

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	2.02%	0.86%	3.94%	1.23%	8.96%
舊制基金	1.86%				

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。

(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

單位：新台幣萬元

至 105 年 6 月底止基金規模與收益		
基金運用規模		1 兆 5,923 億 7,916 萬元
105 年截至 6 月底止 運用總損益及評價後報酬率	自行運用	71 億 9,395 萬元 0.98%
	委託經營	242 億 978 萬元 2.96%
	合 計	314 億 373 萬元 2.02%

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 6 月之保證收益率為 1.1408%。

2. 舊制勞工退休基金

單位：新台幣萬元

至 105 年 6 月底止基金規模與收益		
基金運用規模		7,858 億 3,179 萬元
105 年截至 6 月底止 運用總損益及評價後報酬率	自行運用	61 億 2,131 萬元 1.65%
	委託經營	63 億 7,049 萬元 2.12%
	合 計	124 億 9,180 萬元 1.86%

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 6 月底

單位：新台幣元

項 目	餘 額	占基金運用比例(%)
自行運用	788,501,414,349	49.52
轉存金融機構	312,489,990,785	19.63
短期票券	61,938,493,282	3.89
公債、公司債、金融債券及特別股	164,153,340,587	10.30
貨幣型基金	3,753,598,081	0.24
股票及受益憑證投資(含期貨)	64,280,233,460	4.04
國外投資	181,885,758,154	11.42
固定收益	143,015,837,166	8.98
權益證券	25,425,309,818	1.60
另類投資	13,444,611,170	0.84
委託經營	803,877,748,561	50.48
國內委託經營	236,491,977,028	14.85
國外委託經營	567,385,771,533	35.63
固定收益	172,128,163,693	10.81
權益證券	291,086,488,921	18.28
另類投資	104,171,118,919	6.54
合 計	1,592,379,162,910	100.00

2. 舊制勞工退休基金

截至 105 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	490,969,584,190	62.48
轉存金融機構	163,937,296,209	20.86
短期票券	33,717,158,614	4.29
公債、金融債券、公司債及證券化商品	91,560,854,646	11.65
貨幣型基金	15,496,922,897	1.97
股票及受益憑證投資(含期貨)	66,647,548,596	8.49
國外投資	119,609,803,228	15.22
固定收益	83,508,395,242	10.63
權益證券	29,249,681,417	3.72
另類投資	6,851,726,569	0.87
委託經營	294,862,203,376	37.52
國內委託經營	93,011,855,128	11.84
國外委託經營	201,850,348,248	25.68
固定收益	57,011,027,082	7.25
權益證券	123,777,254,374	15.75
另類投資	21,062,066,792	2.68
合 計	785,831,787,566	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 6 月底

單位：新台幣元

項 目	金 額	占基金運用比例(%)
自行運用	788,501,414,349	49.52
委託經營	803,877,748,561	50.48

2. 舊制勞工退休基金

截至 105 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	490,969,584,190	62.48
委託經營	294,862,203,376	37.52

(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 6 月底

單位：新台幣元

項 目	金 額	占基金運用比例 (%)
國內投資	843,107,633,223	52.95
國外投資	749,271,529,687	47.05

2. 舊制勞工退休基金

截至 105 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	464,371,636,089	59.10
國外投資	321,460,151,477	40.90

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 6 月底

項 目	收益率 (%)
國內權益證券	7.56

2. 舊制勞工退休基金

截至 105 年 6 月底

項 目	收益率 (%)
國內權益證券	9.03

(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 6 月底 單位：新台幣元

項 目	金 額	比 例 (%)
國內權益證券	64,280,233,460	4.04

2. 舊制勞工退休基金

截至 105 年 6 月底 單位：新台幣元

項 目	金 額	比 例 (%)
國內權益證券	66,647,548,596	8.49

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 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (102.9.27~105.6.30)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤 報酬率(%)
野村	7,804,845,205	9,566,496,529	4.96	22.57	—	5.89

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 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (103.1.20~105.6.30)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤 報酬率(%)
野村	5,783,138,827	6,910,239,764	5.05	19.49	—	0.82

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 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (104.7.14~105.6.30)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤 報酬率(%)
野村	10,576,888,916	10,387,865,853	4.87	-1.79	2	-4.07
保德信	4,365,128,502	4,384,891,680	4.98	0.45	1	
合計	14,942,017,418	14,772,757,533	4.90	-1.13	—	

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 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (103.12.1~105.6.30)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤 報酬率(%)
國泰	6,366,621,977	6,753,379,336	2.70	6.07	—	-5.67

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 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (104.7.15~105.6.30)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤/指標 報酬率(%)
復華	14,358,076,699	13,985,726,312	2.61	-2.59	1	-4.15/ -2.23
滙豐中華	15,278,501,877	14,823,622,462	1.73	-2.98	2	
合計	29,636,578,576	28,809,348,774	2.15	-2.79	—	

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 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (104.8.10~105.6.30)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤 報酬率(%)
復華	17,101,520,990	17,135,202,036	1.94	0.20	—	2.66

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 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (105.4.18~105.6.30)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤/指標 報酬率(%)
國泰	5,387,135,656	5,449,266,131	1.15	1.15	2	-0.39/ 0.71
滙豐中華	10,927,481,593	11,142,089,172	1.96	1.96	1	
合計	16,314,617,249	16,591,355,303	1.70	1.70	—	

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

101 年第二次委託經營

單位：新台幣元

投信 名稱	委託金額	目前淨資產	105 年截至 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (101.7.16~105.6.30)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤 報酬率(%)
野村	5,000,000,000	6,706,323,727	4.98	34.13	2	21.99
國泰	5,000,000,000	6,061,987,935	1.83	21.24	3	
統一	5,000,000,000	6,945,817,216	0.04	38.92	1	
富邦	5,000,000,000	5,896,608,739	0.21	17.93	4	
合計	20,000,000,000	25,610,737,617	1.76	28.05	—	

101 年第二次委託經營 A 帳戶

單位：新台幣元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	105 年截至 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (103.12.1~105.6.30)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤 報酬率(%)
統一	5,199,929,852	5,162,372,431	0.47	-0.72	—	-5.67

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 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (102.6.7~105.6.30)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤 報酬率(%)
國泰	2,500,000,000	2,886,901,004	2.90	15.48	2	7.05
統一	2,500,000,000	2,809,404,973	-0.74	12.38	3	
復華	2,500,000,000	2,969,203,288	3.23	18.77	1	
安聯	2,500,000,000	2,763,856,660	1.12	10.55	4	
合計	10,000,000,000	11,429,365,925	1.64	14.29	—	

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 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (102.11.22~105.6.30)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤 報酬率(%)
國泰	2,500,000,000	2,663,022,586	2.72	6.52	3	7.00
統一	2,500,000,000	2,623,229,751	-0.84	4.93	4	
復華	2,500,000,000	2,901,927,164	3.22	16.08	1	
安聯	2,500,000,000	2,700,407,185	1.39	8.02	2	
摩根	2,500,000,000	2,573,010,196	1.24	2.92	5	
合計	12,500,000,000	13,461,596,882	1.57	7.69	—	

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 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (103.1.20~105.6.30)		
				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	5,111,567,105	4.03	7.07	5	0.82/ 9.21
統一	5,000,000,000	5,183,989,138	2.55	8.46	3	
富邦	5,000,000,000	5,005,134,863	1.03	4.10	6	
復華	5,000,000,000	5,403,727,497	5.70	14.81	1	
群益	5,000,000,000	5,075,230,151	1.78	8.31	4	
滙豐中華	5,000,000,000	5,282,621,643	6.01	10.76	2	
合計	30,000,000,000	31,062,270,397	3.53	8.92	—	

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 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (103.8.11~105.6.30)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤 報酬率(%)
國泰	7,000,000,000	7,216,836,686	4.74	3.10	1	-4.62
統一	7,000,000,000	6,466,620,326	-0.33	-7.62	3	
復華	7,000,000,000	6,626,602,053	2.00	-5.33	2	
合計	21,000,000,000	20,310,059,065	2.19	-3.29	—	

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 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (103.10.8~105.6.30)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤 報酬率(%)
台新	7,000,000,000	7,020,550,852	2.63	0.29	1	-4.14
保德信	7,000,000,000	6,936,535,264	2.38	-0.91	2	
群益	7,000,000,000	6,620,681,724	1.55	-5.42	3	
合計	21,000,000,000	20,577,767,840	2.19	-2.01	—	

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 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (104.3.31~105.6.30)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤 報酬率(%)
永豐	2,500,000,000	2,433,554,453	2.42	-2.66	3	-8.98
國泰	2,500,000,000	2,474,739,669	2.62	-1.01	1	
統一	2,500,000,000	2,410,176,964	1.67	-3.59	4	
復華	2,500,000,000	2,339,684,295	3.85	-6.41	6	
滙豐中華	2,500,000,000	2,456,507,208	3.87	-1.74	2	
安聯	2,500,000,000	2,386,230,442	1.90	-4.55	5	
合計	15,000,000,000	14,500,893,031	2.72	-3.33	—	

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 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (105.1.26~105.6.30)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤 報酬率(%)
富邦	4,927,262,338	5,032,368,332	2.13	2.13	2	9.78
統一	5,071,927,246	5,242,836,354	3.37	3.37	1	
合計	9,999,189,584	10,275,204,686	2.76	2.76	—	

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 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (104.3.17~105.6.30)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤 報酬率(%)
群益	6,094,525,480	5,401,276,512	0.48	-11.37	3	-8.90
復華	6,134,978,456	5,866,433,425	1.63	-4.38	1	
統一	6,511,946,664	6,052,295,818	1.01	-7.06	2	
合計	18,741,450,600	17,320,007,755	1.05	-7.58	—	

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 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (101.10.30~105.6.30)		
				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	2,578,181,101	5.67	35.63	—	22.21/36.28

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 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (105.5.3~105.6.30)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤 報酬率(%)
野村	16,650,814,154	17,196,723,560	3.28	3.28	—	3.45

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 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (102.6.7~105.6.30)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤 報酬率(%)
安聯	2,500,000,000	2,764,136,283	1.12	10.57	4	7.05
復華	2,500,000,000	5,470,321,298	3.06	18.57	1	
國泰	2,500,000,000	2,887,181,911	2.90	15.49	2	
統一	2,500,000,000	2,809,730,034	-0.73	12.39	3	
合計	10,000,000,000	13,931,369,526	1.57	14.23	—	

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 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (102.11.22~105.6.30)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤 報酬率(%)
安聯	2,500,000,000	2,700,664,239	1.39	8.03	2	7.00
復華	2,500,000,000	5,402,991,790	3.05	15.89	1	
國泰	2,500,000,000	2,663,242,512	2.72	6.53	3	
摩根	2,500,000,000	2,573,282,079	1.25	2.93	5	
統一	2,500,000,000	2,623,506,385	-0.83	4.94	4	
合計	12,500,000,000	15,963,687,005	1.49	7.63	—	

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 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (104.3.16~105.6.30)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤 報酬率(%)
統一	5,118,273,278	4,728,990,389	0.42	-7.61	-	-9.53

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 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (104.3.31~105.6.30)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤 報酬率(%)
永豐	2,500,000,000	2,433,629,107	2.43	-2.65	3	-8.98
國泰	2,500,000,000	2,474,818,161	2.62	-1.01	1	
統一	2,500,000,000	2,410,264,338	1.67	-3.59	4	
復華	2,500,000,000	2,339,728,629	3.85	-6.41	6	
匯豐中華	2,500,000,000	2,456,622,644	3.88	-1.74	2	
安聯	2,500,000,000	2,386,318,497	1.90	-4.55	5	
合計	15,000,000,000	14,501,381,376	2.72	-3.32	—	

(二) 105 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 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (105.6.6~105.6.30)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
聯博	793,101,125	804,261,913	1.41	1.41	1	1.24
坦伯頓	744,405,663	751,316,467	0.93	0.93	2	
合計	1,537,506,788	1,555,578,380	1.18	1.18	—	

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6月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (102.1.7~105.6.30)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
太平洋	615,416,988	651,202,507	8.57	5.81	1	4.57
高盛	479,694,715	487,581,394	7.97	1.64	2	
合計	1,095,111,703	1,138,783,901	8.31	3.99	—	

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6月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (102.2.5~105.6.30)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
貝萊德	584,277,868	681,965,065	-0.92	26.95	1	21.23
摩根	587,857,352	719,929,780	0.24	22.47	2	
合計	1,172,135,220	1,401,894,845	-0.33	24.14	—	

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6月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (102.11.18~105.6.30)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
景順	571,501,358	557,530,648	4.62	-0.48	—	-5.08

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6月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (102.12.2~105.6.30)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
貝萊德	299,329,552	316,054,569	1.46	5.59	1	4.72
道富	449,680,272	466,510,211	1.36	5.58	2	
合計	749,009,824	782,564,780	1.40	5.58	—	

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6月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (103.8.25~105.6.30)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
摩根士丹利	403,049,882	331,011,946	5.19	-17.87	2	-18.91
瑞萬通博	716,993,858	667,203,035	9.15	-6.94	1	
合計	1,120,043,740	998,214,981	7.80	-10.88	—	

100-1 全球基本面指數被動股票型

單位：美元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	105年截至6月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (100.7.1~105.6.30、 100.7.13~105.6.30)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
道富	500,000,000	562,180,574	1.63	24.14	2	21.72
貝萊德	500,000,000	566,301,910	1.09	25.97	1	25.18
合計	1,000,000,000	1,128,482,484	1.36	25.06	—	—

註：其中道富委託日 100.7.1，貝萊德委託日 100.7.13。

100-1 全球不動產股票型

單位：美元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	105年截至6月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (101.3.6~105.6.30)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
Cohen & Steers	750,000,000	943,001,284	5.04	49.79	1	41.71
景順	800,000,000	994,247,084	6.59	45.19	2	
合計	1,550,000,000	1,937,248,368	5.83	47.18	—	

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6月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (101.7.31~105.6.30)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
Ashmore	300,000,000	285,035,701	8.59	-1.87	1	-0.21
Bluebay	300,000,000	274,209,151	7.32	-6.61	3	
實港	300,000,000	273,218,452	8.40	-7.21	4	
Pictet	300,000,000	288,723,241	8.42	-1.89	2	
合計	1,200,000,000	1,121,186,545	8.19	-4.40	—	

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6月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (102.4.18~105.6.30)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
道富	500,000,000	585,539,361	9.07	16.84	1	15.93
貝萊德	500,000,000	583,201,699	9.08	16.35	2	
合計	1,000,000,000	1,168,741,060	9.08	16.60	—	

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6月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (103.1.22~105.6.30)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
瑞萬通博	500,000,000	576,671,374	4.34	18.63	1	2.87
MFS	500,000,000	493,209,668	2.51	2.04	3	
威靈頓	500,000,000	518,387,908	5.66	7.78	2	
合計	1,500,000,000	1,588,268,950	4.19	9.51	—	

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6月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (103.4.25~105.6.30)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
Bluebay	400,000,000	398,376,218	6.52	-0.17	3	2.25
貝萊德	400,000,000	407,719,703	6.46	2.12	2	
盧米斯	400,000,000	408,475,080	6.82	2.33	1	
合計	1,200,000,000	1,214,571,001	6.60	1.43	—	

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6月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (104.8.11~105.6.30)		
				投資 報酬率(%)	排名	大盤/指標 報酬率(%)
北美信託	500,000,000	512,137,654	1.91	-0.03	1	-0.14
LGIM	500,000,000	512,000,779	1.94	-0.24	3	
Geode	500,000,000	512,072,180	1.94	-0.15	2	
合計	1,500,000,000	1,536,210,613	1.93	-0.14	—	

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6月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (104.9.25~105.6.30)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
Cohen & Steers	350,000,000	377,913,454	13.51	7.83	4	12.67
麥格理	350,000,000	383,054,249	14.82	11.34	3	
Magellan	350,000,000	374,636,654	10.27	14.99	2	
RREEF	350,000,000	388,713,802	17.57	15.29	1	
合計	1,400,000,000	1,524,318,159	14.04	12.41	—	

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6月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (104.11.13~105.6.30)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
NNIP	100,000,000	107,839,360	8.87	7.84	2	8.86
Brandywine	100,000,000	111,009,162	11.88	11.01	1	
盧米斯	100,000,000	107,785,174	8.60	7.79	3	
合計	300,000,000	326,633,696	9.78	8.88	—	

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6月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (104.6.22~105.6.30)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
富達國際	583,555,210	605,212,040	6.61	3.71	—	0.21

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6月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (102.1.6~105.6.30)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
太平洋	731,384,466	770,359,175	8.72	5.33	1	4.57
盧米斯	712,476,555	733,918,129	8.24	3.01	2	
合計	1,443,861,021	1,504,277,304	8.49	4.18	—	

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 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (102.2.5~105.6.30)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
貝萊德	484,953,368	587,729,866	-0.93	27.03	-	21.23

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 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (102.11.17~105.6.30)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
景順	262,187,756	262,320,469	4.72	0.05	-	-5.08

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 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (101.3.6~105.6.30)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
貝萊德	300,000,000	346,009,070	1.16	28.90	4	28.13
道富	300,000,000	349,102,879	1.23	30.30	1	
瑞銀	300,000,000	347,088,520	1.43	29.52	3	
野村	300,000,000	347,930,196	1.46	29.88	2	
合計	1,200,000,000	1,390,130,665	1.32	29.65	—	

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 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (102.6.13~105.6.30)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
貝萊德	500,000,000	565,967,930	8.97	20.71	—	20.11

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 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (103. 1. 22~105. 6. 30)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
瑞萬通博	150,000,000	176,767,662	4.33	18.70	1	2.87
MFS	200,000,000	201,254,598	2.19	1.89	3	
威靈頓	400,000,000	413,153,343	5.47	7.71	2	
合計	750,000,000	791,175,603	4.14	9.56	—	

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 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (103. 5. 29~105. 6. 30)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
Lazard	300,000,000	314,058,891	8.34	8.14	1	1.61
Cohen & Steers	100,000,000	97,250,753	13.64	-1.81	2	
合計	400,000,000	411,309,644	9.68	2.28	—	

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 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (103. 8. 27~105. 6. 30)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
PGI	150,000,000	163,577,394	5.68	9.73	1	9.30
AMP	100,000,000	106,480,495	3.36	6.02	2	
合計	250,000,000	270,057,889	4.76	8.13	—	

(二)105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)

105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	6.39%

2. 投資：無

(二)舊制勞工退休基金自營部位

(依交易目的)

105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	營業收入	營業支出
105年6月	8,227,116,314	20,867,966,722	12,640,850,408

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6月	2,014,669,627	5,346,715,743	3,332,046,116

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6月份

單位：新台幣元

項 目	金 額
基金收入	206,735,486,792
基金支出	255,506,380,088
現金增(減)數	5,229,106,704

註：本表採現金基礎。

(二)舊制勞工退休基金

105年6月份

單位：新台幣元

項 目	金 額
基金收入	72,579,206,124
基金支出	72,578,882,979
現金增(減)數	323,145

註：本表採現金基礎。