

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(105年7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	3.50%	0.83%	7.75%	5.59%	9.78%
舊制基金	3.48%				

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。

(二) 近一年(104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	-0.09%	1.38%	-10.41%	-2.36%	-3.15%
舊制基金	-0.58%				

(三) 近三年(102~104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	3.64%	1.48%	2.69%	7.69%	-1.74%
舊制基金	4.35%				

(四) 近五年(100~104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	2.85%	1.41%	-1.46%	6.09%	0.90%
舊制基金	2.88%				

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 105 年 7 月底止基金規模與收益		
基金運用規模		1 兆 6,060 億 278 萬元
105 年截至 7 月底止 運用總損益及評價後報酬率	自行運用	112 億 2,936 萬元 1.51%
	委託經營	434 億 2,673 萬元 5.32%
	合 計	546 億 5,609 萬元 3.50%

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÷105 年之日平均餘額）列示。

註 3：105 年 7 月之保證收益率為 1.1408%。

2. 舊制勞工退休基金

至 105 年 7 月底止基金規模與收益		
基金運用規模		7,964 億 2,611 萬元
105 年截至 7 月底止 運用總損益及評價後報酬率	自行運用	110 億 6,545 萬元 2.93%
	委託經營	126 億 3,707 萬元 4.17%
	合 計	237 億 252 萬元 3.48%

註：評價後報酬率係以當期報酬率（即收益÷105 年之日平均餘額）列示。

(二) 資產配置

1. 新制勞工退休基金

截至 105 年 7 月底

單位：新台幣元

項 目	餘 額	占基金運用比例(%)
自行運用	791,200,962,793	49.27
轉存金融機構	339,237,975,789	21.12
短期票券	54,577,407,036	3.40
公債、公司債、金融債券及特別股	163,046,614,837	10.15
貨幣型基金	2,321,294,127	0.15
股票及受益憑證投資(含期貨)	57,745,400,364	3.60
國外投資	174,272,270,640	10.85
固定收益	134,432,196,929	8.37
權益證券	25,315,353,559	1.58
另類投資	14,524,720,152	0.90
委託經營	814,801,812,214	50.73
國內委託經營	223,587,750,019	13.92
國外委託經營	591,214,062,195	36.81
固定收益	171,261,998,124	10.66
權益證券	287,456,281,027	17.90
另類投資	132,495,783,044	8.25
合 計	1,606,002,775,007	100.00

2. 舊制勞工退休基金

截至 105 年 7 月底

單位：新台幣元

項 目	餘 額	占基金運用比例(%)
自行運用	486,910,101,453	61.14
轉存金融機構	168,198,293,180	21.12
短期票券	32,188,191,145	4.04
公債、金融債券、公司債及證券化商品	95,038,871,614	11.93
貨幣型基金	10,838,466,585	1.36
股票及受益憑證投資(含期貨)	61,076,735,222	7.67
國外投資	119,569,543,707	15.02
固定收益	85,142,387,342	10.69
權益證券	27,766,311,314	3.49
另類投資	6,660,845,051	0.84
委託經營	309,516,008,606	38.86
國內委託經營	93,480,340,624	11.73
國外委託經營	216,035,667,982	27.13
固定收益	62,736,049,037	7.88
權益證券	122,856,992,780	15.43
另類投資	30,442,626,165	3.82
合 計	796,426,110,059	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 105 年 7 月底

單位：新台幣元

項 目	金 額	占基金運用比例(%)
自行運用	791,200,962,793	49.27
委託經營	814,801,812,214	50.73

2. 舊制勞工退休基金

截至 105 年 7 月底

單位：新台幣元

項 目	金 額	占基金運用比例(%)
自行運用	486,910,101,453	61.14
委託經營	309,516,008,606	38.86

(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 105 年 7 月底

單位：新台幣元

項 目	金 額	占基金運用比例 (%)
國內投資	840,516,442,172	52.34
國外投資	765,486,332,835	47.66

2. 舊制勞工退休基金

截至 105 年 7 月底

單位：新台幣元

項 目	金 額	占基金運用比例 (%)
國內投資	460,820,898,369	57.85
國外投資	335,605,211,690	42.15

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 105 年 7 月底

項 目	收益率 (%)
國內權益證券	12.45

2. 舊制勞工退休基金

截至 105 年 7 月底

項 目	收益率 (%)
國內權益證券	15.00

(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 105 年 7 月底

單位：新台幣元

項 目	金 額	比 例 (%)
國內權益證券	57,745,400,364	3.60

2. 舊制勞工退休基金

截至 105 年 7 月底

單位：新台幣元

項 目	金 額	比 例 (%)
國內權益證券	61,076,735,222	7.67

註：不含貨幣型基金

四、基金國內委外投資概況表

(一)基金國內委外投資績效、績效指標及排名表

1. 新制勞工退休基金

96 年第一次委託經營 (續約 2)

單位：新台幣元

投信 名稱	委託金額	目前淨資產	105 年截至 7 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (102.9.27~105.7.31)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤 報酬率(%)
野村	7,804,845,205	9,789,663,213	7.41	25.43	—	9.77

97 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	105 年截至 7 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (103.1.20~105.7.31)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤 報酬率(%)
野村	5,783,138,827	7,073,547,522	7.53	22.31	—	4.52

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	105 年截至 7 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (104.7.14~105.7.31)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤 報酬率(%)
野村	10,576,888,916	10,631,946,366	7.33	0.52	2	-0.55
保德信	4,365,128,502	4,507,169,044	7.91	3.25	1	
合計	14,942,017,418	15,139,115,410	7.50	1.32	—	

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	105 年截至 7 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (103.12.1~105.7.31)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤 報酬率(%)
國泰	6,366,621,977	6,848,003,066	4.14	7.56	—	-2.21

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	105 年截至 7 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (104.7.15~105.7.31)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤/指標 報酬率(%)
復華	14,358,076,699	14,584,417,297	7.00	1.58	2	-0.63/ 2.39
滙豐中華	15,278,501,877	15,551,693,174	6.72	1.79	1	
合計	29,636,578,576	30,136,110,471	6.86	1.69	—	

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	105 年截至 7 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (104.8.10~105.7.31)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤 報酬率(%)
復華	17,101,520,990	17,695,997,727	5.28	3.48	—	6.42

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	105 年截至 7 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (105.4.18~105.7.31)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤/指標 報酬率(%)
國泰	5,387,135,656	5,755,995,968	6.85	6.85	2	3.26/ 6.18
滙豐中華	10,927,481,593	11,699,234,080	7.06	7.06	1	
合計	16,314,617,249	17,455,230,048	6.99	6.99	—	

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	105 年截至 7 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (105.7.18~105.7.31)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤 報酬率(%)
野村	6,850,998,495	6,863,211,872	0.18	0.18	2	0.39
統一	7,019,680,328	7,097,476,108	1.11	1.11	1	
合計	13,870,678,823	13,960,687,980	0.65	0.65	—	

102 年第一次委託經營第一期

單位：新台幣元

投信 名稱	委託金額	目前淨資產	105 年截至 7 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (102.6.7~105.7.31)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤 報酬率(%)
國泰	2,500,000,000	2,943,329,803	4.91	17.73	2	10.97
統一	2,500,000,000	2,880,907,433	1.79	15.24	3	
復華	2,500,000,000	3,050,498,028	6.06	22.02	1	
安聯	2,500,000,000	2,822,052,075	3.25	12.88	4	
合計	10,000,000,000	11,696,787,339	4.01	16.97	—	

102 年第一次委託經營第二期

單位：新台幣元

投信 名稱	委託金額	目前淨資產	105 年截至 7 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (102.11.22~105.7.31)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤 報酬率(%)
國泰	2,500,000,000	2,714,751,936	4.71	8.59	3	10.93
統一	2,500,000,000	2,689,352,909	1.66	7.57	4	
復華	2,500,000,000	2,980,764,809	6.03	19.23	1	
安聯	2,500,000,000	2,771,915,923	4.07	10.88	2	
摩根	2,500,000,000	2,682,997,344	5.57	7.32	5	
合計	12,500,000,000	13,839,782,921	4.42	10.72	—	

102 年第二次委託經營(相對報酬)

單位：新台幣元

投信 名稱	委託金額	目前淨資產	105 年截至 7 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (103.1.20~105.7.31)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤/指標 報酬率(%)
保德信	5,000,000,000	5,391,526,467	9.73	12.93	5	4.52/ 15.14
統一	5,000,000,000	5,433,084,777	7.48	13.67	3	
富邦	5,000,000,000	5,223,191,918	5.43	8.64	6	
復華	5,000,000,000	5,692,473,851	11.35	20.95	1	
群益	5,000,000,000	5,307,854,343	6.45	13.27	4	
滙豐中華	5,000,000,000	5,563,156,820	11.64	16.64	2	
合計	30,000,000,000	32,611,288,176	8.69	14.36	—	

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

103 年第一次委託經營第一期

單位：新台幣元

投信 名稱	委託金額	目前淨資產	105 年截至 7 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (103.8.11~105.7.31)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤 報酬率(%)
國泰	7,000,000,000	7,373,342,214	7.01	5.33	1	-1.12
統一	7,000,000,000	6,652,462,787	2.53	-4.96	3	
復華	7,000,000,000	6,850,799,568	5.45	-2.13	2	
合計	21,000,000,000	20,876,604,569	5.04	-0.59	—	

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	105 年截至 7 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (103.10.8~105.7.31)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤 報酬率(%)
台新	7,000,000,000	7,234,193,592	5.75	3.35	1	-0.62
保德信	7,000,000,000	7,150,167,412	5.53	2.15	2	
群益	7,000,000,000	6,880,669,957	5.54	-1.70	3	
合計	21,000,000,000	21,265,030,961	5.61	1.26	—	

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	105 年截至 7 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (104.3.31~105.7.31)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤 報酬率(%)
永豐	2,500,000,000	2,490,785,098	4.83	-0.37	4	-5.64
國泰	2,500,000,000	2,491,147,385	3.30	-0.35	3	
統一	2,500,000,000	2,501,985,001	5.55	0.08	2	
復華	2,500,000,000	2,400,456,672	6.55	-3.98	6	
滙豐中華	2,500,000,000	2,528,265,587	6.91	1.13	1	
安聯	2,500,000,000	2,449,886,216	4.62	-2.00	5	
合計	15,000,000,000	14,862,525,959	5.28	-0.92	—	

2. 舊制勞工退休基金

國內 98 年第二次委託經營(續 2)

單位：新台幣元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	105 年截至 7 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (105.1.26~105.7.31)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤 報酬率(%)
富邦	4,927,262,338	5,164,452,859	4.81	4.81	2	13.81
統一	5,071,927,246	5,386,968,773	6.21	6.21	1	
合計	9,999,189,584	10,551,421,632	5.52	5.52	—	

國內 100 年第一次委託經營(續)

單位：新台幣元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	105 年截至 7 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (104.3.17~105.7.31)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤 報酬率(%)
群益	6,094,525,480	5,583,939,742	3.88	-8.38	3	-5.56
復華	6,134,978,456	6,054,964,030	4.90	-1.30	1	
統一	6,511,946,664	6,215,523,067	3.73	-4.55	2	
合計	18,741,450,600	17,854,426,839	4.17	-4.73	—	

國內 101 年第一次委託經營(相對報酬)

單位：新台幣元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	105 年截至 7 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (101.10.30~105.7.31)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤/指標 報酬率(%)
匯豐中華	2,163,012,619	2,706,327,046	10.92	42.37	—	26.69/43.68

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)

單位：新台幣元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	105 年截至 7 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (105.5.3~105.7.31)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤 報酬率(%)
野村	16,650,814,154	17,588,258,719	5.63	5.63	—	7.24

國內 102 年第一次委託經營第一期

單位：新台幣元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	105 年截至 7 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (102.6.7~105.7.31)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤 報酬率(%)
安聯	2,500,000,000	2,822,339,373	3.25	12.89	4	10.97
復華	5,000,000,000	5,596,913,234	5.44	21.32	1	
國泰	2,500,000,000	2,943,618,226	4.91	17.74	2	
統一	2,500,000,000	2,881,240,517	1.79	15.25	3	
合計	12,500,000,000	14,244,111,350	3.85	16.79	—	

國內 102 年第一次委託經營第二期

單位：新台幣元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	105 年截至 7 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (102.11.22~105.7.31)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤 報酬率(%)
安聯	2,500,000,000	2,772,181,635	4.07	10.89	2	10.93
復華	5,000,000,000	5,527,023,007	5.41	18.55	1	
國泰	2,500,000,000	2,714,978,065	4.71	8.60	3	
摩根	2,500,000,000	2,683,280,446	5.57	7.33	5	
統一	2,500,000,000	2,689,637,365	1.66	7.59	4	
合計	15,000,000,000	16,387,100,518	4.19	10.48	—	

國內 102 年第一次委託經營 A 帳戶

單位：新台幣元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	105 年截至 7 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (104.3.16~105.7.31)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤 報酬率(%)
統一	5,118,273,278	4,849,415,995	2.98	-5.25	-	-6.21

國內 104 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	105 年截至 7 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (104.3.31~105.7.31)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤 報酬率(%)
永豐	2,500,000,000	2,490,866,874	4.83	-0.37	4	-5.64
國泰	2,500,000,000	2,491,233,147	3.30	-0.35	3	
統一	2,500,000,000	2,502,080,190	5.55	0.08	2	
復華	2,500,000,000	2,400,508,166	6.55	-3.98	6	
匯豐中華	2,500,000,000	2,528,387,698	6.91	1.14	1	
安聯	2,500,000,000	2,449,980,972	4.62	-2.00	5	
合計	15,000,000,000	14,863,057,047	5.28	-0.91	—	

(二) 105 年 7 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 全球債券型 (續約 2)

單位：美元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	105 年截至 7 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (105.6.6~105.7.31)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
聯博	793,101,125	812,671,390	2.47	2.47	1	2.00
坦伯頓	744,405,663	758,349,305	1.87	1.87	2	
合計	1,537,506,788	1,571,020,695	2.18	2.18	—	

97-2 全球增值債券型 (續約)

單位：美元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	105年截至7月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (102.1.7~105.7.31)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
太平洋	615,416,988	658,913,287	9.85	7.07	1	5.36
高盛	479,694,715	493,245,266	9.23	2.82	2	
合計	1,095,111,703	1,152,158,553	9.59	5.21	—	

97-2 全球增值股票型 (續約)

單位：美元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	105年截至7月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (102.2.5~105.7.31)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
貝萊德	584,277,868	714,262,903	3.78	32.96	1	26.46
摩根	587,857,352	751,713,380	4.66	27.87	2	
合計	1,172,135,220	1,465,976,283	4.23	29.81	—	

98-1 亞太 (日本除外) 股票型 (續約)

單位：美元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	105年截至7月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (102.11.18~105.7.31)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
景順	571,501,358	587,076,312	10.16	4.79	—	0.21

98-1 全球被動股票型 (續約)

單位：美元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	105年截至7月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (102.12.2~105.7.31)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
貝萊德	299,329,552	329,689,137	5.84	10.14	1	9.24
道富	449,680,272	486,524,828	5.71	10.11	2	
合計	749,009,824	816,213,965	5.76	10.12	—	

99-1 全球新興市場股票型 (續約)

單位：美元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	105年截至7月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (103.8.25~105.7.31)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
摩根士丹利	403,049,882	347,350,696	10.38	-13.82	2	-14.91
瑞萬通博	716,993,858	687,541,669	12.48	-4.11	1	
合計	1,120,043,740	1,034,892,365	11.77	-7.60	—	

100-1 全球基本面指數被動股票型 (續約)

單位：美元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	105年截至7月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (105.7.1~105.7.31)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
道富	562,180,574	587,163,290	4.44	4.44	2	4.58
貝萊德	566,301,910	592,163,285	4.57	4.57	1	
合計	1,128,482,484	1,179,326,576	4.51	4.51	—	

100-1 全球不動產股票型

單位：美元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	105年截至7月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (101.3.6~105.7.31)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
Cohen & Steers	750,000,000	994,968,011	10.83	58.05	1	48.77
景順	800,000,000	1,045,570,398	12.09	52.68	2	
合計	1,550,000,000	2,040,538,409	11.47	55.03	—	

101-1 全球新興市場債券型

單位：美元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	105年截至7月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (101.7.31~105.7.31)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
Ashmore	300,000,000	287,938,130	9.70	-0.87	1	0.48
Bluebay	300,000,000	276,717,373	8.30	-5.75	3	
實港	300,000,000	275,054,821	9.13	-6.58	4	
Pictet	300,000,000	290,829,250	9.21	-1.17	2	
合計	1,200,000,000	1,130,539,573	9.09	-3.60	—	

101-1 全球低波動指數被動股票型

單位：美元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	105年截至7月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (102.4.18~105.7.31)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
道富	500,000,000	598,442,708	11.47	19.41	1	18.42
貝萊德	500,000,000	595,633,515	11.41	18.83	2	
合計	1,000,000,000	1,194,076,223	11.44	19.12	—	

102-1 全球高股利增值股票型

單位：美元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	105年截至7月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (103.1.22~105.7.31)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
瑞萬通博	500,000,000	593,938,524	7.46	22.19	1	5.63
MFS	500,000,000	506,927,533	5.36	4.88	3	
威靈頓	500,000,000	530,832,794	8.19	10.37	2	
合計	1,500,000,000	1,631,698,851	7.03	12.50	—	

102-1 全球信用債券型

單位：美元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	105年截至7月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (103.4.25~105.7.31)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
Bluebay	400,000,000	407,434,239	8.94	2.10	3	3.87
貝萊德	400,000,000	415,348,605	8.45	4.03	2	
盧米斯	400,000,000	417,698,790	9.23	4.64	1	
合計	1,200,000,000	1,240,481,634	8.87	3.59	—	

104-1 全球高品質被動股票型

單位：美元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	105年截至7月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (104.8.11~105.7.31)		
				投資 報酬率(%)	排名	大盤/指標 報酬率(%)
北美信託	500,000,000	536,882,328	6.84	4.80	1	4.71
LGIM	500,000,000	536,995,764	6.91	4.63	3	
Geode	500,000,000	536,702,135	6.84	4.66	2	
合計	1,500,000,000	1,610,580,227	6.86	4.69	—	

104-2 全球基礎建設股票型

單位：美元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	105年截至7月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (104.9.25~105.7.31)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
Cohen & Steers	350,000,000	382,711,345	14.96	9.20	4	13.95
麥格理	350,000,000	389,462,053	16.74	13.20	3	
Magellan	350,000,000	379,534,486	11.71	16.50	1	
RREEF	350,000,000	391,285,986	18.35	16.06	2	
合計	1,400,000,000	1,542,993,870	15.44	13.79	—	

104-1 全球主權信用增值債券型

單位：美元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	105年截至7月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (104.11.13~105.7.31)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
NNIP	100,000,000	108,640,196	9.67	8.64	3	9.89
Brandywine	100,000,000	112,200,873	13.08	12.20	1	
盧米斯	100,000,000	109,170,287	10.00	9.17	2	
合計	300,000,000	330,011,357	10.92	10.00	—	

105-1 全球多元資產型

單位：美元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	105年截至7月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (105.7.20~105.7.31)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標報酬率 (%)
安聯	225,000,000	226,096,382	0.49	0.49	1	0.02
摩根	225,000,000	226,039,237	0.46	0.46	2	
德意志	225,000,000	225,380,225	0.17	0.17	3	
柏瑞	225,000,000	225,001,845	0.001	0.001	4	
合計	900,000,000	902,517,690	0.28	0.28	—	

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

投信名稱	委託金額	目前淨資產	105年截至7月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (104.6.22~105.7.31)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
富達國際	583,555,210	614,066,341	8.17	5.23	—	2.94

97 年續約國外委託經營(全球增值債券型)

單位：美元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	105 年截至 7 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (102.1.6~105.7.31)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
太平洋	931,384,466	982,672,123	10.12	6.68	1	5.36
盧米斯	712,476,555	743,627,770	9.67	4.37	2	
合計	1,643,861,021	1,726,299,893	9.92	5.56	—	

97 年續約國外委託經營(全球增值股票型)

單位：美元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	105 年截至 7 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (102.2.5~105.7.31)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
貝萊德	484,953,368	615,350,995	3.73	33.00	—	26.46

98 年續約國外委託經營(亞太股票型)

單位：美元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	105 年截至 7 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (102.11.17~105.7.31)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
景順	262,187,756	276,370,815	10.33	5.41	—	0.21

100 年國外委託經營(全球基本面指數股票型)

單位：美元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	105 年截至 7 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (101.3.6~105.7.31)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
貝萊德	300,000,000	361,691,616	5.75	34.74	4	34.00
道富	300,000,000	364,676,085	5.75	36.12	1	
瑞銀	300,000,000	362,881,366	6.04	35.41	3	
野村	300,000,000	363,824,652	6.09	35.81	2	
合計	1,200,000,000	1,453,073,719	5.91	35.52	—	

101 年國外委託經營(全球低波動指數股票型)

單位：美元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	105 年截至 7 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (102.6.13~105.7.31)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
貝萊德	500,000,000	578,224,657	11.33	23.33	—	22.68

102 年國外委託經營(全球高股利增值股票型)

單位：美元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	105 年截至 7 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (103.1.22~105.7.31)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
瑞萬通博	150,000,000	182,056,156	7.45	22.25	1	5.63
MFS	200,000,000	206,833,895	5.03	4.71	3	
威靈頓	400,000,000	423,032,911	7.99	10.29	2	
合計	750,000,000	811,922,962	6.87	12.44	—	

102 年國外委託經營(全球基礎建設有價證券型)

單位：美元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	105 年截至 7 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (103.5.29~105.7.31)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
Lazard	300,000,000	325,046,895	12.13	11.93	1	2.77
Cohen & Steers	100,000,000	98,492,174	15.09	-0.56	2	
合計	400,000,000	423,539,069	12.94	5.32	—	

102 年國外委託經營(全球不動產有價證券型)

單位：美元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	105 年截至 7 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (103.8.27~105.7.31)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
PGI	150,000,000	171,390,904	10.73	14.97	1	14.78
AMP	100,000,000	110,272,412	7.04	9.80	2	
合計	250,000,000	281,663,316	9.26	12.77	—	

105 年國外委託經營(全球多元資產型)

單位：美元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	105 年截至 7 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (105.7.20~105.7.31)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
安聯	75,000,000	75,377,244	0.50	0.50	1	0.02
摩根	75,000,000	75,341,057	0.45	0.45	2	
德意志	75,000,000	75,145,370	0.19	0.19	3	
柏瑞	75,000,000	75,002,953	0.004	0.004	4	
合計	300,000,000	300,866,624	0.29	0.29	—	

(二)105年7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)

105年7月31日

1. 避險：

種類	避險比例
權益證券避險	0%
匯率避險	6.60%

2. 投資：無

(二)舊制勞工退休基金自營部位

(依交易目的)

105年7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	營業收入	營業支出
105年7月	23,299,690,450	35,058,586,079	11,758,895,629

註：上述金額係依權責基礎填列。

(二)舊制勞工退休基金

單位：新台幣元

	餘絀	營業收入	營業支出
105年7月	11,210,722,721	14,548,825,188	3,338,102,467

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

105年7月份

單位：新台幣元

項 目	金 額
基金收入	335,641,405,456
基金支出	335,171,124,103
現金增(減)數	470,281,353

註：本表採現金基礎。

(二)舊制勞工退休基金

105年7月份

單位：新台幣元

項 目	金 額
基金收入	75,999,389,455
基金支出	75,999,142,955
現金增(減)數	246,500

註：本表採現金基礎。