | -3.53 | -17.44 | 2 | -17.67 |
| 富蘭克林 坦伯頓 | 1,251,737,838 | 1,144,046,022 | -3.87 | -13.95 | 1 | |
| 合計 | 2,159,350,859 | 1,893,385,231 | -3.73 | -15.73 | — | |

97-2 全球增值債券型 (續約 3)

單位：美元

| 受託機構 | 委託金額 | 目前淨資產 | 113年截至6月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (111.1.6~113.6.30) | | |
|-------|---------------|---------------|-----------------------|----------------------------|----|--------------|
| | | | | 投資報酬率 (%) | 排名 | 指標報酬率 (%) |
| PIMCO | 2,158,967,886 | 1,926,796,808 | -3.49 | -13.02 | — | -14.57 |

97-2 全球增值股票型 (續約 3)

單位：美元

| 受託機構 | 委託金額 | 目前淨資產 | 113年截至6月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (111.2.6~113.6.30) | | |
|----------|---------------|---------------|-----------------------|----------------------------|----|--------------|
| | | | | 投資報酬率 (%) | 排名 | 指標報酬率 (%) |
| 貝萊德 | 1,734,805,538 | 2,138,198,229 | 14.11 | 23.25 | 1 | 16.53 |
| JPMorgan | 1,485,120,883 | 1,786,726,501 | 11.90 | 20.31 | 2 | |
| 合計 | 3,219,926,421 | 3,924,924,730 | 13.10 | 21.89 | — | |

98-1 亞太（日本除外）主動股票型（續約 3）

單位：美元

| 受託機構 | 委託金額 | 目前淨資產 | 113 年截至 6 月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (111.11.17~113.6.30) | | |
|------|-------------|-------------|--------------------------|------------------------------|----|--------------|
| | | | | 投資報酬率 (%) | 排名 | 指標報酬率 (%) |
| 景順 | 656,507,639 | 777,125,597 | 8.70 | 18.37 | — | 18.19 |

98-1 全球被動股票型（續約 3）

單位：美元

| 受託機構 | 委託金額 | 目前淨資產 | 113 年截至 6 月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (111.12.4~113.6.30) | | |
|------|---------------|---------------|--------------------------|-----------------------------|----|--------------|
| | | | | 投資報酬率 (%) | 排名 | 指標報酬率 (%) |
| 貝萊德 | 1,141,092,316 | 1,472,551,589 | 11.33 | 30.62 | 2 | 30.10 |
| 道富 | 1,513,655,177 | 1,960,897,722 | 11.71 | 31.18 | 1 | |
| 合計 | 2,654,747,493 | 3,433,449,311 | 11.55 | 30.94 | — | |

100-1 全球基本面指數被動股票型（續約 2）

單位：美元

| 受託機構 | 委託金額 | 目前淨資產 | 113 年截至 6 月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (110.7.1~113.6.30) | | |
|------|---------------|---------------|--------------------------|----------------------------|----|--------------|
| | | | | 投資報酬率 (%) | 排名 | 指標報酬率 (%) |
| 道富 | 934,565,605 | 1,124,129,941 | 7.61 | 20.28 | 1 | 18.36 |
| 貝萊德 | 939,726,931 | 1,125,290,626 | 7.15 | 19.75 | 2 | |
| 合計 | 1,874,292,536 | 2,249,420,567 | 7.38 | 20.01 | — | |

100-1 全球不動產有價證券型（續約 2）

單位：美元

| 受託機構 | 委託金額 | 目前淨資產 | 113 年截至 6 月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (111.3.6~113.6.30) | | |
|----------------|---------------|---------------|--------------------------|----------------------------|----|--------------|
| | | | | 投資報酬率 (%) | 排名 | 指標報酬率 (%) |
| Cohen & Steers | 2,485,932,432 | 2,229,309,506 | -2.18 | -11.71 | 1 | -14.68 |
| 景順 | 1,567,127,452 | 1,360,624,775 | -4.52 | -13.89 | 2 | |
| 合計 | 4,053,059,884 | 3,589,934,281 | -3.08 | -12.53 | — | |

101-1 全球新興市場主動債券型 (續約 2)

單位：美元

| 受託機構 | 委託金額 | 目前淨資產 | 113 年截至 6 月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (111. 7. 31~113. 6. 30) | | |
|--------|---------------|---------------|--------------------------|---------------------------------|----|--------------|
| | | | | 投資報酬率 (%) | 排名 | 指標報酬率 (%) |
| Pictet | 618, 843, 493 | 678, 863, 333 | -2. 11 | 10. 21 | — | 10. 98 |

101-1 全球低波動指數被動股票型 (續約 2)

單位：美元

| 受託機構 | 委託金額 | 目前淨資產 | 113 年截至 6 月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (112. 4. 18~113. 6. 30) | | |
|------|------------------|------------------|--------------------------|---------------------------------|----|--------------|
| | | | | 投資報酬率 (%) | 排名 | 指標報酬率 (%) |
| 道富 | 1, 163, 392, 347 | 1, 255, 901, 991 | 5. 04 | 8. 28 | 2 | 7. 72 |
| 貝萊德 | 1, 252, 011, 599 | 1, 348, 257, 924 | 5. 00 | 8. 44 | 1 | |
| 合計 | 2, 415, 403, 946 | 2, 604, 159, 915 | 5. 02 | 8. 36 | — | |

102-1 全球高股利增值股票型 (續約 2)

單位：美元

| 受託機構 | 委託金額 | 目前淨資產 | 113 年截至 6 月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (113. 1. 22~113. 6. 30) | | |
|------|------------------|------------------|--------------------------|---------------------------------|----|--------------|
| | | | | 投資報酬率 (%) | 排名 | 指標報酬率 (%) |
| 瑞萬通博 | 1, 716, 000, 834 | 1, 804, 679, 913 | 5. 17 | 5. 17 | 3 | 5. 58 |
| MFS | 1, 114, 480, 846 | 1, 222, 267, 240 | 9. 67 | 9. 67 | 1 | |
| 威靈頓 | 1, 427, 914, 919 | 1, 509, 956, 052 | 5. 75 | 5. 75 | 2 | |
| 合計 | 4, 258, 396, 599 | 4, 536, 903, 205 | 6. 54 | 6. 54 | — | |

102-1 全球信用主動債券型 (續約 2)

單位：美元

| 受託機構 | 委託金額 | 目前淨資產 | 113 年截至 6 月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (113.4.25~113.6.30) | | |
|------|---------------|---------------|--------------------------|-----------------------------|----|--------------|
| | | | | 投資報酬率 (%) | 排名 | 指標報酬率 (%) |
| RBC | 1,086,559,371 | 1,112,952,826 | 2.43 | 2.43 | 1 | 2.11 |
| 貝萊德 | 670,392,768 | 684,073,957 | 2.04 | 2.04 | 3 | |
| 盧米斯 | 891,561,542 | 910,435,257 | 2.12 | 2.12 | 2 | |
| 合計 | 2,648,513,681 | 2,707,462,040 | 2.23 | 2.23 | — | |

104-1 全球高品質被動股票型 (續約)

單位：美元

| 受託機構 | 委託金額 | 目前淨資產 | 113 年截至 6 月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (109.8.11~113.6.30) | | |
|-------|---------------|---------------|--------------------------|-----------------------------|----|--------------|
| | | | | 投資報酬率 (%) | 排名 | 指標報酬率 (%) |
| 北美信託 | 1,796,617,127 | 2,827,447,381 | 18.85 | 68.34 | 2 | 66.28 |
| LGIM | 1,795,083,447 | 2,820,490,821 | 18.75 | 67.88 | 3 | |
| Geode | 1,775,075,832 | 2,800,880,497 | 18.79 | 68.52 | 1 | |
| 合計 | 5,366,776,406 | 8,448,818,699 | 18.80 | 68.25 | — | |

104-2 全球基礎建設有價證券型 (續約)

單位：美元

| 受託機構 | 委託金額 | 目前淨資產 | 113 年截至 6 月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (109.9.25~113.6.30) | | |
|----------|---------------|---------------|--------------------------|-----------------------------|----|--------------|
| | | | | 投資報酬率 (%) | 排名 | 指標報酬率 (%) |
| Magellan | 1,287,520,518 | 1,550,300,915 | -1.98 | 18.30 | 2 | 26.68 |
| RREEF | 926,848,763 | 1,181,034,266 | 1.16 | 27.42 | 1 | |
| 合計 | 2,214,369,281 | 2,731,335,181 | -0.61 | 22.01 | — | |

104-1 全球主權信用增值債券型 (續約)

單位：美元

| 受託機構 | 委託金額 | 目前淨資產 | 113年截至6月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (109.11.13~113.6.30) | | |
|------------|---------------|---------------|-----------------------|------------------------------|----|--------------|
| | | | | 投資報酬率 (%) | 排名 | 指標報酬率 (%) |
| Brandywine | 821,176,083 | 677,731,296 | -8.07 | -19.08 | 2 | -18.11 |
| 盧米斯 | 471,104,127 | 417,253,918 | -4.88 | -14.50 | 1 | |
| 合計 | 1,292,280,210 | 1,094,985,214 | -6.88 | -17.52 | — | |

105-1 全球多元資產型 (續約)

單位：美元

| 受託機構 | 委託金額 | 目前淨資產 | 113年截至6月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (110.7.20~113.6.30) | | |
|----------|---------------|---------------|-----------------------|-----------------------------|----|-----------------|
| | | | | 投資報酬率 (%) | 排名 | 指標/目標 報酬率(%) |
| Allianz | 678,698,278 | 706,303,683 | 5.52 | 2.76 | 3 | 9.88/24.64 |
| JPMorgan | 1,645,715,430 | 1,699,762,477 | 6.50 | 3.28 | 2 | |
| DWS | 1,025,711,371 | 1,091,516,576 | 2.50 | 6.38 | 1 | |
| 柏瑞 | 765,326,657 | 738,424,395 | 4.04 | -3.52 | 4 | |
| 合計 | 4,115,451,736 | 4,236,007,131 | 4.83 | 2.53 | — | |

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

105-1 亞太混合指數增值股票型 (續約)

單位：美元

| 受託機構 | 委託金額 | 目前淨資產 | 113年截至6月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (110.8.24~113.6.30) | | |
|------|-------------|-------------|-----------------------|-----------------------------|----|--------------|
| | | | | 投資報酬率 (%) | 排名 | 指標報酬率 (%) |
| 貝萊德 | 949,175,052 | 998,207,559 | 6.57 | 5.17 | — | 4.39 |

106-1 全球 ESG 混合指數被動股票型(續約)

單位：美元

| 受託機構 | 委託金額 | 目前淨資產 | 113 年截至 6 月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (111. 6. 22~113. 6. 30) | | |
|------|------------------|------------------|--------------------------|---------------------------------|----|--------------|
| | | | | 投資報酬率 (%) | 排名 | 指標報酬率 (%) |
| 貝萊德 | 601, 552, 002 | 775, 730, 416 | 7. 50 | 31. 13 | 4 | 30. 99 |
| DWS | 648, 715, 051 | 865, 076, 794 | 8. 60 | 33. 65 | 2 | |
| 道富 | 749, 045, 562 | 973, 232, 743 | 8. 63 | 33. 68 | 1 | |
| 北美信託 | 702, 047, 560 | 912, 529, 610 | 8. 21 | 31. 89 | 3 | |
| 合計 | 2, 701, 360, 175 | 3, 526, 569, 563 | 8. 27 | 32. 64 | — | |

106-1 絕對報酬債券型(續約)

單位：美元

| 受託機構 | 委託金額 | 目前淨資產 | 113 年截至 6 月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (111. 7. 25~113. 6. 30) | | |
|------------------|------------------|------------------|--------------------------|---------------------------------|----|-----------------|
| | | | | 投資報酬率 (%) | 排名 | 指標/目標 報酬率(%) |
| American Century | 427, 360, 620 | 461, 763, 005 | 1. 29 | 8. 05 | 3 | 9. 37/14. 21 |
| 富達 | 965, 211, 657 | 1, 114, 228, 772 | 3. 34 | 15. 44 | 1 | |
| TCW | 1, 039, 618, 153 | 1, 132, 317, 567 | 1. 74 | 8. 90 | 2 | |
| 合計 | 2, 432, 190, 430 | 2, 708, 309, 344 | 2. 31 | 11. 40 | — | |

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

107-1 絕對報酬股票型 (續約)

單位：美元

| 受託機構 | 委託金額 | 目前淨資產 | 113年截至6月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (113.1.23~113.6.30) | | |
|------|---------------|---------------|-----------------------|-----------------------------|----|-----------------|
| | | | | 投資報酬率 (%) | 排名 | 指標/目標 報酬率(%) |
| 景順 | 786,698,949 | 861,967,570 | 9.57 | 9.57 | 2 | 2.28/4.47 |
| 威靈頓 | 787,219,463 | 835,247,162 | 6.10 | 6.10 | 4 | |
| CPR | 778,885,217 | 877,752,463 | 12.69 | 12.69 | 1 | |
| 道富 | 706,462,703 | 762,764,108 | 7.97 | 7.97 | 3 | |
| 合計 | 3,059,266,332 | 3,337,731,303 | 9.10 | 9.10 | — | |

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

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 | 113年截至6月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (108.12.18~113.6.30) | | |
|--------|---------------|---------------|-----------------------|------------------------------|----|--------------|
| | | | | 投資報酬率 (%) | 排名 | 指標報酬率 (%) |
| Amundi | 400,000,000 | 491,366,106 | 6.72 | 12.83 | 4 | 16.17 |
| DWS | 400,000,000 | 466,473,344 | 6.60 | 9.50 | 5 | |
| Nomura | 400,000,000 | 547,133,237 | 5.48 | 26.34 | 3 | |
| 荷寶 | 300,000,000 | 461,981,176 | 9.30 | 35.24 | 1 | |
| 道富 | 300,000,000 | 443,094,636 | 7.11 | 28.70 | 2 | |
| 合計 | 1,800,000,000 | 2,410,048,499 | 6.97 | 21.67 | — | |

109-1 全球美元公司增值債券型

單位：美元

| 受託機構 | 委託金額 | 目前淨資產 | 113年截至6月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (110.1.13~113.6.30) | | |
|----------|---------------|---------------|-----------------------|-----------------------------|----|--------------|
| | | | | 投資報酬率 (%) | 排名 | 指標報酬率 (%) |
| DWS | 600,000,000 | 584,386,047 | -0.19 | -8.51 | 4 | -7.62 |
| Insight | 700,000,000 | 702,620,270 | 0.41 | -6.56 | 1 | |
| JPMorgan | 400,000,000 | 376,074,647 | 0.30 | -7.82 | 2 | |
| PIMCO | 480,000,000 | 460,619,796 | 0.17 | -7.91 | 3 | |
| Western | 400,000,000 | 369,915,464 | -0.20 | -9.00 | 5 | |
| 合計 | 2,580,000,000 | 2,493,616,224 | 0.12 | -7.94 | — | |

110-1 全球基礎建設有價證券型

單位：美元

| 受託機構 | 委託金額 | 目前淨資產 | 113年截至6月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (110.9.8~113.6.30) | | |
|-------------|---------------|---------------|-----------------------|----------------------------|----|--------------|
| | | | | 投資報酬率 (%) | 排名 | 指標報酬率 (%) |
| CBRE | 350,000,000 | 350,271,383 | -0.23 | 0.62 | 3 | 2.70 |
| Clearbridge | 450,000,000 | 448,301,774 | -2.13 | 1.77 | 1 | |
| Magellan | 350,000,000 | 339,400,196 | -2.41 | -4.49 | 4 | |
| RREEF | 350,000,000 | 354,013,264 | 3.57 | 1.48 | 2 | |
| 合計 | 1,500,000,000 | 1,491,986,617 | -0.45 | -0.18 | — | |

110-1 全球多元資產型

單位：美元

| 受託機構 | 委託金額 | 目前淨資產 | 113年截至6月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (110.10.15~113.6.30) | | |
|---------------|---------------|---------------|-----------------------|------------------------------|----|-----------------|
| | | | | 投資報酬率 (%) | 排名 | 指標/目標 報酬率(%) |
| 富達 | 400,000,000 | 385,357,512 | 6.99 | -4.05 | 5 | 9.87/23.44 |
| JPMorgan | 400,000,000 | 406,182,854 | 6.48 | 1.36 | 4 | |
| Ninety One | 400,000,000 | 416,469,455 | 2.70 | 3.57 | 2 | |
| Schroders | 400,000,000 | 418,325,014 | 6.23 | 4.15 | 1 | |
| T. Rowe Price | 400,000,000 | 416,319,393 | 6.59 | 2.86 | 3 | |
| 合計 | 2,000,000,000 | 2,042,654,228 | 5.75 | 1.58 | — | |

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

111-1 全球氣候變遷增值股票型

單位：美元

| 受託機構 | 委託金額 | 目前淨資產 | 113年截至6月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (112.4.28~113.6.30) | | |
|-----------|---------------|---------------|-----------------------|-----------------------------|----|--------------|
| | | | | 投資報酬率 (%) | 排名 | 指標報酬率 (%) |
| 匯豐 | 200,000,000 | 246,317,363 | 12.14 | 26.37 | 3 | 25.47 |
| LGIM | 200,000,000 | 244,782,949 | 10.98 | 25.11 | 4 | |
| 摩根士坦利 | 200,000,000 | 241,746,362 | 11.15 | 22.84 | 5 | |
| Schroders | 200,000,000 | 250,876,304 | 13.98 | 29.71 | 2 | |
| 威靈頓 | 200,000,000 | 252,937,470 | 14.52 | 30.14 | 1 | |
| 合計 | 1,000,000,000 | 1,236,660,448 | 12.56 | 26.83 | — | |

111-2 絕對報酬債券型

單位：美元

| 受託機構 | 委託金額 | 目前淨資產 | 113年截至6月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (112.7.19~113.6.30) | | |
|---------------|---------------|---------------|-----------------------|-----------------------------|----|-----------------|
| | | | | 投資報酬率 (%) | 排名 | 指標/目標 報酬率(%) |
| 盧米斯 | 400,000,000 | 423,217,200 | 2.56 | 7.17 | 2 | 5.04/7.43 |
| Ninety One | 400,000,000 | 425,105,677 | 3.04 | 6.69 | 3 | |
| PIMCO | 400,000,000 | 422,911,066 | 1.97 | 5.91 | 4 | |
| PGIM | 400,000,000 | 421,812,872 | 3.79 | 7.77 | 1 | |
| T. Rowe Price | 400,000,000 | 402,525,393 | 1.32 | 1.34 | 6 | |
| 威靈頓 | 400,000,000 | 412,766,944 | 2.56 | 4.74 | 5 | |
| 合計 | 2,400,000,000 | 2,508,339,152 | 2.54 | 5.62 | — | |

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

112-1 全球被動股票型

單位：美元

| 受託機構 | 委託金額 | 目前淨資產 | 113年截至6月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (113.6.27~113.6.30) | | |
|--------|-------------|-------------|-----------------------|-----------------------------|----|--------------|
| | | | | 投資報酬率 (%) | 排名 | 指標報酬率 (%) |
| Amundi | 100,000,000 | 99,783,659 | -0.22 | -0.22 | 2 | -0.19 |
| LGIM | 100,000,000 | 99,768,185 | -0.23 | -0.23 | 4 | |
| 道富 | 100,000,000 | 99,784,380 | -0.22 | -0.22 | 1 | |
| 北美信託 | 100,000,000 | 99,771,184 | -0.23 | -0.23 | 3 | |
| 合計 | 400,000,000 | 399,107,408 | -0.22 | -0.22 | — | |

2. 舊制勞工退休基金

96 國際平衡型(續約 4)

單位：美元

| 受託機構 | 委託金額 | 目前淨資產 | 113 年截至 6 月 累積投資報酬率(%) | 委任迄今 (113. 6. 24~113. 6. 30) | | |
|------|---------------|---------------|---------------------------|---------------------------------|----|--------------|
| | | | | 投資報酬率 (%) | 排名 | 指標報酬率 (%) |
| 富達 | 753, 144, 454 | 751, 093, 345 | -0.27 | -0.27 | — | -0.13 |

97-1 全球增值債券型(續約 3)

單位：美元

| 受託機構 | 委託金額 | 目前淨資產 | 113 年截至 6 月 累積投資報酬率(%) | 委任迄今 (111. 1. 6~113. 6. 30) | | |
|-------|------------------|------------------|---------------------------|--------------------------------|----|--------------|
| | | | | 投資報酬率 (%) | 排名 | 指標報酬率 (%) |
| PIMCO | 1, 003, 724, 736 | 874, 592, 482 | -3.29 | -12.87 | 1 | -14.57 |
| 盧米斯 | 1, 018, 693, 762 | 877, 787, 276 | -3.78 | -14.93 | 2 | |
| 合計 | 2, 022, 418, 498 | 1, 752, 379, 758 | -3.53 | -13.87 | — | |

97-1 全球增值股票型(續約 3)

單位：美元

| 受託機構 | 委託金額 | 目前淨資產 | 113 年截至 6 月 累積投資報酬率(%) | 委任迄今 (111. 2. 6~113. 6. 30) | | |
|------|------------------|------------------|---------------------------|--------------------------------|----|--------------|
| | | | | 投資報酬率 (%) | 排名 | 指標報酬率 (%) |
| 貝萊德 | 1, 156, 987, 544 | 1, 426, 407, 646 | 14.11 | 23.29 | — | 16.53 |

98-1 亞太(日本除外)主動股票型(續約 3)

單位：美元

| 受託機構 | 委託金額 | 目前淨資產 | 113 年截至 6 月 累積投資報酬率(%) | 委任迄今 (111. 11. 17~113. 6. 30) | | |
|------|---------------|---------------|---------------------------|----------------------------------|----|--------------|
| | | | | 投資報酬率 (%) | 排名 | 指標報酬率 (%) |
| 景順 | 231, 124, 998 | 277, 921, 432 | 8.37 | 17.90 | — | 18.19 |

100-1 全球基本面指數被動股票型(續約 2)

單位：美元

| 受託機構 | 委託金額 | 目前淨資產 | 113 年截至 6 月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (111. 3. 6~113. 6. 30) | | |
|--------|------------------|------------------|--------------------------|--------------------------------|----|--------------|
| | | | | 投資報酬率 (%) | 排名 | 指標報酬率 (%) |
| 貝萊德 | 304, 997, 166 | 369, 519, 605 | 7. 13 | 21. 16 | 3 | 19. 82 |
| 道富 | 360, 436, 214 | 438, 739, 800 | 7. 58 | 21. 72 | 1 | |
| 瑞銀 | 308, 879, 836 | 375, 251, 766 | 7. 21 | 21. 49 | 2 | |
| Nomura | 360, 147, 608 | 435, 753, 938 | 7. 03 | 20. 99 | 4 | |
| 合計 | 1, 334, 460, 824 | 1, 619, 265, 109 | 7. 24 | 21. 34 | — | |

101-1 全球低波動指數被動股票型(續約 2)

單位：美元

| 受託機構 | 委託金額 | 目前淨資產 | 113 年截至 6 月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (112. 4. 18~113. 6. 30) | | |
|------|---------------|---------------|--------------------------|---------------------------------|----|--------------|
| | | | | 投資報酬率 (%) | 排名 | 指標報酬率 (%) |
| 貝萊德 | 751, 993, 706 | 816, 045, 136 | 5. 04 | 8. 52 | — | 7. 72 |

102-1 年全球高股利增值股票型(續約 2)

單位：美元

| 受託機構 | 委託金額 | 目前淨資產 | 113 年截至 6 月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (113. 1. 22~113. 6. 30) | | |
|------|------------------|------------------|--------------------------|---------------------------------|----|--------------|
| | | | | 投資報酬率 (%) | 排名 | 指標報酬率 (%) |
| 瑞萬通博 | 414, 056, 068 | 435, 535, 219 | 5. 19 | 5. 19 | 3 | 5. 58 |
| MFS | 315, 296, 707 | 345, 858, 156 | 9. 69 | 9. 69 | 1 | |
| 威靈頓 | 704, 502, 354 | 744, 958, 767 | 5. 74 | 5. 74 | 2 | |
| 合計 | 1, 433, 855, 129 | 1, 526, 352, 142 | 6. 45 | 6. 45 | — | |

102-2 全球基礎建設有價證券型(續約 2)

單位：美元

| 受託機構 | 委託金額 | 目前淨資產 | 113 年截至 6 月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (113. 5. 29~113. 6. 30) | | |
|--------|---------------|---------------|--------------------------|---------------------------------|----|--------------|
| | | | | 投資報酬率 (%) | 排名 | 指標報酬率 (%) |
| Lazard | 954, 418, 976 | 925, 986, 364 | -2. 98 | -2. 98 | — | -0. 36 |

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 | 113年截至6月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (108.8.27~113.6.30) | | |
|-----------|-------------|-------------|-----------------------|-----------------------------|----|--------------|
| | | | | 投資報酬率 (%) | 排名 | 指標報酬率 (%) |
| 信安環球 | 610,886,182 | 634,725,365 | -2.73 | 0.51 | 2 | -4.59 |
| Macquarie | 126,937,100 | 129,773,740 | -3.52 | 2.23 | 1 | |
| 合計 | 737,823,282 | 764,499,105 | -2.86 | 0.87 | — | |

105-1 全球多元資產型 (續約)

單位：美元

| 受託機構 | 委託金額 | 目前淨資產 | 113年截至6月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (110.7.20~113.6.30) | | |
|---------|---------------|---------------|-----------------------|-----------------------------|----|-----------------|
| | | | | 投資報酬率 (%) | 排名 | 指標/目標 報酬率(%) |
| Allianz | 155,447,975 | 159,990,728 | 5.51 | 2.92 | 3 | 9.88/24.64 |
| 摩根 | 594,592,070 | 616,746,685 | 6.57 | 3.73 | 2 | |
| DWS | 311,387,682 | 331,411,353 | 2.48 | 6.43 | 1 | |
| 柏瑞 | 254,823,294 | 245,716,797 | 4.03 | -3.57 | 4 | |
| 合計 | 1,316,251,021 | 1,353,865,563 | 4.95 | 2.86 | — | |

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

106-1 全球 ESG 混合指數被動股票型 (續約)

單位：美元

| 受託機構 | 委託金額 | 目前淨資產 | 113年截至6月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (111.6.22~113.6.30) | | |
|------|-------------|-------------|-----------------------|-----------------------------|----|--------------|
| | | | | 投資報酬率 (%) | 排名 | 指標報酬率 (%) |
| 貝萊德 | 127,303,524 | 166,592,128 | 7.46 | 30.86 | 4 | 30.99 |
| DWS | 147,528,441 | 197,060,872 | 8.60 | 33.57 | 2 | |
| 道富 | 157,982,595 | 211,148,257 | 8.56 | 33.65 | 1 | |
| 北美信託 | 158,484,700 | 208,775,820 | 8.22 | 31.73 | 3 | |
| 合計 | 591,299,260 | 783,577,077 | 8.24 | 32.52 | — | |

106-1 絕對報酬債券型(續約)

單位:美元

| 受託機構 | 委託金額 | 目前淨資產 | 113年截至6月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (111.7.25~113.6.30) | | |
|------------------|-------------|---------------|-----------------------|-----------------------------|----|-----------------|
| | | | | 投資報酬率 (%) | 排名 | 指標/目標 報酬率(%) |
| American Century | 319,635,794 | 345,208,478 | 1.24 | 8.00 | 3 | 9.37/14.21 |
| 富達 | 299,785,344 | 347,777,595 | 3.48 | 16.01 | 1 | |
| TCW | 328,000,470 | 358,102,611 | 1.90 | 9.18 | 2 | |
| 合計 | 947,421,608 | 1,051,088,684 | 2.19 | 10.94 | — | |

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

107-1 絕對報酬股票型(續約)

單位:美元

| 受託機構 | 委託金額 | 目前淨資產 | 113年截至6月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (113.1.23~113.6.30) | | |
|------|-------------|-------------|-----------------------|-----------------------------|----|-----------------|
| | | | | 投資報酬率 (%) | 排名 | 指標/目標 報酬率(%) |
| 景順 | 116,977,839 | 128,174,887 | 9.57 | 9.57 | 2 | 2.28/4.47 |
| 威靈頓 | 107,476,614 | 114,037,716 | 6.10 | 6.10 | 3 | |
| CPR | 115,110,097 | 129,723,129 | 12.69 | 12.69 | 1 | |
| 合計 | 339,564,550 | 371,935,732 | 9.53 | 9.53 | — | |

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

110-1 全球基礎建設有價證券型

單位:美元

| 受託機構 | 委託金額 | 目前淨資產 | 113年截至6月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (110.9.8~113.6.30) | | |
|-------------|-------------|-------------|-----------------------|----------------------------|----|--------------|
| | | | | 投資報酬率 (%) | 排名 | 指標報酬率 (%) |
| CBRE | 60,000,000 | 59,806,200 | -0.05 | 0.86 | 3 | 2.70 |
| ClearBridge | 60,000,000 | 60,144,732 | -1.20 | 2.86 | 1 | |
| Magellan | 30,000,000 | 28,813,383 | -2.44 | -3.96 | 4 | |
| RREEF | 60,000,000 | 60,549,217 | 3.60 | 2.13 | 2 | |
| 合計 | 210,000,000 | 209,313,532 | 0.08 | 0.59 | — | |

(二)113 年度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)

113年6月30日

1. 避險：

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

2. 投資：無

(二)舊制勞工退休基金自營部位

(依交易目的)

113年6月30日

1. 避險：

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

2. 投資：無

七、勞工退休基金財務收支表

(一)新制勞工退休基金

單位：新臺幣元

| | 餘絀 | 收入 | 支出 |
|---------|-----------------|-----------------|---------------|
| 113年6月份 | 128,026,848,864 | 137,422,291,166 | 9,395,442,302 |

(二)舊制勞工退休基金

單位：新臺幣元

| | 餘絀 | 收入 | 支出 |
|---------|----------------|----------------|---------------|
| 113年6月份 | 29,746,912,966 | 34,434,314,063 | 4,687,401,097 |

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

| 113年6月份 | | 單位：新臺幣元 |
|---------|-----------------|---------------|
| 項 目 | 金 額 | |
| 現金收入 | 190,453,202,877 | |
| 現金支出 | 186,278,491,125 | |
| 現金增(減)數 | | 4,174,711,752 |

(二)舊制勞工退休基金

| 113年6月份 | | 單位：新臺幣元 |
|---------|----------------|---------|
| 項 目 | 金 額 | |
| 現金收入 | 19,105,276,884 | |
| 現金支出 | 19,105,172,426 | |
| 現金增(減)數 | | 104,458 |