

勞工退休基金運用情形報告（102 年截至 6 月底止）

6 月歐、美經濟表現略有溫和回升，其中美國製造業景氣指數較上月大幅上升 1.9 至 50.9，重回景氣擴張水位；非製造業指數則下降 1.5 至 52.2，失業率仍持平在 7.6%，惟總勞動力增加 17.7 萬人；另歐元區製造業採購經理人指數較上個月微幅上升 0.5 至 48.8，服務業採購經理人指數亦持續回升，較上個月上升 1.1 至 48.3，而近期公布的 5 月失業率則持續攀升至 12.1%，再創歐元區成立以來新高水位；而中國 5 月製造業採購經理人指數下降 0.7 至 50.1，非製造業採購經理人指數則下降 0.4 至 53.9，復甦持續減緩。

6 月全球金融市場在美國聯準會(FED) 主席柏南克表示將開始評估縮減量化寬鬆(QE)政策，並於明年中完全退場，造成全球股、債、匯市大幅震盪，在美元升值預期下，資金並大幅從新興市場流出，而台股則在證所稅修法利多因素下，表現相對抗跌。6 月單月 MSCI 世界、新興市場及台股指數表現分別為-2.92%、-6.67%及-2.33%，累計今年表現分別為 6.05%、-8.89%及 4.71%。

觀諸勞工退休基金截至今（102）年 6 月底止，整體新、舊制基金規模為 1 兆 5,790 億 3,108 萬元，其中舊制基金規模為 5,953 億 2,877 萬元，新制基金規模為 9,837 億 232 萬元。今年截至 6 月底，整體基金評價後收益數為 273 億 3,031 萬元，收益率為 1.8106%，新、舊制基金績效均超越法定最低保證收益率。

展望未來，經濟合作暨發展組織(OECD)7 月 8 日表示，5 月綜合領先指標升至 100.6，超越長期均值，顯示 OECD 主要經濟體的經濟成長溫和改善，其中已開發國家正逐步獲得經濟動力，但大型新興經濟體的動力則回穩或者降溫，而日本受惠於大規模貨幣刺激措施表現出眾，顯示經濟前景分歧趨勢。另國際貨幣基金(IMF)於 7 月 10 日則基於美國 QE 政策即將退場，恐使中國等

新興國家擴張減速，將今、明年 GDP 成長率分別下修 0.2%至 3.1%及 3.8%。

近期全球各經濟體前景分歧，資金流動快速，市場波動頻繁，勞退基金未來仍將深入掌握市場投資動向，注意投資風險之管控，在既定之資產配置下，動態調整各項投資布局時點及策略，以獲取長期穩健之基金收益。

*** 基金整體績效**

新制勞工退休基金 97 年 1 月迄今整體績效

截至 102 年 6 月底

收益率
1.8969%

舊制勞工退休基金 76 年 6 月迄今整體績效

截至 102 年 6 月底

收益率
4.96%

* 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 102 年 6 月底止基金規模與收益		
基金運用規模		9,837 億 232 萬元
102 年截至 6 月底止 運用總損益及評價後報酬率	自行運用	23 億 3,372 萬元 0.51%
	委託經營	139 億 1,870 萬元 2.92%
	合 計	162 億 5,242 萬元 1.74%

註 1：評價後報酬率係以當期報酬率（即收益÷102 年之日平均餘額）列示。

註 2：102 年 6 月之保證收益率為 1.3916%。

資產配置

截至 102 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	479,090,942,568	48.70
轉存金融機構	229,539,800,649	23.33
短期票券	54,647,446,065	5.56
公債、公司債及金融債券	115,021,552,547	11.69
貨幣型基金	600,000,000	0.06
股票及受益憑證投資（含期貨）	6,844,913,585	0.70
國外投資	72,437,229,722	7.36
固定收益	59,737,881,900	6.07
權益證券	7,333,782,542	0.75
另類投資	5,365,565,280	0.54
委託經營	504,611,373,185	51.30
國內委託經營	198,352,277,048	20.16
國外委託經營	306,259,096,137	31.14
固定收益	126,262,029,730	12.84
權益證券	140,077,097,063	14.24

另類投資	39,919,969,344	4.06
合 計	983,702,315,753	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 102 年 6 月底止基金規模與收益		
基金運用規模		5,953 億 2,877 萬元
102 年截至 6 月底止 運用總損益及評價後報酬率	自行運用	43 億 6,276 萬元 1.19%
	委託經營	67 億 1,513 萬元 3.24%
	合 計	110 億 7,789 萬元 1.93%

註：1.評價後報酬率係以當期報酬率（即收益÷102 年之日平均餘額）列示

資產配置

截至 102 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	378,158,367,352	63.53
轉存金融機構	151,184,634,654	25.40
短期票券	37,186,768,865	6.25
公債、金融債券、公司債及證券化商品	61,408,649,175	10.32
貨幣型基金	6,941,566,750	1.17
股票及受益憑證投資(含期貨)	48,489,355,730	8.14
國外投資	72,947,392,178	12.25
固定收益	46,048,580,880	7.73
權益證券	20,703,543,269	3.48
另類投資	6,195,268,029	1.04
委託經營	217,170,400,736	36.47
國內委託經營	112,401,112,489	18.87
國外委託經營	104,769,288,247	17.60

固定收益	51,392,579,420	8.63
權益證券	53,376,708,827	8.97
合 計	595,328,768,088	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 102 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	479,090,942,568	48.70
委託經營	504,611,373,185	51.30

舊制勞工退休基金

截至 102 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	378,158,367,352	63.53
委託經營	217,170,400,736	36.47

3.基金國內投資與國外投資比例

新制勞工退休基金

截至 102 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	605,005,989,894	61.50
國 外 投 資	378,696,325,859	38.50

舊制勞工退休基金

截至 102 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	417,612,087,663	70.15
國 外 投 資	177,716,680,425	29.85

* 基金自營投資概況

1. 基金自營投資績效（股票）

新制勞工退休基金

截至 102 年 6 月底

單位：％

項 目	收益率（％）
國內權益證券（ETF）	1.58

舊制勞工退休基金

截至 102 年 6 月底

單位：％

項 目	收益率（％）
國內權益證券	4.41

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 102 年 6 月底

單位：新台幣元；%

項 目	金 額	比 例 (%)
國內權益證券 (ETF)	6,844,913,585	0.70

舊制勞工退休基金

截至 102 年 6 月底

單位：新台幣元；%

項 目	金 額	比 例 (%)
國內權益證券	48,489,355,730	8.14

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）

單位：新台幣元；%

投信 名稱	委託金額	目前淨資產	102 年截至 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (99.9.27~102.6.30)		
				投資報 酬率 (%)	委託經 營排名	大盤/指標 報酬率(%)
安泰	7,000,000,000	7,780,886,316	6.51	11.16	1	-1.28
合計	7,000,000,000	7,780,886,316	6.51	11.16	—	

97 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	102 年截至 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (100.1.18~102.6.30)		
				投資報 酬率 (%)	委託經 營排名	大盤/指標 報酬率(%)
日盛	4,968,884,136	4,733,991,672	1.50	-4.73	4	-9.67
安泰	3,298,075,210	3,493,391,812	6.63	5.92	1	
保德 信	2,939,416,481	2,815,954,472	4.05	-4.20	3	
國泰	2,944,902,854	2,719,753,118	0.87	-7.65	5	
群益	2,782,544,958	2,724,743,190	0.65	-2.08	2	
合計	16,933,823,639	16,487,834,264	2.73	-2.63	—	

97 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	102 年截至 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (100.3.17~102.6.30)		
				投資 報酬 率(%)	委託經 營排名	大盤/指標 報酬率(%)
安泰	2,000,000,000	2,123,880,728	6.63	6.19	1	-3.15
保德 信	2,000,000,000	2,044,124,328	4.54	2.21	2	
合計	4,000,000,000	4,168,005,056	5.59	4.20	—	

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	102 年截至 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (100.10.8~102.6.30)		
				投資 報酬 率(%)	委託經 營排名	大盤/指標 報酬率(%)
富邦	6,747,919,987	6,912,027,366	2.82	2.43	2	11.79
群益	7,256,147,326	7,508,807,358	0.61	3.48	1	
合計	14,004,067,313	14,420,834,724	1.66	2.98	—	

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	102 年截至 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (100.7.14~102.6.30)		
				投資報 酬率 (%)	委託經 營排名	大盤/指標 報酬率(%)
安泰	3,421,364,679	3,790,836,898	6.67	10.80	1	13.48
保德 信	3,423,163,553	3,792,086,930	5.51	10.78	2	
合計	6,844,528,232	7,582,923,828	6.09	10.79	—	

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	102 年截至 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (102.3.9~102.6.30)		
				投資報酬 率(%)	委託經營 排名	大盤/指標 報酬率(%)
保德信	7,790,534,548	7,850,544,734	0.77	0.77	1	0.59
合計	7,790,534,548	7,850,544,734	0.77	0.77	—	

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	102 年截至 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (99.11.30~102.6.30)		
				投資報酬 率(%)	委託經營 排名	大盤/指 標報酬率 (%)
永豐	5,000,000,000	4,715,133,645	5.35	-5.70	3	-3.64
國泰	5,000,000,000	5,707,739,736	7.41	14.15	1	
富邦	5,000,000,000	5,160,518,221	2.89	3.21	2	
滙豐 中華	5,000,000,000	4,570,001,430	4.22	-8.60	4	
合計	20,000,000,000	20,153,393,032	5.02	0.77	—	

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	102 年截至 6 月 累積投資報酬 (%)	委任迄今 (100.7.15~102.6.30)		
				投資報酬 率(%)	委託經 營排名	大盤/指 標報酬率 (%)
元大 寶來 (原元 大)	5,000,000,000	5,583,447,311	8.16	-3.51	6	-4.94/ 2.13
國泰	5,000,000,000	5,560,714,007	8.87	-2.69	5	
富邦	5,000,000,000	5,512,361,141	9.19	-0.98	3	
復華	5,000,000,000	5,775,825,881	11.35	-0.10	2	
滙豐中 華	6,000,000,000	6,750,196,671	9.96	0.14	1	
元大 寶來 (原寶 來)	5,000,000,000	5,591,192,604	9.03	-2.26	4	
合計	31,000,000,000	34,773,737,615	9.43	-1.60	—	

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，自委託日起算大盤/指定指標報酬率為 -4.94% /2.13%。

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	102 年截至 6 月 累積投資報酬 (%)	委任迄今 (100.8.10~102.6.30)		
				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	3,118,685,723	3.51	3.96	2	7.59
統一	3,000,000,000	2,923,705,840	3.81	-2.54	4	
富邦	3,000,000,000	2,777,537,136	0.02	-7.42	5	
復華	3,000,000,000	3,188,697,755	7.02	6.29	1	
摩根	3,000,000,000	2,948,855,092	1.20	-1.70	3	
合計	15,000,000,000	14,957,481,546	3.16	-0.28	—	

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	102 年截至 6 月 累積投資報酬 (%)	委任迄今 (100.11.23~102.6.30)		
				投資報酬 率(%)	委託經 營排名	大盤/指 標報酬 率(%)
保德信	2,000,000,000	2,126,433,075	4.08	6.32	2	15.17
統一	2,000,000,000	2,077,574,969	3.47	3.88	4	
富邦	2,000,000,000	1,980,309,818	0.00	-0.98	5	
復華	2,000,000,000	2,262,014,334	7.08	13.10	1	
滙豐 中華	2,000,000,000	2,110,808,423	2.51	5.54	3	
摩根	2,000,000,000	1,976,976,830	1.20	-1.15	6	
合計	12,000,000,000	12,534,117,449	3.11	4.45	—	

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	102 年截至 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (102.4.22~102.6.30)		
				投資報酬 率(%)	委託經 營排名	大盤/指標 報酬率(%)
復華	4,511,827,956	4,501,619,588	-0.23	-0.23	1	1.66
合計	4,511,827,956	4,501,619,588	-0.23	-0.23	—	

101 年第一次委託

單位：新台幣元；%

投信 名稱	委託金額	目前淨資產	102 年截至 6 月 累積投資報酬 (%)	委任迄今 (101.4.18~102.6.30)		
				投資報酬 率(%)	委託經 營排名	大盤/指 標報酬 率(%)
國泰	4,000,000,000	4,108,603,311	3.93	8.23	3	6.28/ 10.38
富邦	4,000,000,000	4,092,935,749	3.94	6.73	4	
滙豐 中華	4,000,000,000	4,114,107,037	5.94	8.62	2	
元大 寶來 (原寶來)	4,000,000,000	4,132,006,795	4.74	9.84	1	
合計	16,000,000,000	16,447,652,892	4.64	8.35	—	

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	102 年截至 6 月 累積投資報酬 (%)	委任迄今 (101.7.16~102.6.30)		
				投資報酬 率(%)	委託經 營排名	大盤/指 標報酬 率(%)
安泰	5,000,000,000	5,453,559,414	6.45	9.07	1	13.48
保德信	5,000,000,000	5,228,710,208	1.66	4.57	6	
國泰	5,000,000,000	5,258,882,304	1.82	5.18	5	
統一	5,000,000,000	5,359,873,808	3.78	7.20	3	
富邦	5,000,000,000	5,315,984,583	2.86	6.32	4	
滙豐 中華	5,000,000,000	5,408,116,625	4.19	8.16	2	
合計	30,000,000,000	32,025,126,942	3.46	6.75	—	

102 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	102 年截至 6 月 累積投資報酬 (%)	委任迄今 (102.6.7~102.6.30)		
				投資報酬 率(%)	委託經 營排名	大盤/指 標報酬 率(%)
國泰	2,500,000,000	2,514,447,658	0.58	0.58	1	-0.42
統一	2,500,000,000	2,485,102,092	-0.60	-0.60	6	
富邦	2,500,000,000	2,498,394,200	-0.06	-0.06	4	
復華	2,500,000,000	2,496,684,675	-0.13	-0.13	5	
德盛 安聯	2,500,000,000	2,498,713,887	-0.05	-0.05	3	
摩根	2,500,000,000	2,501,019,773	0.04	0.04	2	
合計	15,000,000,000	14,994,362,285	-0.04	-0.04	—	

舊制勞工退休基金

國內 97 年第 1 次委託(續)

單位：新台幣元；％

投信名稱	委託金額	目前淨資產	102 年截至 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (100.3.17~102.6.30)		
				投資 報酬率(%)	排名	大盤/指標 報酬率(%)
保德信	3,313,984,536	3,322,716,943	4.11	0.26	1	-3.15
群益	3,472,017,296	3,333,662,883	1.25	-3.98	2	
合計	6,786,001,832	6,656,379,826	2.66	-1.91	—	

國內 98 年第 2 次委託(續)

投信名稱	委託金額 (新台幣元)	目前淨資產 (新台幣元)	102 年截至 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (102.1.26~102.6.30)		
				投資 報酬率(%)	排名	大盤/指標 報酬率(%)
保德信	3,380,116,383	3,544,694,423	4.87	4.87	2	5.08
富邦	3,208,581,038	3,299,957,359	2.85	2.85	3	
統一	3,514,321,648	3,780,907,880	7.59	7.59	1	
合計	10,103,019,069	10,625,559,662	5.17	5.17	—	

國內 99 年第 1 次委託

單位：新台幣元；％

投信名稱	委託金額	目前淨資產	102 年截至 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (99.8.13~102.6.30)		
				投資 報酬率(%)	排名	大盤/指標 報酬率(%)
保德信	4,000,000,000	3,744,850,543	1.73	-6.38	6	2.97
群益	4,000,000,000	3,797,665,693	2.89	-5.06	4	
復華	4,000,000,000	3,773,619,767	4.56	-5.66	5	
國泰	4,000,000,000	4,077,648,593	1.34	1.94	1	
元大寶來	4,000,000,000	3,604,073,108	4.97	-9.90	7	
永豐	4,000,000,000	4,012,582,060	5.10	0.31	2	
日盛	4,000,000,000	3,906,556,177	1.96	-2.34	3	
合計	28,000,000,000	26,916,995,941	3.18	-3.87	—	

國內 100 年第 1 次委託

單位：新台幣元；%

投信名稱	委託金額	目前淨資產	102 年截至 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (100.3.17~102.6.30)		
				投資 報酬率(%)	排名	大盤/指標 報酬率(%)
保德信	5,000,000,000	4,999,525,565	4.06	-0.01	4	-3.15
群益	5,000,000,000	5,002,765,636	2.29	0.06	3	
復華	5,000,000,000	4,995,029,332	6.35	-0.10	5	
國泰	5,000,000,000	5,025,379,438	1.73	0.51	2	
統一	5,000,000,000	5,254,194,422	6.15	5.08	1	
合計	25,000,000,000	25,276,894,393	4.10	1.11	—	

國內 101 年第 1 次委託

單位：新台幣元；%

投信名稱	委託金額	目前淨資產	102 年截至 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (101.10.30~102.6.30)		
				投資 報酬率(%)	排名	大盤/指標 報酬率(%)
匯豐中華	500,000,000	560,891,239	6.19	12.18	2	13.82
元大寶來	500,000,000	565,374,383	5.78	13.07	1	
合計	1,000,000,000	1,126,265,622	5.98	12.63	—	

國內 101 年第 2 次委託

單位：新台幣元；%

投信名稱	委託金額	目前淨資產	102 年截至 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (101.4.30~102.6.30)		
				投資 報酬率(%)	排名	大盤/指標 報酬率(%)
保德信	5,000,000,000	5,238,131,121	1.93	4.76	4	7.78
群益	5,000,000,000	5,230,309,507	0.36	4.61	5	
匯豐中華	5,000,000,000	5,373,191,239	2.75	7.46	2	
安泰	5,000,000,000	5,618,619,608	9.42	12.37	1	
國泰	5,000,000,000	5,259,614,523	2.08	5.19	3	
統一	5,000,000,000	5,195,439,842	3.19	3.91	6	
合計	30,000,000,000	31,915,305,840	3.28	6.38	—	

國內 102 年第 1 次委託第 1 期

投信名稱	委託金額 (新台幣元)	目前淨資產 (新台幣元)	102 年截至 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (102.6.7~102.6.30)		
				投資 報酬率(%)	排名	大盤/指標 報酬率(%)
德盛安聯	2,500,000,000	2,498,715,274	-0.05	-0.05	3	-0.42
復華	2,500,000,000	2,496,687,691	-0.13	-0.13	5	
國泰	2,500,000,000	2,514,448,863	0.58	0.58	1	
富邦	2,500,000,000	2,498,396,918	-0.06	-0.06	4	
摩根	2,500,000,000	2,501,020,822	0.04	0.04	2	
統一	2,500,000,000	2,485,104,315	-0.60	-0.60	6	
合計	15,000,000,000	14,994,373,883	-0.04	-0.04	—	

2.102 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

單位：元

投信名稱	收回日期	收回委託 金額	經理人	收回理由
97-1 續 元大寶來	102.1.9	38 億	楊○○	委託經營投資契約第 23 條規定，收回全數委託資產
99-2 元大寶來	102.4.19	50 億	夏○○	委託經營投資契約第 23 條規定，收回全數委託資產
99-2 日盛	102.4.24	50 億	鄭○○	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：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

投信名稱	懲處資訊
日盛投信	運用全權委託投資資產投資或交易，有投資分析報告欠缺合理依據之情形，核已違反證券投資信託事業相關法令規定，裁處糾正及罰鍰新臺幣 12 萬元。(102/3/29)
元大寶來投信	運用委託投資資產投資或交易，投資分析報告未有合理分析基礎及依據，核已違反證券投資信託事業相關法令規定，裁處糾正及罰鍰新臺幣 12 萬元。(102/4/26)

*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	目前淨資產	委託金額 (億美元)	102 年截至 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (101.5.21~102.6.30)		
				投資報酬 率(%)	委託經 營排名	大盤/指標 報酬率(%)
坦伯頓	532,834,678.27	4	10.45	33.21	1	22.59
合計	532,834,678.27	4	10.45	33.21	—	

97-1 全球債券型續約

單位：美元；%

投信名稱	目前淨資產	委託金額 (億美元)	102 年截至 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (101.6.4~102.6.30)		
				投資報酬 率(%)	委託經 營排名	大盤/指標 報酬率(%)
聯博	739,778,227.08	7.5	-4.86	-1.36	2	-2.01
高盛	392,273,832.90	4	-5.41	-1.93	3	
坦伯頓	691,176,036.15	6.5	-3.38	6.33	1	
合計	1,823,228,096.13	18	-4.43	1.29	—	

97-2 全球增值債券型續約

單位：美元；%

投信名稱	目前淨資產	委託金額 (億美元)	102 年截至 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (102.1.7~102. 6.30)		
				投資報酬 率(%)	委託經 營排名	大盤/指標 報酬率(%)
太平洋	587,658,333.61	6.15	-4.52	-4.52	2	-3.73
高盛	459,552,938.23	4.79	-4.20	-4.20	1	
合計	1,047,211,271.84	10.95	-4.38	-4.38	—	

97-2 全球增值股票型續約

單位：美元；%

投信名稱	目前淨資產	委託金額 (億美元)	102 年截至 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (102.2.5~102.6.30)		
				投資報酬 率(%)	委託經 營排名	大盤/指標 報酬率(%)
貝萊德	400,848,300.11	3.84	4.31	4.31	1	1.70
摩根	601,214,550.69	5.88	2.27	2.27	2	
合計	1,002,062,850.80	9.72	3.08	3.08	—	

98-1 亞太（日本除外）股票型

單位：美元；%

投信名稱	目前淨資產	委託金額 (億美元)	102 年截至 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (98.11.17~102. 6.30)		
				投資報酬 率(%)	委託經 營排名	大盤/指標 報酬率(%)
德盛安聯	316,548,500.27	3	-5.36	11.48	2	15.38
景順	334,811,940.51	3	-3.70	18.13	1	
摩根士丹利	217,143,732.50	2	-4.25	8.57	3	
合計	868,504,173.28	8	-4.45	12.94	—	

98-1 全球被動股票型

單位：美元；%

投信名稱	目前淨資產	委託金額 (億美元)	102 年截至 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (98.11.30~102.6.30)		
				投資報酬 率(%)	委託經 營排名	大盤/指標 報酬率(%)
貝萊德	262,823,483.65	2	5.95	31.41	1	31.89
道富	262,772,241.86	2	6.17	31.39	2	
合計	525,595,725.51	4	6.06	31.39	—	

99-1 全球新興市場股票型

單位：美元；%

投信名稱	目前淨資產	委託金額 (億美元)	102 年截至 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (99.8.24~102.6.30)		
				投資報酬 率(%)	委託經 營排名	大盤/指標 報酬率(%)
摩根士丹利	258,564,092.87	2.5	-4.97	8.57	2	2.24
美盛	98,529,591.92	1.25	-12.06	-10.43	3	
瑞萬通博	513,479,655.94	4.5	-4.59	24.51	1	
合計	870,573,340.73	8.25	-6.21	10.64	—	

100-1 全球基本面指數股票型

單位：美元；%

投信名稱	目前淨資產	委託金額 (億美元)	102 年截至 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (100.7.1~102. 6.30、 100.7.13~102. 6.30)		
				投資報酬 率(%)	委託經 營排名	大盤/指標 報酬率(%)
道富	321,966,455.22	3	7.50	7.32	2	6.51
貝萊德	329,726,731.97	3	7.29	9.90	1	9.54
合計	651,693,187.19	6	7.39	8.61	—	

註：其中道富委託日 100.7.1~105.6.30，貝萊德委託日 100.7.13~105.7.12，委任迄今大盤/指標報酬率分別為 10%及 13.12%。

100-1 全球不動產股票型

單位：美元；%

投信名稱	目前淨資產	委託金額 (億美元)	102 年截至 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (101.3.6~102.6.30)		
				投資報酬 率(%)	委託經 營排名	大盤/指標 報酬率(%)
Cohen & Steers	434,084,961.60	4	2.03	16.95	2	15.44
景順	497,681,836.86	4.5	0.62	18.76	1	
EII	436,200,043.91	4	-0.45	14.61	3	
合計	1,367,966,842.37	12.5	0.64	16.65	—	

101-1 全球新興市場債券型

單位：美元；%

投信名稱	目前淨資產	委託金額 (億美元)	102 年截至 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (101. 7. 31~102. 6. 30)		
				投資報酬 率(%)	委託經 營排名	大盤/指標 報酬率(%)
Ashmore	288, 239, 467. 61	3	-6.40	-0.77	1	-1.39
Bluebay	287, 424, 407. 83	3	-6.21	-2.11	2	
Stone Harbour	282, 363, 963. 12	3	-7.66	-4.10	4	
Pictet	284, 262, 734. 37	3	-7.10	-3.40	3	
合計	1, 142, 290, 572. 93	12	-6.84	-2.60	—	

101-1 全球低波動股

單位：美元；%

投信名稱	目前淨資產	委託金額 (億美元)	102 年截至 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (102. 4. 18~102. 6. 30)		
				投資報酬 率(%)	委託經 營排名	大盤/指標 報酬率(%)
道富	243, 887, 480. 94	2.5	-3.78	-3.78	2	-3.67
貝萊德	243, 814, 882. 60	2.5	-3.76	-3.76	1	
合計	487, 702, 363. 54	5	-3.77	-3.77	—	

舊制勞工退休基金

96 年續約國外委託經營(平衡型)

投信名稱	委託金額 (美元)	目前淨資產 (美元)	102 年截至 6 月 累積投資報酬率(%)	委任迄今 (100.6.21~102.6.30)		
				投資 報酬率(%)	排名	大盤/指標 報酬率(%)
富達國際	425,533,349.13	503,848,418.13	4.97	16.35	-	12.09

97 年續約國外委託經營(全球增值債券型)

投信名稱	委託金額 (美元)	目前淨資產 (美元)	102 年截至 6 月 累積投資報酬率(%)	委任迄今 (102.1.6~102.6.30)		
				投資 報酬率(%)	排名	大盤/指標 報酬率(%)
太平洋	731,384,465.68	699,873,612.17	-4.31	-4.31	2	-3.73
盧米斯	712,476,555.58	685,212,683.38	-3.83	-3.83	1	
合計	1,443,861,021.26	1,385,086,295.55	-4.07	-4.07	—	

97 年國外委託經營(全球增值股票型)

投信名稱	委託金額 (美元)	目前淨資產 (美元)	102 年截至 6 月 累積投資報酬率(%)	委任迄今 (102.2.5~102.6.30)		
				投資 報酬率(%)	排名	大盤/指標 報酬率(%)
貝萊德	384,953,368.29	401,540,218.92	4.31	4.31	-	1.70

98 年國外委託經營(亞太(日本除外)股票型)

投信名稱	委託金額 (美元)	目前淨資產 (美元)	102 年截至 6 月 累積投資報酬率(%)	委任迄今 (98.11.17~102.6.30)		
				投資 報酬率(%)	排名	大盤/指標 報酬率(%)
景順	200,000,000	236,230,622.71	-3.84	18.12	-	15.38

100 年國外委託經營(全球基本面指數股票型)

投信名稱	委託金額 (美元)	目前淨資產 (美元)	102 年截至 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (101.3.6~102.6.30)		
				投資 報酬率(%)	排名	大盤/指標 報酬率(%)
貝萊德	200,000,000	212,603,211.64	7.08	12.27	4	12.12
道富	200,000,000	212,961,103.60	7.40	12.62	2	
瑞銀環球	200,000,000	212,917,935.41	6.97	12.63	1	
野村	200,000,000	212,848,480.30	7.14	12.57	3	
合計	800,000,000	851,330,730.95	7.15	12.52	—	

101 年國外委託經營(全球低波動指數股票型)

投信名稱	委託金額 (美元)	目前淨資產 (美元)	102 年截至 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (102.6.13~102.6.30)		
				投資 報酬率(%)	排名	大盤/指標 報酬率(%)
貝萊德	100,000,000	99,819,992.24	-0.18	-0.18	—	-0.11

2. 國外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

單位：美元

投信名稱	收回日期	收回委託 金額	經理人	收回理由
99-1 Legg Mason	102. 4. 17	1. 25 億	Bourke ○○	委託經營投資契約第 13 條規定，收回半數委託資產

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)

102 年 6 月 30 日

一、避險：

種類	避險比例
權益證券避險	0%
匯率避險	13.31%

二、投資：無

舊制勞工退休基金自營部位

(依交易目的)

102 年 6 月 30 日

一、避險：

種類	避險比例
權益證券避險	0%
匯率避險	6.52%

二、投資：無