

勞工退休基金運用情形

*勞工退休基金 97 年 1 月迄今整體績效

截至 103 年 5 月底

新制基金	3.1016%
舊制基金	2.6737%

註：舊制基金自 76 年 6 月迄今之績效為 4.9957%

*基金運用概況表

新制勞工退休基金

1. 基金規模與投資績效

單位：新台幣萬元

至 103 年 5 月底止基金規模與收益		
基金運用規模		1 兆 1,575 億 5,651 萬元
103 年截至 5 月底止 運用總損益及評價後報酬率	自行運用	65 億 162 萬元 1.19%
	委託經營	341 億 1,982 萬元 5.96%
	合計	406 億 2,144 萬元 3.63%

註 1：評價後報酬率係以當期報酬率（即收益÷103 年之日平均餘額）列示。

註 2：103 年 5 月之保證收益率為 1.3916%。

資產配置

截至 103 年 5 月底

單位：新台幣元

項 目	餘 額	占基金運用比例(%)
自行運用	563,928,077,937	48.72
轉存金融機構	224,282,343,825	19.38
短期票券	55,155,325,137	4.77
公債、公司債及金融債券	150,861,998,241	13.03
貨幣型基金	0	0.00
股票及受益憑證投資(含期貨)	10,818,067,893	0.93
國外投資	122,810,342,841	10.61
固定收益	108,007,970,782	9.33
權益證券	9,056,355,954	0.78
另類投資	5,746,016,105	0.50
委託經營	593,628,428,597	51.28
國內委託經營	229,132,013,917	19.79
國外委託經營	364,496,414,680	31.49
固定收益	136,410,563,202	11.78
權益證券	186,925,358,465	16.15
另類投資	41,160,493,013	3.56
合 計	1,157,556,506,534	100.00

舊制勞工退休基金

1. 基金規模與投資績效

單位：新台幣萬元

至 103 年 5 月底止基金規模與收益		
基金運用規模		6,089 億 7,858 萬元
103 年截至 5 月底止 運用總損益及評價後報酬率	自行運用	84 億 2,228 萬元 2.64%
	委託經營	149 億 1,739 萬元 5.67%
	合計	233 億 3,967 萬元 4.01%

註：評價後報酬率係以當期報酬率（即收益÷103 年之日平均餘額）列示

資產配置

截至 103 年 5 月底

單位：新台幣元

項 目	餘 額	占基金運用比例(%)
自行運用	345,936,211,348	56.81
轉存金融機構	122,998,700,464	20.20
短期票券	24,282,701,960	3.99
公債、金融債券、公司債及證券化商品	56,388,036,589	9.26
貨幣型基金	0	0.00
股票及受益憑證投資(含期貨)	66,941,757,379	10.99
國外投資	75,325,014,956	12.37
固定收益	41,926,521,850	6.88
權益證券	27,750,436,180	4.56
另類投資	5,648,056,926	0.93
委託經營	263,042,372,337	43.19
國內委託經營	118,240,763,809	19.41
國外委託經營	144,801,608,528	23.78
固定收益	51,819,394,578	8.51
權益證券	90,083,295,030	14.79
另類投資	2,898,918,920	0.48
合 計	608,978,583,685	100.00

2. 基金自營投資與委外投資比例

新制勞工退休基金

截至 103 年 5 月底

單位：新台幣元

項 目	金 額	占基金運用比例 (%)
自行運用	563,928,077,937	48.72
委託經營	593,628,428,597	51.28

舊制勞工退休基金

截至 103 年 5 月底

單位：新台幣元

項 目	金 額	占基金運用比例 (%)
自行運用	345,936,211,348	56.81
委託經營	263,042,372,337	43.19

3. 基金國內投資與國外投資比例

新制勞工退休基金

截至 103 年 5 月底

單位：新台幣元

項 目	金 額	占基金運用比例 (%)
國 內 投 資	670,249,749,013	57.90
國 外 投 資	487,306,757,521	42.10

舊制勞工退休基金

截至 103 年 5 月底

單位：新台幣元

項 目	金 額	占基金運用比例 (%)
國 內 投 資	388,851,960,201	63.85
國 外 投 資	220,126,623,484	36.15

*基金自營投資概況

1. 基金自營投資績效（國內權益證券）

新制勞工退休基金

截至 103 年 5 月底

項 目	收 益 率（%）
國內權益證券	7.58

舊制勞工退休基金

截至 103 年 5 月底

項 目	收 益 率（%）
國內權益證券	6.85

2. 基金自營股票及受益憑證投資比例概況

新制勞工退休基金

截至 103 年 5 月底

單位：新台幣元

項 目	金 額	比 例（%）
國內權益證券	10,818,067,893	0.93

舊制勞工退休基金

截至 103 年 5 月底

單位：新台幣元

項 目	金 額	比 例（%）
國內權益證券	66,941,757,379	10.99

註：不含貨幣型基金

* 基金國內委外投資概況表

1. 基金國內委外投資績效、績效指標及排名表

新制勞工退休基金

96 年第一次委託經營安泰 (續約 2)

單位：新台幣元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	103 年截至 5 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (102.9.27~103.5.31)		
				投資報酬率(%)	委託經營排名	大盤報酬率(%)
安泰	7,804,845,205	8,805,552,328	9.60	12.82	—	10.89

97 年第一次委託經營安泰 (續約 2)

單位：新台幣元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	103 年截至 5 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (103.1.20~103.5.31)		
				投資報酬率(%)	委託經營排名	大盤報酬率(%)
安泰	5,783,138,827	6,362,162,627	10.01	10.01	—	5.58

97 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	103 年截至 5 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (100.10.8~103.5.31)		
				投資報酬率(%)	委託經營排名	大盤報酬率(%)
富邦	6,747,919,987	7,637,677,512	4.59	13.19	2	25.85
群益	7,256,147,326	8,428,774,671	5.60	16.16	1	
合計	14,004,067,313	16,066,452,183	5.12	14.73	—	

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	103 年截至 5 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (101. 7. 14~103. 5. 31)		
				投資報酬率(%)	委託經營排名	大盤報酬率(%)
安泰	3,421,364,679	4,293,978,757	9.69	25.50	1	27.75
保德信	3,423,163,553	4,204,280,369	4.63	22.82	2	
合計	6,844,528,232	8,498,259,126	7.13	24.16	—	

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	103 年截至 5 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (102. 3. 9~103. 5. 31)		
				投資報酬率(%)	委託經營排名	大盤報酬率(%)
保德信	7,790,534,548	8,620,950,461	4.25	10.66	—	13.23

99 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	103 年截至 5 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (99. 11. 30~103. 5. 31)		
				投資報酬率(%)	委託經營排名	大盤報酬率(%)
永豐	5,000,000,000	5,287,316,729	4.33	5.75	3	8.47
國泰	5,000,000,000	6,170,677,370	3.06	23.41	1	
富邦	5,000,000,000	5,802,458,128	6.02	16.05	2	
滙豐中華	5,000,000,000	4,900,049,655	3.66	-2.00	4	
合計	20,000,000,000	22,160,501,882	4.26	10.80	—	

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	103 年截至 5 月 累積投資報酬 (%)	委任迄今 (100.7.15~103.5.31)		
				投資報酬 率(%)	委託經 營排名	大盤/指 標報酬率 (%)
國泰	5,000,000,000	6,458,501,621	4.68	13.03	4	7.01/ 19.71
富邦	5,000,000,000	6,431,572,750	5.23	15.53	3	
復華	11,294,673,623	13,536,329,349	5.32	17.89	1	
滙豐中華	12,034,391,172	14,454,105,293	5.39	17.85	2	
合計	33,329,064,795	40,880,509,013	5.19	16.08	—	

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	103 年截至 5 月 累積投資報酬 (%)	委任迄今 (100.8.10~103.5.31)		
				投資報酬 率(%)	委託經 營排名	大盤報 酬率(%)
保德信	3,000,000,000	3,499,809,861	6.47	16.66	2	21.12
統一	3,000,000,000	3,437,197,800	10.67	14.57	3	
富邦	3,000,000,000	3,101,171,481	4.62	3.37	5	
復華	3,000,000,000	3,722,799,769	7.08	24.09	1	
摩根	3,000,000,000	3,195,061,834	3.26	6.50	4	
合計	15,000,000,000	16,956,040,745	6.46	13.04	—	

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	103 年截至 5 月 累積投資報酬 (%)	委任迄今 (100.11.23~103.5.31)		
				投資報酬 率(%)	委託經 營排名	大盤報 酬率(%)
保德信	2,000,000,000	2,397,990,181	6.49	19.90	3	29.66
統一	2,000,000,000	2,446,893,807	10.78	22.34	2	
富邦	2,000,000,000	2,207,540,282	4.52	10.38	5	
復華	2,000,000,000	2,647,961,204	7.24	32.40	1	
滙豐中華	2,000,000,000	2,313,305,345	4.09	15.67	4	
摩根	2,000,000,000	2,141,893,352	3.25	7.09	6	
合計	12,000,000,000	14,155,584,171	6.12	17.96	—	

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	103 年截至 5 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (102.4.22~103.5.31)		
				投資報 酬率 (%)	委託經 營排名	大盤報 酬率(%)
復華	4,511,827,956	5,192,139,663	8.04	15.08	—	14.44

101 年第一次委託(相對報酬)

單位：新台幣元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	103 年截至 5 月 累積投資報酬 (%)	委任迄今 (101.4.18~103.5.31)		
				投資報酬 率(%)	委託經 營排名	大盤/指 標報酬 率(%)
國泰	4,500,000,000	5,278,521,421	5.27	23.83	2	19.64/ 27.79
富邦	4,500,000,000	5,211,877,530	4.64	21.00	3	
滙豐中華	9,546,945,283	10,609,113,392	4.32	24.13	1	
合計	18,546,945,283	21,099,512,343	4.45	22.64	—	

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	103 年截至 5 月 累積投資報酬 (%)	委任迄今 (101.7.16~103.5.31)		
				投資報酬 率(%)	委託經 營排名	大盤報 酬率(%)
安泰	5,000,000,000	6,170,206,937	9.63	23.40	2	27.75
保德信	5,000,000,000	5,769,508,451	6.40	15.39	6	
國泰	5,000,000,000	5,950,433,722	9.10	19.01	3	
統一	5,000,000,000	6,596,570,576	13.18	31.93	1	
富邦	5,000,000,000	5,925,819,935	5.87	18.52	4	
滙豐中華	5,000,000,000	5,831,045,545	4.04	16.62	5	
合計	30,000,000,000	36,243,585,166	8.08	20.81	—	

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	103 年截至 5 月 累積投資報酬 (%)	委任迄今 (102.6.7~103.5.31)		
				投資報酬 率(%)	委託經 營排名	大盤報 酬率(%)
國泰	2,500,000,000	2,813,804,176	4.67	12.55	3	12.10
統一	2,500,000,000	2,954,505,136	10.01	18.18	1	
富邦	2,500,000,000	2,681,665,228	2.68	7.27	6	
復華	2,500,000,000	2,825,201,838	8.44	13.01	2	
德盛安聯	2,500,000,000	2,774,053,728	5.77	10.96	4	
摩根	2,500,000,000	2,716,325,335	5.60	8.65	5	
合計	15,000,000,000	16,765,555,441	6.20	11.77	—	

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	103 年截至 5 月 累積投資報酬 (%)	委任迄今 (102.11.22~103.5.31)		
				投資報酬 率(%)	委託經 營排名	大盤報 酬率(%)
國泰	2,500,000,000	2,614,883,399	3.05	4.60	5	12.06
統一	2,500,000,000	2,785,791,500	8.34	11.43	1	
富邦	2,500,000,000	2,594,542,815	2.54	3.78	6	
復華	2,500,000,000	2,772,528,166	8.32	10.90	2	
德盛安聯	2,500,000,000	2,710,984,431	6.77	8.44	3	
摩根	2,500,000,000	2,651,808,799	5.55	6.07	4	
合計	15,000,000,000	16,130,539,110	5.77	7.54	—	

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	103 年截至 5 月 累積投資報酬 (%)	委任迄今 (103.1.20~103.5.31)		
				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	3,118,810,620	3.96	3.96	6	5.58/ 5.59
統一	3,000,000,000	3,211,687,336	7.06	7.06	3	
富邦	3,000,000,000	3,128,170,666	4.27	4.27	5	
復華	3,000,000,000	3,251,617,950	8.39	8.39	1	
群益	3,000,000,000	3,226,849,799	7.56	7.56	2	
滙豐中華	3,000,000,000	3,145,209,025	4.84	4.84	4	
合計	18,000,000,000	19,082,345,396	6.01	6.01	—	

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。

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	103 年截至 5 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (102.1.26~103.5.31)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤 報酬率(%)
保德信	3,380,116,383	3,885,567,014	3.78	14.95	3	18.29
富邦	3,208,581,038	3,706,629,452	6.03	15.52	2	
統一	3,514,321,648	4,464,097,523	10.19	27.03	1	
合計	10,103,019,069	12,056,293,989	6.77	19.33	—	

國內 99 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	103 年截至 5 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (99.8.13~103.5.31)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤 報酬率(%)
保德信	4,000,000,000	4,042,386,952	2.86	1.06	5	15.92
群益	4,000,000,000	4,351,910,522	6.60	8.80	4	
復華	4,000,000,000	4,513,007,520	10.94	12.83	2	
國泰	4,000,000,000	4,531,203,995	5.41	13.28	1	
永豐	4,000,000,000	4,481,858,288	4.02	12.05	3	
合計	20,000,000,000	21,920,367,277	5.96	9.60	—	

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	103 年截至 5 月 累積投資報酬 (%)	委任迄今 (100.3.17~103.5.31)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤 報酬率(%)
保德信	5,000,000,000	5,400,482,065	3.39	8.01	5	9.03
群益	5,000,000,000	5,794,690,886	7.15	15.89	2	
復華	5,000,000,000	5,776,517,466	7.18	15.53	3	
國泰	5,000,000,000	5,603,012,593	5.94	12.06	4	
統一	5,000,000,000	6,218,319,660	10.43	24.37	1	
合計	25,000,000,000	28,793,022,670	6.88	15.17	—	

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	103 年截至 5 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (101.10.30~103.5.31)		
				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	2,456,679,135	4.94	29.24	—	31.77

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。

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	103 年截至 5 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (101.4.30~103.5.31)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤 報酬率(%)
保德信	5,000,000,000	5,673,281,333	4.10	13.47	6	21.33
群益	5,000,000,000	5,869,578,137	5.48	17.39	3	
匯豐中華	5,000,000,000	5,859,973,006	4.39	17.20	5	
安泰	5,000,000,000	6,321,933,179	8.13	26.44	1	
國泰	5,000,000,000	5,865,746,329	6.19	17.31	4	
統一	5,000,000,000	6,047,410,611	10.40	20.95	2	
合計	30,000,000,000	35,637,922,595	6.46	18.79	—	

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	103 年截至 5 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (102.6.7~103.5.31)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤 報酬率(%)
德盛安聯	2,500,000,000	2,774,126,745	5.77	10.97	4	12.10
復華	2,500,000,000	2,825,288,665	8.44	13.01	2	
國泰	2,500,000,000	2,813,885,749	4.67	12.56	3	
富邦	2,500,000,000	2,681,762,650	2.69	7.27	6	
摩根	2,500,000,000	2,716,404,223	5.60	8.66	5	
統一	2,500,000,000	2,954,596,256	10.01	18.18	1	
合計	15,000,000,000	16,766,064,288	6.21	11.77	—	

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	103 年截至 5 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (102.11.22~103.5.31)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤 報酬率(%)
德盛安聯	2,500,000,000	2,711,034,063	6.77	8.44	3	12.06
復華	2,500,000,000	2,772,573,629	8.32	10.90	2	
國泰	2,500,000,000	2,614,928,855	3.05	4.60	5	
富邦	2,500,000,000	2,594,594,752	2.54	3.78	6	
摩根	2,500,000,000	2,651,853,651	5.55	6.07	4	
統一	2,500,000,000	2,785,841,064	8.34	11.43	1	
合計	15,000,000,000	16,130,826,014	5.77	7.54	—	

2. 103 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：

投信名稱	收回日期	收回委託金額	經理人	收回理由
100-1P 元大寶來	103.2.13	50 億元	謝 ○ ○	委託經營投資契約第 23 條規定，收回全數委託資產
101-1 元大寶來	103.2.13	45 億元	林 ○ ○	委託經營投資契約第 23 條規定，收回全數委託資產

舊制勞工退休基金：

投信名稱	收回日期	收回委託金額	經理人	收回理由
99-1 日盛	103.2.13	40 億元	黃 ○ ○	委託經營投資契約第 23 條規定，收回全數委託資產
101-1 元大寶來	103.2.13	10 億元	張 ○ ○	委託經營投資契約第 23 條規定，收回全數委託資產

(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

* 基金國外委外投資概況表

1. 基金國外委外投資績效、績效指標及排名表

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	103年截至5月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (101.5.21~103.5.31)		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率(%)
坦伯頓	500,000,000	768,390,784	3.94	65.46	—	47.90

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	103年截至5月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (101.6.4~103.5.31)		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率(%)
聯博	750,000,000	789,552,064	4.48	5.27	2	4.47
高盛	400,000,000	420,740,952	3.27	5.19	3	
坦伯頓	650,000,000	753,549,335	4.50	15.93	1	
合計	1,800,000,000	1,963,842,351	4.23	9.10	—	

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	103年截至5月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (102.1.7~103.5.31)		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率(%)
太平洋	615,416,988	630,026,656	4.65	2.36	2	2.63
高盛	479,694,715	493,650,299	3.29	2.91	1	
合計	1,095,111,703	1,123,676,955	4.05	2.60	—	

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	103 年截至 5 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (102.2.5~103.5.31)		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率(%)
貝萊德	384,277,868	493,041,788	4.63	28.30	1	22.73
摩根	587,857,352	727,109,114	4.34	23.69	2	
合計	972,135,220	1,220,150,902	4.45	25.51	—	

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	103 年截至 5 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (102.11.18~103.5.31)		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率(%)
景順	471,501,358	505,024,371	6.26	7.11	—	4.81

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	103 年截至 5 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (102.12.2~103.5.31)		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率(%)
貝萊德	299,329,552	317,654,570	4.24	6.12	2	6.02
道富	349,680,272	371,426,509	4.40	6.22	1	
合計	649,009,824	689,081,079	4.32	6.17	—	

99-1 全球新興市場股票型

單位：美元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	103年截至5月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (99.8.24~103.5.31)		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率(%)
摩根士丹利	350,000,000	384,556,269	3.46	18.10	2	13.96
瑞萬通博	450,000,000	527,395,302	6.11	27.88	1	
合計	800,000,000	911,951,571	4.97	23.75	—	

100-1 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	103年截至5月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (100.7.1~103.5.31、 100.7.13~103.5.31)		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率(%)
道富	300,000,000	397,467,095	4.92	32.49	2	31.59
貝萊德	300,000,000	407,522,399	4.92	35.83	1	35.33
合計	600,000,000	804,989,494	4.92	34.16	—	—

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	103年截至5月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (101.3.6~103.5.31)		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率(%)
Cohen & Steers	400,000,000	486,157,837	9.18	30.98	2	27.66
景順	450,000,000	550,724,413	9.84	31.42	1	
EII	400,000,000	484,855,340	8.28	27.40	3	
合計	1,250,000,000	1,521,737,590	9.13	29.77	—	

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	103年截至5月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (101.7.31~103.5.31)		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率(%)
Ashmore	300,000,000	304,796,191	5.68	4.93	1	5.30
Bluebay	300,000,000	304,108,090	5.70	3.57	2	
實港	300,000,000	296,582,079	5.44	0.73	4	
Pictet	300,000,000	299,576,624	5.25	1.80	3	
合計	1,200,000,000	1,205,062,984	5.52	2.76	—	

101-1 全球低波動股票型

單位：美元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	103年截至5月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (102.4.18~103.5.31)		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率(%)
道富	500,000,000	533,861,890	4.57	6.53	1	6.09
貝萊德	500,000,000	531,601,085	4.56	6.06	2	
合計	1,000,000,000	1,065,462,975	4.57	6.29	—	

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	103年截至5月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (103.1.22~103.5.31)		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率(%)
瑞萬通博	300,000,000	308,585,163	3.99	3.99	3	6.52
MFS	300,000,000	313,780,242	5.93	5.93	2	
威靈頓	300,000,000	314,582,848	6.42	6.42	1	
合計	900,000,000	936,948,253	5.44	5.44	—	

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	103年截至5月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (103.4.25~103.5.31)		
				投資報 酬率(%)	排名	指標報 酬率(%)
Bluebay	100,000,000	101,200,348	1.20	1.20	1	1.23
貝萊德	100,000,000	101,070,029	1.07	1.07	2	
盧米斯	100,000,000	101,029,123	1.03	1.03	3	
合計	300,000,000	303,299,500	1.10	1.10	—	

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	103 年截至 5 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (100.6.21~103.5.31)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
富達國際	425,533,349	562,204,846	3.45	29.83	-	27.81

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	103 年截至 5 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (102.1.6~103.5.31)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
太平洋	731,384,466	745,025,516	4.44	1.87	1	2.63
盧米斯	712,476,555	725,439,897	3.86	1.82	2	
合計	1,443,861,021	1,470,465,413	4.15	1.84	—	

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	103 年截至 5 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (102.2.5~103.5.31)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
貝萊德	384,953,368	493,820,585	4.62	28.28	-	22.73

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	103 年截至 5 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (102.11.17~103.5.31)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
景順	262,187,756	282,363,538	6.53	7.70	-	4.81

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	103 年截至 5 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (101.3.6~103.5.31)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
貝萊德	300,000,000	372,450,315	4.98	38.75	3	38.53
道富	300,000,000	372,597,299	4.89	39.07	2	
瑞銀環球	300,000,000	371,497,993	4.73	38.63	4	
野村	300,000,000	372,588,843	4.89	39.08	1	
合計	1,200,000,000	1,489,134,450	4.87	38.88	—	

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	103 年截至 5 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (102.6.13~103.5.31)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
貝萊德	300,000,000	314,978,558	4.39	9.89	—	9.95

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	103 年截至 5 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (103. 1. 22~103. 5. 31)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
瑞萬通博	150,000,000	154,744,078	3.91	3.91	3	6.52
MFS	150,000,000	157,623,851	6.00	6.00	2	
威靈頓	150,000,000	158,139,962	6.52	6.52	1	
合計	450,000,000	470,507,891	5.47	5.47	—	

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	103 年截至 5 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (103. 5. 29~103. 5. 31)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
瑞德	50,000,000	50,080,247	0.16	0.16	2	0.77
Cohen	50,000,000	50,180,845	0.36	0.36	1	
合計	100,000,000	100,261,092	0.26	0.26	—	

2. 103 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

*基金投資衍生性金融商品概況表

新制勞工退休基金自營部位

(依交易目的)

103年5月31日

一、避險：

種類	避險比例
權益證券避險	0%
匯率避險	7.83%

二、投資：無

舊制勞工退休基金自營部位

(依交易目的)

103年5月31日

一、避險：

種類	避險比例
權益證券避險	0%
匯率避險	2.15%

二、投資：無

*新制勞工退休基金財務收支表

單位：新台幣元

	餘絀	營業收入	營業支出
103年5月	13,424,095,359	16,978,927,015	3,554,831,656

註：上述金額係依權責基礎填列。

*舊制勞工退休基金財務收支表

單位：新台幣元

	餘絀	營業收入	營業支出
103年5月	8,365,237,139	9,536,351,912	1,171,114,773

註：上述金額係依權責基礎填列。

***新制勞工退休基金投資運用現金收支表**

103 年 5 月份

單位：新台幣元

項 目	金 額
基金收入	209,604,678,478
基金支出	212,738,824,347
現金增(減)數	(3,134,145,869)

註：本表採現金基礎。

***舊制勞工退休基金投資運用現金收支表**

103 年 5 月份

單位：新台幣元

項 目	金 額
基金收入	13,435,342,801
基金支出	13,435,744,302
現金增(減)數	(401,501)

註：本表採現金基礎。