

勞工退休基金運用情形

一、勞工退休基金 97 年 1 月迄今整體績效

截至 104 年 2 月底

新制基金	3.3024%
舊制基金	3.0017%

註：舊制基金自 76 年 6 月之績效為 4.9974%

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 104 年 2 月底止基金規模與收益		
基金運用規模		1 兆 3,314 億 2,363 萬元
104 年截至 2 月底止 運用總損益及評價後報酬率	自行運用	19 億 2,785 萬元 0.33%
	委託經營	185 億 7,713 萬元 2.50%
	合計	205 億 498 萬元 1.55%

註 1：評價後報酬率係以當期報酬率（即收益÷104 年之日平均餘額）列示。

註 2：104 年 2 月之保證收益率為 1.3916%。

2. 舊制勞工退休基金

單位：新台幣萬元

至 104 年 2 月底止基金規模與收益		
基金運用規模		6,377 億 4,366 萬元
104 年截至 2 月底止 運用總損益及評價後報酬率	自行運用	45 億 4,650 萬元 1.54%
	委託經營	67 億 7,626 萬元 2.31%
	合計	113 億 2,276 萬元 1.93%

註：評價後報酬率係以當期報酬率（即收益÷104 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 104 年 2 月底

單位：新台幣元

項 目	餘 額	占基金運用比例(%)
自行運用	589,225,537,689	44.26
轉存金融機構	186,969,458,518	14.05
短期票券	45,895,330,774	3.45
公債、公司債及金融債券	183,394,801,804	13.77
貨幣型基金	0	0.00
股票及受益憑證投資(含期貨)	31,432,676,553	2.36
國外投資	141,533,270,040	10.63
固定收益	111,010,612,927	8.34
權益證券	22,176,188,374	1.66
另類投資	8,346,468,739	0.63
委託經營	742,198,093,490	55.74
國內委託經營	266,095,173,415	19.98
國外委託經營	476,102,920,075	35.76
固定收益	172,548,382,811	12.96
權益證券	248,366,879,651	18.66
另類投資	55,187,657,613	4.14
合 計	1,331,423,631,179	100.00

2. 舊制勞工退休基金

截至 104 年 2 月底

單位：新台幣元

項 目	餘 額	占基金運用比例(%)
自行運用	354,604,671,532	55.60
轉存金融機構	114,451,064,374	17.95
短期票券	24,763,886,113	3.88
公債、金融債券、公司債及證券化商品	78,745,832,131	12.35
股票及受益憑證投資(含期貨)	73,590,673,440	11.54
國外投資	63,053,215,474	9.88
固定收益	34,388,877,183	5.39
權益證券	24,573,789,732	3.85
另類投資	4,090,548,559	0.64
委託經營	283,138,992,905	44.40
國內委託經營	117,455,728,990	18.42
國外委託經營	165,683,263,915	25.98
固定收益	55,405,849,272	8.69
權益證券	97,548,901,777	15.29
另類投資	12,728,512,866	2.00
合 計	637,743,664,437	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 104 年 2 月底

單位：新台幣元

項 目	金 額	占基金運用比例 (%)
自行運用	589,225,537,689	44.26
委託經營	742,198,093,490	55.74

2. 舊制勞工退休基金

截至 104 年 2 月底

單位：新台幣元

項 目	金 額	占基金運用比例 (%)
自行運用	354,604,671,532	55.60
委託經營	283,138,992,905	44.40

(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 104 年 2 月底

單位：新台幣元

項 目	金 額	占基金運用比例 (%)
國 內 投 資	713,787,441,064	53.61
國 外 投 資	617,636,190,115	46.39

2. 舊制勞工退休基金

截至 104 年 2 月底

單位：新台幣元

項 目	金 額	占基金運用比例 (%)
國 內 投 資	409,007,185,048	64.13
國 外 投 資	228,736,479,389	35.87

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 104 年 2 月底

項 目	收益率 (%)
國內權益證券	4.54

2. 舊制勞工退休基金

截至 104 年 2 月底

項 目	收益率 (%)
國內權益證券	5.69

(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 104 年 2 月底

單位：新台幣元

項 目	金 額	比 例 (%)
國內權益證券	31,432,676,553	2.36

2. 舊制勞工退休基金

截至 104 年 2 月底

單位：新台幣元

項 目	金 額	比 例 (%)
國內權益證券	73,590,673,440	11.54

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	104 年截至 2 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (102.9.27~104.2.28)		
				投資報酬率 (%)	委託經營排名	大盤報酬率(%)
野村	7,804,845,205	9,611,430,356	3.64	23.15	—	17.56

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	104 年截至 2 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (103.1.20~104.2.28)		
				投資報酬率 (%)	委託經營排名	大盤報酬率(%)
野村	5,783,138,827	6,942,993,116	3.64	20.06	—	11.94

98 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	104 年截至 2 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (101.7.14~104.2.28)		
				投資報酬率 (%)	委託經營排名	大盤報酬率(%)
野村	3,421,364,679	4,688,156,433	3.67	37.03	1	35.44
保德信	3,423,163,553	4,427,228,922	2.40	29.33	2	
合計	6,844,528,232	9,115,385,355	3.05	33.18	—	

98 年第一次委託經營 (續約) A 帳戶

單位：新台幣元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	104 年截至 2 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (103.12.1~104.2.28)		
				投資報酬率 (%)	委託經營排名	大盤報酬率(%)
野村	5,579,000,000	5,791,226,510	3.36	3.80	—	4.73

99 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	104 年截至 2 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (102.3.9~104.2.28)		
				投資報酬率 (%)	委託經營排名	大盤報酬率(%)
保德信	7,790,534,548	9,144,831,620	2.61	17.38	—	20.05

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	104 年截至 2 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (103.12.1~104.2.28)		
				投資報酬率 (%)	委託經營排名	大盤報酬率(%)
國泰	6,366,621,977	6,581,728,225	1.80	3.38	—	4.73

100 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	104 年截至 2 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (100.7.15~104.2.28)		
				投資報 酬率(%)	委託經 營排名	大盤/指 標報酬率 (%)
國泰	5,000,000,000	7,024,854,977	4.97	22.94	4	13.45/ 31.16
富邦	5,000,000,000	6,979,813,019	4.15	25.38	3	
復華	11,294,673,623	14,687,779,724	4.22	27.92	2	
滙豐中華	12,034,391,172	15,706,569,108	4.05	28.06	1	
合計	33,329,064,795	44,399,016,828	4.26	26.07	—	

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 年第二次委託經營第一期

單位：新台幣元

投信 名稱	委託金額	目前淨資產	104 年截至 2 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (100.8.10~104.2.28)		
				投資報 酬率(%)	委託經 營排名	大盤報 酬率(%)
保德信	3,000,000,000	3,769,716,394	2.58	25.66	2	28.41
統一	3,000,000,000	3,568,178,092	1.90	18.94	3	
富邦	3,000,000,000	3,265,920,771	1.31	8.86	5	
復華	3,000,000,000	3,955,294,217	3.83	31.84	1	
摩根	3,000,000,000	3,385,882,906	2.93	12.86	4	
合計	15,000,000,000	17,944,992,380	2.55	19.63	—	

100 年第二次委託經營第二期

單位：新台幣元

投信 名稱	委託金額	目前淨資產	104 年截至 2 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (100.11.23~104.2.28)		
				投資報酬 率(%)	委託經 營排名	大盤報 酬率(%)
保德信	2,000,000,000	2,568,909,357	2.61	28.45	2	37.46
統一	2,000,000,000	2,534,300,825	1.96	26.72	3	
富邦	2,000,000,000	2,323,061,472	1.28	16.15	5	
復華	2,000,000,000	2,813,835,804	3.85	40.69	1	
滙豐中華	2,000,000,000	2,430,512,239	1.67	21.53	4	
摩根	2,000,000,000	2,269,823,901	2.92	13.49	6	
合計	12,000,000,000	14,940,443,598	2.41	24.50	—	

100 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	104 年截至 2 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (102.4.22~104.2.28)		
				投資報酬 率(%)	委託經 營排名	大盤報 酬率(%)
復華	4,511,827,956	5,478,569,543	3.71	21.43	—	21.33

100 年第二次委託經營 B 帳戶

單位：新台幣元

投信 名稱	委託金額	目前淨資產	104 年截至 2 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (103.8.6~104.2.28)		
				投資報酬 率(%)	委託經 營排名	大盤報 酬率(%)
復華	5,480,000,000	5,706,850,848	3.89	4.14	—	5.26

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	104 年截至 2 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (101.4.18~104.2.28)		
				投資報酬率(%)	委託經營排名	大盤/指標報酬率(%)
國泰	4,500,000,000	5,765,201,990	4.16	35.25	2	26.84/ 39.61
滙豐中華	9,546,945,283	11,619,431,472	3.45	35.95	1	
合計	14,046,945,283	17,384,633,462	3.68	35.22	—	

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	104 年截至 2 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (101.7.16~104.2.28)		
				投資報酬率(%)	委託經營排名	大盤報酬率(%)
野村	5,000,000,000	6,737,363,559	3.65	34.75	2	35.44
保德信	5,000,000,000	6,063,075,698	3.48	21.26	6	
國泰	5,000,000,000	6,457,508,604	3.68	29.15	3	
統一	5,000,000,000	7,036,293,518	1.21	40.73	1	
富邦	5,000,000,000	6,239,543,870	3.11	24.79	4	
滙豐中華	5,000,000,000	6,085,646,469	0.89	21.71	5	
合計	30,000,000,000	38,619,431,718	2.65	28.73	—	

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	104 年截至 2 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (103.12.1~104.2.28)		
				投資報酬率(%)	委託經營排名	大盤報酬率(%)
統一	5,199,929,852	5,424,495,916	2.80	4.32	—	4.73

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	104 年截至 2 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (102.6.7~104.2.28)		
				投資報酬 率(%)	委託經 營排名	大盤報 酬率(%)
國泰	2,500,000,000	2,941,884,899	2.95	17.68	2	18.85
統一	2,500,000,000	3,117,826,430	2.87	24.71	1	
富邦	2,500,000,000	2,597,625,638	1.39	3.91	6	
復華	2,500,000,000	2,938,676,552	3.05	17.55	4	
德盛安聯	2,500,000,000	2,939,539,759	3.29	17.58	3	
摩根	2,500,000,000	2,788,138,418	1.93	11.53	5	
合計	15,000,000,000	17,323,691,696	2.61	15.49	—	

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	104 年截至 2 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (102.11.22~104.2.28)		
				投資報酬 率(%)	委託經 營排名	大盤報 酬率(%)
國泰	2,500,000,000	2,715,054,472	3.01	8.60	5	18.80
統一	2,500,000,000	2,916,297,871	2.63	16.65	1	
富邦	2,500,000,000	2,523,043,782	1.34	0.92	6	
復華	2,500,000,000	2,870,797,258	2.97	14.83	2	
德盛安聯	2,500,000,000	2,867,969,597	3.26	14.72	3	
摩根	2,500,000,000	2,722,091,992	1.94	8.88	4	
合計	15,000,000,000	16,615,254,972	2.55	10.77	—	

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	104 年截至 2 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (103.1.20~104.2.28)		
				投資報酬 率(%)	委託經 營排名	大盤/指 標報酬 率(%)
保德信	3,000,000,000	3,433,761,661	3.87	14.46	3	11.94/ 15.37
統一	3,000,000,000	3,398,957,280	2.94	13.30	5	
富邦	3,000,000,000	3,338,494,520	3.56	11.28	6	
復華	3,000,000,000	3,559,516,781	3.81	18.65	1	
群益	3,000,000,000	3,456,741,505	3.96	15.22	2	
滙豐中華	3,000,000,000	3,425,594,730	3.28	14.19	4	
合計	18,000,000,000	20,613,066,477	3.57	14.52	—	

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	104 年截至 2 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (103.8.11~104.2.28)		
				投資報酬 率(%)	委託經 營排名	大盤報 酬率(%)
國泰	7,000,000,000	7,258,069,205	3.26	3.69	1	5.90
統一	7,000,000,000	7,197,497,584	2.72	2.82	3	
復華	7,000,000,000	7,215,550,583	3.79	3.08	2	
合計	21,000,000,000	21,671,117,372	3.25	3.20	—	

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	104 年截至 2 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (103.10.8~104.2.28)		
				投資報酬 率(%)	委託經 營排名	大盤報 酬率(%)
台新	7,000,000,000	7,181,616,579	1.48	2.59	3	6.43
保德信	7,000,000,000	7,265,971,738	2.50	3.80	1	
群益	7,000,000,000	7,194,885,039	2.71	2.78	2	
合計	21,000,000,000	21,642,473,356	2.23	3.06	—	

2. 舊制勞工退休基金

國內 98 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	104 年截至 2 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (102.1.26~104.2.28)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤 報酬率(%)
保德信	3,380,116,383	4,049,050,629	1.73	19.79	3	25.41
富邦	3,208,581,038	3,902,682,483	3.09	21.63	2	
統一	3,514,321,648	4,606,651,324	2.47	31.08	1	
合計	10,103,019,069	12,558,384,436	2.42	24.30	—	

國內 98 年第二次委託經營(續)增額

單位：新台幣元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	104 年截至 2 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (103.10.22~104.2.28)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤 報酬率(%)
統一	3,000,000,000	3,076,164,819	1.23	2.54	—	11.18

國內 100 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	104 年截至 2 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (100.3.17~104.2.28)		
				投資 報酬率(%)	委託 經營 排名	大盤 報酬率(%)
保德信	5,000,000,000	5,591,409,572	1.93	11.83	5	15.59
群益	5,000,000,000	6,120,843,358	3.16	22.42	3	
復華	5,000,000,000	6,123,407,773	3.81	22.47	2	
國泰	5,000,000,000	5,839,702,220	2.26	16.79	4	
統一	5,000,000,000	6,520,068,163	3.20	30.40	1	
合計	25,000,000,000	30,195,431,086	2.89	20.78	—	

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	104 年截至 2 月 累積投資報酬 (%)	委任迄今 (101.10.30~104.2.28)		
				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	2,677,349,478	3.59	40.85	—	35.68/43.96

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

單位：新台幣元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	104 年截至 2 月 累積投資報酬 (%)	委任迄今 (101.4.30~104.2.28)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤 報酬率(%)
保德信	5,000,000,000	5,945,080,076	2.98	18.90	6	28.63
群益	5,000,000,000	6,178,560,055	4.54	23.57	3	
匯豐中華	5,000,000,000	6,133,364,455	1.29	22.67	5	
野村	5,000,000,000	6,891,393,536	3.76	37.83	1	
國泰	5,000,000,000	6,157,404,161	2.48	23.15	4	
統一	5,000,000,000	6,257,962,721	1.93	25.16	2	
合計	30,000,000,000	37,563,765,004	2.84	25.21	—	

國內 101 年第二次委託經營增額

單位：新台幣元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	104 年截至 2 月 累積投資報酬 (%)	委任迄今 (103.10.22~104.2.28)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤 報酬率(%)
野村	5,000,000,000	5,358,936,151	3.50	7.18	1	11.18
統一	5,000,000,000	5,118,992,516	0.76	2.38	2	
合計	10,000,000,000	10,477,928,667	2.14	4.78	—	

國內 102 年第一次委託經營第一期

單位：新台幣元

信名稱	委託金額	目前淨資產	104 年截至 2 月 累積投資報酬 (%)	委任迄今 (102.6.7~104.2.28)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤 報酬率(%)
德盛安聯	2,500,000,000	2,939,692,021	3.29	17.59	3	18.85
復華	2,500,000,000	2,938,857,230	3.06	17.55	4	
國泰	2,500,000,000	2,942,055,598	2.95	17.68	2	
富邦	2,500,000,000	2,597,747,000	1.39	3.91	6	
摩根	2,500,000,000	2,788,303,530	1.93	11.53	5	
統一	2,500,000,000	3,118,027,138	2.87	24.72	1	
合計	15,000,000,000	17,324,682,517	2.61	15.50	—	

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	104 年截至 2 月 累積投資報酬 (%)	委任迄今 (102.11.22~104.2.28)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤 報酬率(%)
德盛安聯	2,500,000,000	2,868,099,829	3.26	14.72	3	18.80
復華	2,500,000,000	2,870,932,956	2.97	14.84	2	
國泰	2,500,000,000	2,715,180,767	3.01	8.61	5	
富邦	2,500,000,000	2,523,172,912	1.34	0.93	6	
摩根	2,500,000,000	2,722,221,392	1.94	8.89	4	
統一	2,500,000,000	2,916,448,540	2.63	16.66	1	
合計	15,000,000,000	16,616,056,396	2.55	10.77	—	

(二) 104 年度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：

投信名稱	懲處資訊
群益投信	新制勞退基金102-2全權委託帳戶從事「非避險」證券相關商品交易，交易分析報告及交易決定書有未載明停損（利）點，與金管會規定不符，裁處糾正。(104/1/9)

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 全球股票型 (續約)

單位：美元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	104年截至2月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (101.5.21~104.2.28)		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率(%)
坦伯頓	500,000,000	747,859,023	3.85	61.04	—	53.75

97-1 全球債券型 (續約)

單位：美元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	104年截至2月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (101.6.4~104.2.28)		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率(%)
聯博	750,000,000	757,029,513	-0.95	0.94	2	-0.10
高盛	400,000,000	392,495,902	-1.27	-1.88	3	
坦伯頓	650,000,000	752,709,753	0.63	15.80	1	
合計	1,800,000,000	1,902,235,168	-0.40	5.68	—	

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	104年截至2月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (102.1.7~104.2.28)		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率(%)
太平洋	615,416,988	616,883,299	0.08	0.24	1	-1.86
高盛	479,694,715	460,738,608	-1.22	-3.95	2	
合計	1,095,111,703	1,077,621,907	-0.48	-1.60	—	

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	104年截至2月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (102.2.5~104.2.28)		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率(%)
貝萊德	584,277,868	740,317,852	4.58	37.81	1	27.47
摩根	587,857,352	761,938,750	3.83	29.61	2	
合計	1,172,135,220	1,502,256,603	4.20	33.03	—	

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	104年截至2月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (102.11.18~104.2.28)		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率(%)
景順	471,501,358	508,627,289	3.69	7.87	—	7.15

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	104年截至2月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (102.12.2~104.2.28)		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率(%)
貝萊德	299,329,552	330,637,444	3.99	10.46	2	10.11
道富	349,680,272	386,563,288	3.89	10.55	1	
合計	649,009,824	717,200,732	3.93	10.51	—	

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	104年截至2月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (103.8.25~104.2.28)		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率(%)
摩根士丹利	403,049,882	373,127,986	4.05	-7.42	2	-7.61
瑞萬通博	716,993,858	706,105,599	6.17	-1.52	1	
合計	1,120,043,740	1,079,233,585	5.43	-3.64	—	

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	104年截至2月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (100.7.1~104.2.28、 100.7.13~104.2.28)		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率(%)
道富	500,000,000	604,964,282	3.38	33.58	2	32.24
貝萊德	500,000,000	614,429,097	3.56	36.68	1	36.00
合計	1,000,000,000	1,219,393,379	3.47	35.13	—	—

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	104年截至2月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (101.3.6~104.2.28)		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率(%)
Cohen & Steers	550,000,000	694,747,980	4.61	43.70	1	37.92
景順	600,000,000	757,921,286	3.73	42.60	2	
EII	400,000,000	520,059,974	4.10	36.65	3	
合計	1,550,000,000	1,972,729,240	4.14	40.89	—	

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	104年截至2月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (101.7.31~104.2.28)		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率(%)
Ashmore	300,000,000	288,647,602	0.57	-0.63	1	0.41
Bluebay	300,000,000	285,956,037	-0.23	-2.61	3	
實港	300,000,000	279,064,183	0.28	-5.22	4	
Pictet	300,000,000	287,304,061	0.23	-2.37	2	
合計	1,200,000,000	1,140,971,883	0.22	-2.71	—	

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	104年截至2月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (102.4.18~104.2.28)		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率(%)
道富	500,000,000	568,110,813	3.72	13.36	1	13.03
貝萊德	500,000,000	566,811,304	3.83	13.08	2	
合計	1,000,000,000	1,134,922,117	3.78	13.22	—	

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	104年截至2月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (103.1.22~104.2.28)		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率(%)
瑞萬通博	500,000,000	553,060,716	6.00	13.78	1	4.79
MFS	500,000,000	510,861,529	3.04	5.69	3	
威靈頓	500,000,000	516,561,772	3.52	7.40	2	
合計	1500,000,000	1,580,484,016	4.22	8.97	—	

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	104年截至2月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (103.4.25~104.2.28)		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率(%)
Bluebay	400,000,000	395,810,315	0.14	-0.81	3	-0.77
貝萊德	400,000,000	396,638,025	0.00	-0.65	2	
盧米斯	400,000,000	397,280,952	0.00	-0.47	1	
合計	1,200,000,000	1,189,729,292	0.05	-0.64	—	

2. 舊制勞工退休基金

96年續約國外委託經營(平衡型)

單位：美元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	104年截至2月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (100.6.21~104.2.28)		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率(%)
富達國際	425,533,349	589,351,660	3.12	36.10	-	33.95

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	104年截至2月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (102.1.6~104.2.28)		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率(%)
太平洋	731,384,466	729,114,790	0.25	-0.31	1	-1.86
盧米斯	712,476,555	695,907,422	-0.68	-2.33	2	
合計	1,443,861,021	1,425,022,212	-0.21	-1.30	—	

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	104 年截至 2 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (102.2.5~104.2.28)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
貝萊德	384,953,368	530,507,347	4.58	37.81	-	27.47

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	104 年截至 2 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (102.11.17~104.2.28)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
景順	262,187,756	284,761,530	3.78	8.61	-	7.15

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	104 年截至 2 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (101.3.6~104.2.28)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
貝萊德	300,000,000	375,034,648	3.54	39.71	3	39.21
道富	300,000,000	376,142,812	3.42	40.40	1	
瑞銀環球	300,000,000	373,845,704	3.45	39.50	4	
野村	300,000,000	375,132,198	3.54	40.03	2	
合計	1,200,000,000	1,500,155,362	3.49	39.91	-	

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	104 年截至 2 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (102.6.13~104.2.28)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
貝萊德	300,000,000	335,832,303	3.82	17.17	—	17.12

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	104 年截至 2 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (103.1.22~104.2.28)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
瑞萬通博	150,000,000	169,528,696	6.01	13.84	1	4.79
MFS	150,000,000	157,424,199	3.05	5.86	3	
威靈頓	150,000,000	159,637,880	3.51	7.53	2	
合計	450,000,000	486,590,775	4.22	9.08	—	

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	104 年截至 2 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (103.5.29~104.2.28)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
Lazard	100,000,000	101,026,341	1.95	1.93	2	1.46
Cohen & Steers	100,000,000	102,124,060	2.27	3.11	1	
合計	200,000,000	203,150,401	2.11	2.52	—	

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	104 年截至 2 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (103.8.27~104.2.28)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
PGI	100,000,000	107,032,165	4.48	6.59	1	5.52
AMP	100,000,000	105,225,156	4.50	4.77	2	
合計	200,000,000	212,257,321	4.49	5.68	—	

(二)104 年度被提前收回之國外委外投資帳戶

基金國外委外投資被提前收回帳戶經理人名單及收回原因

1. 新制勞工退休基金：無
2. 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)

104年2月28日

1. 避險：

種類	避險比例
權益證券避險	0%
匯率避險	9.35%

2. 投資：無

(二)舊制勞工退休基金自營部位

(依交易目的)

104年2月28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
104年2月	18,716,051,342	22,946,921,835	4,230,870,493

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
104年2月	11,571,346,529	11,886,289,462	314,942,933

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

104年2月份

單位：新台幣元

項 目	金 額
基金收入	186,480,704,151
基金支出	183,803,341,665
現金增(減)數	2,677,362,486

註：本表採現金基礎。

(二)舊制勞工退休基金

104年2月份

單位：新台幣元

項 目	金 額
基金收入	20,255,566,437
基金支出	20,250,911,733
現金增(減)數	4,654,704

註：本表採現金基礎。