

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 103 年 10 月底

新制基金	3.3371%
舊制基金	2.8740%

註：舊制基金自 76 年 6 月之績效為 5.0415%

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 103 年 10 月底止基金規模與收益		
基金運用規模		1 兆 2,575 億 7,774 萬元
103 年截至 10 月底止 運用總損益及評價後報酬率	自行運用	116 億 761 萬元 2.11%
	委託經營	417 億 7,092 萬元 6.82%
	合計	533 億 7,853 萬元 4.59%

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 10 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 103 年 10 月底止基金規模與收益		
基金運用規模		6,196 億 9,189 萬元
103 年截至 10 月底止 運用總損益及評價後報酬率	自行運用	148 億 4,727 萬元 4.68%
	委託經營	158 億 8,936 萬元 6.02%
	合計	307 億 3,663 萬元 5.29%

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

(二) 資產配置

1. 新制勞工退休基金

截至 103 年 10 月底

單位：新台幣元

項 目	餘 額	占基金運用比例(%)
自行運用	551,590,123,852	43.86
轉存金融機構	181,883,466,192	14.46
短期票券	42,298,123,028	3.37
公債、公司債及金融債券	167,785,954,729	13.34
貨幣型基金	0	0.00
股票及受益憑證投資(含期貨)	26,423,790,585	2.10
國外投資	133,198,789,318	10.59
固定收益	110,035,188,140	8.75
權益證券	16,245,397,058	1.29
另類投資	6,918,204,120	0.55
委託經營	705,987,616,921	56.14
國內委託經營	268,165,987,560	21.33
國外委託經營	437,821,629,361	34.81
固定收益	159,125,461,230	12.65
權益證券	226,732,483,091	18.03
另類投資	51,963,685,040	4.13
合 計	1,257,577,740,773	100.00

2. 舊制勞工退休基金

截至 103 年 10 月底

單位：新台幣元

項 目	餘 額	占基金運用比例(%)
自行運用	345,770,141,812	55.80
轉存金融機構	120,361,357,938	19.42
短期票券	14,775,443,048	2.38
公債、金融債券、公司債及證券化商品	62,612,522,859	10.11
貨幣型基金	16,000,000,000	2.58
股票及受益憑證投資(含期貨)	61,537,090,106	9.93
國外投資	70,483,727,861	11.38
固定收益	39,037,007,441	6.30
權益證券	25,131,648,678	4.06
另類投資	6,315,071,742	1.02
委託經營	273,921,743,976	44.20
國內委託經營	115,067,098,763	18.57
國外委託經營	158,854,645,213	25.63
固定收益	56,155,444,080	9.06
權益證券	93,510,154,857	15.09
另類投資	9,189,046,276	1.48
合 計	619,691,885,788	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 103 年 10 月底

單位：新台幣元

項 目	金 額	占基金運用比例 (%)
自行運用	551,590,123,852	43.86
委託經營	705,987,616,921	56.14

2. 舊制勞工退休基金

截至 103 年 10 月底

單位：新台幣元

項 目	金 額	占基金運用比例 (%)
自行運用	345,770,141,812	55.80
委託經營	273,921,743,976	44.20

(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 103 年 10 月底

單位：新台幣元

項 目	金 額	占基金運用比例 (%)
國 內 投 資	686,557,322,094	54.60
國 外 投 資	571,020,418,679	45.40

2. 舊制勞工退休基金

截至 103 年 10 月底

單位：新台幣元

項 目	金 額	占基金運用比例 (%)
國 內 投 資	390,353,512,714	62.99
國 外 投 資	229,338,373,074	37.01

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 103 年 10 月底

項 目	收益率 (%)
國內權益證券	13.83

2. 舊制勞工退休基金

截至 103 年 10 月底

項 目	收益率 (%)
國內權益證券	13.87

(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 103 年 10 月底

單位：新台幣元

項 目	金 額	比 例 (%)
國內權益證券	26,423,790,585	2.10

2. 舊制勞工退休基金

截至 103 年 10 月底

單位：新台幣元

項 目	金 額	比 例 (%)
國內權益證券	61,537,090,106	9.93

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	103 年截至 10 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (102. 9. 27~103. 10. 31)		
				投資報酬率 (%)	委託經營排名	大盤報酬率(%)
野村	7,804,845,205	9,007,390,466	12.11	15.41	—	9.65

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	103 年截至 10 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (103. 1. 20~103. 10. 31)		
				投資報酬率 (%)	委託經營排名	大盤報酬率(%)
野村	5,783,138,827	6,506,167,077	12.50	12.50	—	4.41

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 10 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (101. 7. 14~103. 10. 31)		
				投資報酬率 (%)	委託經營排名	大盤報酬率(%)
野村	3,421,364,679	4,391,727,983	12.19	28.36	1	26.33
保德信	3,423,163,553	4,184,158,091	4.13	22.23	2	
合計	6,844,528,232	8,575,886,074	8.11	25.30	—	

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 10 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (102. 3. 9~103. 10. 31)		
				投資報酬率 (%)	委託經營排名	大盤報酬率(%)
保德信	7,790,534,548	8,618,084,849	4.21	10.62	—	11.97

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 10 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (99. 11. 30~103. 10. 31)		
				投資報酬率(%)	委託經營排名	大盤報酬率(%)
永豐	5,000,000,000	5,159,495,351	1.81	3.19	3	7.26
國泰	5,000,000,000	6,311,717,678	5.42	26.23	1	
富邦	5,000,000,000	5,741,623,410	4.91	14.83	2	
滙豐中華	5,000,000,000	5,024,193,987	6.29	0.48	4	
合計	20,000,000,000	22,237,030,426	4.62	11.19	—	

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 10 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (100. 7. 15~103. 10. 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	6,565,346,811	6.41	14.90	4	5.82/ 22.73
富邦	5,000,000,000	6,590,420,998	7.83	18.38	3	
復華	11,294,673,623	13,762,586,582	7.08	19.86	2	
滙豐中華	12,034,391,172	14,770,558,010	7.70	20.43	1	
合計	33,329,064,795	41,688,912,401	7.27	18.38	—	

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 10 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (100. 8. 10~103. 10. 31)		
				投資報酬 率(%)	委託經 營排名	大盤報 酬率(%)
保德信	3,000,000,000	3,542,521,325	7.77	18.08	2	19.77
統一	3,000,000,000	3,421,222,067	10.16	14.04	3	
富邦	3,000,000,000	3,174,514,349	7.10	5.82	5	
復華	3,000,000,000	3,710,854,685	6.73	23.70	1	
摩根	3,000,000,000	3,185,242,513	2.94	6.17	4	
合計	15,000,000,000	17,034,354,939	6.95	13.56	—	

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 10 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (100. 11. 23~103. 10. 31)		
				投資報酬 率(%)	委託經 營排名	大盤報 酬率(%)
保德信	2,000,000,000	2,411,375,918	7.09	20.57	3	28.21
統一	2,000,000,000	2,429,642,574	10.00	21.48	2	
富邦	2,000,000,000	2,259,250,359	6.97	12.96	5	
復華	2,000,000,000	2,640,029,084	6.92	32.00	1	
滙豐中華	2,000,000,000	2,366,639,542	6.49	18.33	4	
摩根	2,000,000,000	2,135,467,393	2.95	6.77	6	
合計	12,000,000,000	14,242,404,870	6.78	18.69	—	

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 10 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (102.4.22~103.10.31)		
				投資報酬 率(%)	委託經 營排名	大盤報 酬率(%)
復華	4,511,827,956	5,161,977,119	7.41	14.41	—	13.16

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	103 年截至 10 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (103.8.6~103.10.31)		
				投資報酬 率(%)	委託經 營排名	大盤報 酬率(%)
復華	5,480,000,000	5,390,934,124	-1.63	-1.63	—	-1.82

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 10 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (101.4.18~103.10.31)		
				投資報酬 率(%)	委託經 營排名	大盤/指 標報酬 率(%)
國泰	4,500,000,000	5,405,976,168	7.82	26.82	2	18.31/ 30.22
滙豐中華	9,546,945,283	10,927,077,352	7.44	27.85	1	
合計	14,046,945,283	16,333,053,520	7.37	27.04	—	

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 10 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (101.7.16~103.10.31)		
				投資報酬 率(%)	委託經 營排名	大盤報 酬率(%)
野村	5,000,000,000	6,312,440,653	12.16	26.25	2	26.33
保德信	5,000,000,000	5,722,227,726	5.53	14.44	6	
國泰	5,000,000,000	6,087,501,231	11.61	21.75	3	
統一	5,000,000,000	6,891,803,668	18.24	37.84	1	
富邦	5,000,000,000	5,875,432,124	4.97	17.51	5	
滙豐中華	5,000,000,000	5,949,120,266	6.15	18.98	4	
合計	30,000,000,000	36,838,525,668	9.85	22.80	—	

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 10 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (102.6.7~103.10.31)		
				投資報酬 率(%)	委託經 營排名	大盤報 酬率(%)
國泰	2,500,000,000	2,812,053,286	4.60	12.48	2	10.85
統一	2,500,000,000	2,949,150,972	9.81	17.97	1	
富邦	2,500,000,000	2,576,068,513	-1.36	3.04	6	
復華	2,500,000,000	2,803,085,534	7.59	12.12	3	
德盛安聯	2,500,000,000	2,765,629,774	5.45	10.63	4	
摩根	2,500,000,000	2,655,375,959	3.23	6.22	5	
合計	15,000,000,000	16,561,364,038	4.91	10.41	—	

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 10 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (102.11.22~103.10.31)		
				投資報酬 率(%)	委託經 營排名	大盤報 酬率(%)
國泰	2,500,000,000	2,592,173,364	2.15	3.69	4	10.81
統一	2,500,000,000	2,776,312,793	7.97	11.05	1	
富邦	2,500,000,000	2,503,603,741	-1.06	0.14	6	
復華	2,500,000,000	2,744,631,013	7.23	9.79	2	
德盛安聯	2,500,000,000	2,700,237,658	6.35	8.01	3	
摩根	2,500,000,000	2,592,241,123	3.18	3.69	4	
合計	15,000,000,000	15,909,199,692	4.32	6.06	—	

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 10 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (103.1.20~103.10.31)		
				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	3,217,412,954	7.25	7.25	3	4.41/ 7.60
統一	3,000,000,000	3,204,588,977	6.82	6.82	4	
富邦	3,000,000,000	3,138,620,719	4.62	4.62	6	
復華	3,000,000,000	3,301,669,065	10.06	10.06	1	
群益	3,000,000,000	3,195,875,094	6.53	6.53	5	
滙豐中華	3,000,000,000	3,223,022,526	7.43	7.43	2	
合計	18,000,000,000	19,281,189,335	7.12	7.12	—	

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	103 年截至 10 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (103.8.11~103.10.31)		
				投資報酬 率(%)	委託經 營排名	大盤報 酬率(%)
國泰	7,000,000,000	6,927,741,495	-1.03	-1.03	1	-1.22
統一	7,000,000,000	6,863,023,762	-1.96	-1.96	2	
復華	7,000,000,000	6,785,629,409	-3.06	-3.06	3	
合計	21,000,000,000	20,576,394,666	-2.02	-2.02	—	

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	103 年截至 10 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (103.10.8~103.10.31)		
				投資報酬 率(%)	委託經 營排名	大盤報 酬率(%)
台新	7,000,000,000	7,040,516,881	0.58	0.58	1	-0.73
保德信	7,000,000,000	7,003,532,418	0.05	0.05	2	
群益	7,000,000,000	6,914,185,366	-1.23	-1.23	3	
合計	21,000,000,000	20,958,234,665	-0.20	-0.20	—	

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	103 年截至 10 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (102.1.26~103.10.31)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤 報酬率(%)
保德信	3,380,116,383	3,891,409,460	3.93	15.13	2	16.97
富邦	3,208,581,038	3,677,807,825	5.20	14.62	3	
統一	3,514,321,648	4,418,730,218	9.07	25.73	1	
合計	10,103,019,069	11,987,947,503	6.17	18.66	—	

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	103 年截至 10 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (103.10.22~103.10.31)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤 報酬率(%)
統一	3,000,000,000	3,007,252,694	0.24	0.24	—	3.70

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 10 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (100.3.17~103.10.31)		
				投資 報酬率(%)	委託 經營 排名	大盤 報酬率(%)
保德信	5,000,000,000	5,389,721,903	3.19	7.79	5	7.81
群益	5,000,000,000	5,791,485,143	7.10	15.83	2	
復華	5,000,000,000	5,759,362,493	6.86	15.19	3	
國泰	5,000,000,000	5,628,534,957	6.43	12.57	4	
統一	5,000,000,000	6,171,546,188	9.60	23.43	1	
合計	25,000,000,000	28,740,650,684	6.68	14.96	—	

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 10 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (101.10.30~103.10.31)		
				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	2,516,289,795	7.48	32.37	—	26.55/34.27

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 10 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (101.4.30~103.10.31)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤 報酬率(%)
保德信	5,000,000,000	5,670,628,138	4.06	13.41	6	19.98
群益	5,000,000,000	5,788,416,517	4.02	15.77	5	
匯豐中華	5,000,000,000	5,991,484,112	6.73	19.83	3	
野村	5,000,000,000	6,424,871,915	9.89	28.50	1	
國泰	5,000,000,000	5,925,490,197	7.27	18.51	4	
統一	5,000,000,000	6,003,957,099	9.61	20.08	2	
合計	30,000,000,000	35,804,847,978	6.96	19.35	—	

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	103 年截至 10 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (103.10.22~103.10.31)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤 報酬率(%)
野村	5,000,000,000	5,030,927,273	0.62	0.62	1	3.70
統一	5,000,000,000	5,018,889,085	0.38	0.38	2	
合計	10,000,000,000	10,049,816,358	0.50	0.50	—	

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	103 年截至 10 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (102. 6. 7~103. 10. 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	2,765,748,225	5.45	10.63	4	10.85
復華	2,500,000,000	2,803,227,822	7.59	12.13	3	
國泰	2,500,000,000	2,812,187,867	4.60	12.49	2	
富邦	2,500,000,000	2,576,213,523	-1.36	3.05	6	
摩根	2,500,000,000	2,655,505,791	3.23	6.22	5	
統一	2,500,000,000	2,949,303,892	9.81	17.97	1	
合計	15,000,000,000	16,562,187,120	4.91	10.41	—	

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 10 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (102. 11. 22~103. 10. 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	2,700,333,703	6.35	8.01	3	10.81
復華	2,500,000,000	2,744,732,463	7.23	9.79	2	
國泰	2,500,000,000	2,592,266,988	2.16	3.69	5	
富邦	2,500,000,000	2,503,701,107	-1.05	0.15	6	
摩根	2,500,000,000	2,592,335,944	3.18	3.69	4	
統一	2,500,000,000	2,776,418,676	7.98	11.06	1	
合計	15,000,000,000	15,909,788,881	4.32	6.07	—	

(二) 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	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	林○○	委託經營投資契約第 23 條規定，收回全數委託資產
101-1 富邦	103.8.5	45 億	詹○○	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

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	103年截至10月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (101.5.21~103.10.31)		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率(%)
坦伯頓	500,000,000	728,319,039	-1.48	56.83	—	48.32

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10月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (101.6.4~103.10.31)		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率(%)
聯博	750,000,000	770,626,887	1.97	2.75	2	1.94
高盛	400,000,000	404,597,005	-0.69	1.15	3	
坦伯頓	650,000,000	752,475,264	4.35	15.77	1	
合計	1,800,000,000	1,927,699,156	2.31	7.09	—	

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10月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (102.1.7~103.10.31)		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率(%)
太平洋	615,416,988	618,875,578	2.80	0.56	1	0.15
高盛	479,694,715	474,777,552	-0.66	-1.03	2	
合計	1,095,111,703	1,093,653,130	1.27	-0.13	—	

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 10 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (102.2.5~103.10.31)		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率(%)
貝萊德	584,277,868	703,831,476	6.84	31.02	1	23.02
摩根	587,857,352	732,683,302	5.14	24.64	2	
合計	1,172,135,220	1,436,514,778	5.86	27.21	—	

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 10 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (102.11.18~103.10.31)		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率(%)
景順	471,501,358	514,055,921	8.16	9.03	—	5.91

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 10 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (102.12.2~103.10.31)		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率(%)
貝萊德	299,329,552	318,790,549	4.61	6.50	2	6.27
道富	349,680,272	372,768,737	4.77	6.60	1	
合計	649,009,824	691,559,286	4.70	6.56	—	

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	103年截至10月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (103.8.25~103.10.31)		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率(%)
摩根士丹利	403,049,882	382,931,040	-4.99	-4.99	2	-5.79
瑞萬通博	716,993,858	703,755,354	-1.85	-1.85	1	
合計	1,120,043,740	1,086,686,394	-2.98	-2.98	—	

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	103年截至10月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (100.7.1~103.10.31、 100.7.13~103.10.31)		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率(%)
道富	300,000,000	390,553,268	3.10	30.18	2	28.97
貝萊德	300,000,000	399,726,093	2.91	33.24	1	32.63
合計	600,000,000	790,279,361	3.00	31.71	—	—

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10月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (101.3.6~103.10.31)		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率(%)
Cohen & Steers	550,000,000	655,925,771	13.09	35.67	2	31.50
景順	600,000,000	726,451,174	14.23	36.68	1	
EII	400,000,000	491,487,735	9.76	29.14	3	
合計	1,550,000,000	1,873,864,680	12.54	33.83	—	

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10月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (101.7.31~103.10.31)		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率(%)
Ashmore	300,000,000	300,466,734	4.18	3.44	1	4.41
Bluebay	300,000,000	298,790,720	3.86	1.76	2	
實港	300,000,000	292,625,901	4.04	-0.62	4	
Pictet	300,000,000	297,377,773	4.47	1.06	3	
合計	1,200,000,000	1,189,261,128	4.14	1.41	—	

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	103年截至10月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (102.4.18~103.10.31)		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率(%)
道富	500,000,000	552,563,582	8.24	10.26	1	9.95
貝萊德	500,000,000	551,149,694	8.41	9.96	2	
合計	1,000,000,000	1,103,713,276	8.32	10.11	—	

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10月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (103.1.22~103.10.31)		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率(%)
瑞萬通博	500,000,000	522,790,055	7.55	7.55	1	4.26
MFS	500,000,000	500,068,382	3.46	3.46	3	
威靈頓	500,000,000	504,775,028	4.95	4.95	2	
合計	1,500,000,000	1,527,633,465	5.33	5.33	—	

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10月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (103.4.25~103.10.31)		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率(%)
Bluebay	300,000,000	296,826,640	-0.42	-0.42	3	0.05
貝萊德	300,000,000	297,705,182	-0.26	-0.26	2	
盧米斯	300,000,000	298,169,486	-0.16	-0.16	1	
合計	900,000,000	892,701,308	-0.28	-0.28	—	

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	103年截至10月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (100.6.21~103.10.31)		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率(%)
富達國際	425,533,349	563,549,698	3.70	30.14	—	29.35

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10月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (102.1.6~103.10.31)		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率(%)
太平洋	731,384,466	731,364,903	2.52	-0.003	1	0.15
盧米斯	712,476,555	708,467,741	1.43	-0.56	2	
合計	1,443,861,021	1,439,832,644	1.98	-0.28	—	

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 10 月 累積投資報 酬(%)	委任迄今 (102.2.5~103.10.31)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
貝萊德	384,953,368	504,417,529	6.87	31.03	-	23.02

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 10 月 累積投資報 酬(%)	委任迄今 (102.11.17~103.10.31)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
景順	262,187,756	287,431,536	8.45	9.63	-	5.91

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 10 月 累積投資報 酬(%)	委任迄今 (101.3.6~103.10.31)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
貝萊德	300,000,000	365,495,768	3.02	36.16	3	35.76
道富	300,000,000	365,948,257	3.02	36.59	1	
瑞銀環球	300,000,000	364,425,935	2.73	35.99	4	
野村	300,000,000	365,562,088	2.91	36.46	2	
合計	1,200,000,000	1,461,432,048	2.92	36.30	-	

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 10 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (102.6.13~103.10.31)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
貝萊德	300,000,000	326,406,888	8.18	13.88	—	13.94

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 10 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (103.1.22~103.10.31)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
瑞萬通博	150,000,000	160,266,314	7.62	7.62	1	4.26
MFS	150,000,000	154,093,831	3.62	3.62	3	
威靈頓	150,000,000	156,006,438	5.08	5.08	2	
合計	450,000,000	470,366,583	5.44	5.44	—	

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	103 年截至 10 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (103.5.29~103.10.31)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
Lazard	100,000,000	99,191,511	0.08	0.08	2	1.86
Cohen & Steers	100,000,000	100,476,262	1.45	1.45	1	
合計	200,000,000	199,667,773	0.76	0.76	—	

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	103 年截至 10 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (103.8.27~103.10.31)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
PGI	50,000,000	50,255,783	0.51	0.51	2	0.004
AMP	50,000,000	50,378,899	0.76	0.76	1	
合計	100,000,000	100,634,682	0.63	0.63	—	

(二)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

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)

103年10月31日

1. 避險：

種類	避險比例
權益證券避險	0%
匯率避險	7.32%

2. 投資：無

(二)舊制勞工退休基金自營部位

(依交易目的)

103年10月31日

1. 避險：

種類	避險比例
權益證券避險	0%
匯率避險	1.30%

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
103年10月	9,137,270,780	12,082,543,920	2,945,273,140

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
103年10月	3,549,333,067	3,713,496,325	164,163,258

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

103年10月份

單位：新台幣元

項 目	金 額
基金收入	259,788,829,975
基金支出	261,232,644,155
現金增(減)數	-1,443,814,180

註：本表採現金基礎。

(二)舊制勞工退休基金

103年10月份

單位：新台幣元

項 目	金 額
基金收入	63,336,672,379
基金支出	63,337,394,126
現金增(減)數	-721,747

註：本表採現金基礎。