

勞工退休基金運用情形

一、勞工退休基金整體績效

(一) 115 年截至 3 月底績效

基金與指標	新制基金	舊制基金	臺灣 10 年期 公債殖利率	臺灣加權 股價指數	MSCI 全球 股票指數	Bloomberg 全球債券指數
收益率/報酬率	5.47%	9.83%	1.43%	9.53%	-3.20%	-1.07%

註 1：股、債指數係依據勞動部 111 年 4 月 29 日勞動福 4 字第 1110145465 號函核定之勞動基金投資政策書所載參考指標，且均為原幣別報酬率。

註 2：收益率係評價後收益數÷日平均餘額。

(二) 近一年(114 年)績效

基金與指標	新制基金	舊制基金	臺灣 10 年期 公債殖利率	臺灣加權 股價指數	MSCI 全球 股票指數	Bloomberg 全球債券指數
收益率/報酬率	15.60%	22.53%	1.47%	25.74%	22.34%	8.17%

(三) 近三年(112~114 年)平均績效

基金與指標	新制基金	舊制基金	臺灣 10 年期 公債殖利率	臺灣加權 股價指數	MSCI 全球 股票指數	Bloomberg 全球債券指數
收益率/報酬率	14.91%	19.00%	1.40%	27.01%	20.65%	3.98%

(四) 近五年(110~114 年)平均績效

基金與指標	新制基金	舊制基金	臺灣 10 年期 公債殖利率	臺灣加權 股價指數	MSCI 全球 股票指數	Bloomberg 全球債券指數
收益率/報酬率	10.28%	12.12%	1.17%	14.48%	11.19%	-2.15%

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

115 年 3 月底止基金規模與收益			
基金運用規模		5 兆 4,323 億 7,906 萬元	
115 年截至 3 月底止 運用收益數及收益率	自行運用	國內固定收益	41 億 6,047 萬元 1.82%
		國內權益證券 及國外投資	837 億 8,019 萬元 7.80%
	委託經營		2,002 億 4,523 萬元 6.12%
	合 計		2,881 億 8,589 萬元 5.47%

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：收益率係以當期收益率列示，惟國內固定收益係以年化收益率列示。

註 3：115 年 3 月之保證收益率為 1.7108%。

2. 舊制勞工退休基金

115 年 3 月底止基金規模與收益			
基金運用規模		11,018 億 7,470 萬元	
115 年截至 3 月底止 運用收益數及收益率	自行運用	國內固定收益	11 億 1,263 萬元 1.72%
		國內權益證券 及國外投資	345 億 8,633 萬元 17.38%
	委託經營		535 億 2,378 萬元 8.78%
	合 計		892 億 2,274 萬元 9.83%

註：評價後報酬率係以當期報酬率（即收益÷115 年之日平均餘額）列示，惟國內固定收益係以年化報酬率列示。

(二) 資產配置

1. 新制勞工退休基金

115年3月31日

單位：新臺幣元

項 目	餘 額	占基金運用比率(%)
自行運用	2,030,548,903,388	37.38
轉存金融機構	539,000,516,913	9.92
短期票券	126,144,961,054	2.32
公債、公司債、金融債券及特別股	247,398,098,097	4.56
股票及受益憑證投資(含期貨)	294,916,473,298	5.43
國外投資	823,088,854,026	15.15
固定收益	705,413,959,933	12.98
權益證券	70,940,137,440	1.31
另類投資	46,734,756,653	0.86
委託經營	3,401,830,156,578	62.62
國內委託經營	858,114,899,169	15.80
國外委託經營	2,543,715,257,409	46.82
固定收益	573,717,349,033	10.56
權益證券	1,415,972,359,796	26.06
另類投資	554,025,548,580	10.20
合 計	5,432,379,059,966	100.00

2. 舊制勞工退休基金

115年3月31日

單位：新臺幣元

項 目	餘 額	占基金運用比率(%)
自行運用	464,879,275,632	42.19
轉存金融機構	127,440,875,273	11.57
短期票券	57,047,796,776	5.18
公債、金融債券、公司債及證券化商品	90,701,879,368	8.23
股票及受益憑證投資(含期貨)	122,925,052,696	11.15
國外投資	66,763,671,519	6.06
固定收益	36,247,107,869	3.29
權益證券	28,026,080,031	2.54
另類投資	2,490,483,619	0.23
委託經營	636,995,424,130	57.81
國內委託經營	153,907,814,001	13.97
國外委託經營	483,087,610,129	43.84
固定收益	107,937,883,777	9.80
權益證券	256,515,293,681	23.28
另類投資	118,634,432,671	10.76
合 計	1,101,874,699,762	100.00

(三) 基金自營投資與委外投資比率

1. 新制勞工退休基金

115年3月31日

單位：新臺幣元

項 目	金 額	占基金運用比率(%)
自行運用	2,030,548,903,388	37.38
委託經營	3,401,830,156,578	62.62

2. 舊制勞工退休基金

115年3月31日

單位：新臺幣元

項 目	金 額	占基金運用比率(%)
自行運用	464,879,275,632	42.19
委託經營	636,995,424,130	57.81

(四)基金國內投資與國外投資比率

1. 新制勞工退休基金

115年3月31日

單位：新臺幣元

項 目	金 額	占基金運用比率(%)
國內投資	2,065,574,948,531	38.03
國外投資	3,366,804,111,435	61.97

2. 舊制勞工退休基金

115年3月31日

單位：新臺幣元

項 目	金 額	占基金運用比率(%)
國內投資	552,023,418,114	50.10
國外投資	549,851,281,648	49.90

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

115年截至3月底

項 目	收益率(%)
國內權益證券	23.55

2. 舊制勞工退休基金

115年截至3月底

項 目	收益率(%)
國內權益證券	27.67

(二)基金自營股票及受益憑證投資比率概況

1. 新制勞工退休基金

115年3月31日 單位：新臺幣元

項 目	金 額	比 率 (%)
國內權益證券	294,916,473,298	5.43

2. 舊制勞工退休基金

115年3月31日 單位：新臺幣元

項 目	金 額	比 率 (%)
國內權益證券	122,925,052,696	11.15

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6)

單位：新臺幣元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	115年截至3月 累積投資報酬 (%)	委任迄今 (114.9.27~115.3.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	目標報酬率 (%)
野村	53,037,175,831	77,504,656,366	22.57	46.13	—	3.20

註：本批次為絕對報酬型，契約目標報酬率係以臺灣證交所公告之最近5年年底股票集中市場平均殖利率加計300個基本點為基準。

97年第一次委託經營(續約5)

單位：新臺幣元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	115年截至3月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (112.1.30~115.3.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	目標報酬率 (%)
野村	6,829,066,771	17,794,012,792	24.42	160.56	—	19.23

註：本批次為絕對報酬型，契約目標報酬率係以臺灣證交所公告之最近5年年底股票集中市場平均殖利率加計250個基本點為基準。

98 年第一次委託經營(續約 5)

單位：新臺幣元

投信 名稱	委託金額	目前淨資產	115 年截至 3 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (113.7.16~115.3.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	目標報酬率 (%)
野村	25,455,695,879	43,996,746,507	22.23	72.84	1	10.07
玉山	7,430,070,832	9,769,676,123	4.04	31.49	2	
合計	32,885,766,711	53,766,422,630	18.46	63.49	—	

註：1.本批次為絕對報酬型，契約目標報酬率係以臺灣證交所公告之最近 5 年年底股票集中市場平均殖利率加計 250 個基本點為基準。

99 年第二次委託經營(續約 3)

單位：新臺幣元

投信 名稱	委託金額	目前淨資產	115 年截至 3 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (111.12.5~115.3.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	目標報酬率 (%)
國泰	10,445,113,310	18,838,319,836	12.80	80.36	—	20.18

註：本批次為絕對報酬型，契約目標報酬率係以臺灣證交所公告之最近 5 年年底股票集中市場平均殖利率加計 250 個基本點為基準。

100 年第一次委託經營(續約 3)(相對報酬)

單位：新臺幣元

投信 名稱	委託金額	目前淨資產	115 年截至 3 月 累積投資報酬 (%)	委任迄今 (112.7.15~115.3.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
復華	29,101,525,086	55,930,165,434	15.33	92.19	—	80.94

註：本批次為相對報酬型，以臺灣就業 99 指數為指定指標。

101 年第二次委託經營(續約 3)

單位：新臺幣元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	115 年截至 3 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (113.7.20~115.3.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	目標報酬率 (%)
野村	15,198,354,580	30,710,667,236	28.46	102.07	1	10.00
統一	20,913,151,881	29,642,525,226	7.09	41.74	2	
合計	36,111,506,461	60,353,192,462	16.99	67.13	—	

註：本批次為絕對報酬型，契約目標報酬率係以臺灣證交所公告之最近 5 年年底股票集中市場平均殖利率加計 250 個基本點為基準。

102 年第二次委託經營(續約 3) (相對報酬)

單位：新臺幣元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	115 年截至 3 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (115.1.24~115.3.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
統一	37,517,851,631	38,698,097,497	3.15	3.15	1	-0.55
復華	39,053,243,767	39,704,289,538	1.67	1.67	2	
合計	76,571,095,398	78,402,387,035	2.39	2.39	—	

註：本批次為相對報酬型，以臺灣加權股價報酬指數為指定指標。

103 年第一次委託經營(續約 2)

單位：新臺幣元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	115 年截至 3 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (111.10.11~115.3.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	目標報酬率 (%)
台新	15,841,461,125	31,972,859,154	13.52	101.83	—	21.11

註：本批次為絕對報酬型，契約目標報酬率係以臺灣證交所公告之最近 5 年年底股票集中市場平均殖利率加計 250 個基本點為基準。

103 年第二次委託經營(續約 2) (相對報酬)

單位：新臺幣元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	115 年截至 3 月 累積投資報酬 (%)	委任迄今 (114.12.1~115.3.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
國泰	23,658,255,796	27,009,000,378	8.20	14.16	2	12.70
統一	20,210,724,588	22,843,906,843	7.13	13.03	5	
復華	19,554,752,074	22,431,400,547	8.08	14.71	1	
滙豐	16,812,903,049	19,075,758,467	7.58	13.46	4	
安聯	24,098,049,298	27,425,198,844	8.01	13.81	3	
合計	104,334,684,805	118,785,265,079	7.83	13.85	—	

註：本批次為相對報酬型，以臺灣高薪 100 報酬指數為指定指標。

104 年第一次委託經營 (續約 2)

單位：新臺幣元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	115 年截至 3 月 累積投資報酬 (%)	委任迄今 (112.4.6~115.3.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	目標報酬率 (%)
復華	4,799,121,512	9,770,024,645	14.66	103.58	1	18.07
安聯	3,601,238,896	6,310,252,305	8.58	75.22	2	
合計	8,400,360,408	16,080,276,950	12.20	91.42	—	

註：本批次為絕對報酬型，契約目標報酬率係以臺灣證交所公告之最近 5 年年底股票集中市場平均殖利率加計 250 個基本點為基準。

106 年第一次委託經營 (續約)

單位：新臺幣元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	115 年截至 3 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (112.2.7~115.3.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	目標報酬率 (%)
安聯	15,088,712,403	35,980,091,424	21.11	143.17	1	19.09
國泰	5,018,453,600	9,479,237,064	14.73	74.31	4	
群益	6,382,621,945	11,156,106,690	13.58	74.79	3	
滙豐	7,096,535,878	13,015,064,998	17.25	83.40	2	
合計	33,586,323,826	69,630,500,176	18.23	105.72	—	

註：本批次為絕對報酬型，契約目標報酬率係以臺灣證交所公告之最近 5 年年底股票集中市場平均殖利率加計 250 個基本點為基準。

107 年第一次委託經營(續約)(相對報酬)

單位：新臺幣元

投信 名稱	委託金額	目前淨資產	115 年截至 3 月 累積投資報酬 (%)	委任迄今 (112.10.24~115.3.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
台新	8,254,694,051	17,835,723,282	9.54	116.07	6	114.27
安聯	12,775,472,416	27,823,811,285	10.50	117.79	5	
玉山	9,403,481,285	20,665,712,889	9.05	119.77	3	
統一	12,635,490,783	27,208,487,212	10.17	115.33	7	
國泰	10,445,956,159	23,497,653,390	11.96	124.94	1	
復華	7,235,716,436	15,759,701,977	10.18	117.80	4	
群益	4,439,275,178	9,897,221,534	9.87	122.95	2	
合計	65,190,086,308	142,688,311,569	10.26	118.88	—	

註：1.本批次為相對報酬型，以臺灣永續報酬指數為指定指標。

107 年第二次委託經營 (續約)

單位：新臺幣元

投信 名稱	委託金額	目前淨資產	115 年截至 3 月 累積投資報酬 (%)	委任迄今 (113.5.24~115.3.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	目標報酬率 (%)
安聯	13,613,817,760	24,598,906,644	21.08	81.52	3	10.95
施羅德	11,400,361,947	21,345,594,751	15.47	87.24	2	
統一	13,638,402,860	22,147,960,015	13.74	62.90	5	
野村	20,601,693,072	43,328,696,926	28.53	111.46	1	
國泰	19,457,627,824	30,315,643,188	16.97	55.80	6	
復華	9,724,896,734	15,997,606,664	14.67	64.50	4	
合計	88,436,800,197	157,734,408,188	19.63	79.03	—	

註：本批次為絕對報酬型，契約目標報酬率係以臺灣證交所公告之最近 5 年年底股票集中市場平均殖利率加計 250 個基本點為基準。

109 年第一次委託經營

單位：新臺幣元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	115 年截至 3 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (110.5.13~115.3.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	目標報酬率 (%)
台新	8,000,000,000	14,511,285,843	10.97	81.39	4	27.57
安聯	8,000,000,000	16,509,293,416	14.30	106.37	2	
玉山	8,000,000,000	13,722,643,921	5.76	71.53	5	
國泰	8,000,000,000	15,830,488,290	14.48	97.88	3	
野村	8,000,000,000	20,486,064,264	22.88	156.08	1	
合計	40,000,000,000	81,059,775,734	14.18	102.65	—	

註：1.本批次為絕對報酬型，契約目標報酬率係以臺灣證交所公告之最近5年年底股票集中市場平均殖利率加計200個基本點為基準。

109 年第二次委託經營（相對報酬）

單位：新臺幣元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	115 年截至 3 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (111.5.13~115.3.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
安聯	3,000,000,000	5,412,327,652	6.30	74.03	5	80.32
玉山	3,000,000,000	5,426,360,610	4.43	75.86	3	
野村	3,000,000,000	5,569,876,673	4.71	76.55	2	
國泰	3,000,000,000	5,669,341,748	5.13	81.46	1	
富邦	3,000,000,000	5,529,225,736	7.02	75.75	4	
合計	15,000,000,000	27,607,132,419	5.51	76.75	—	

註：本批次為相對報酬型，以臺灣企業社會責任中小型報酬指數為指定指標。

110 年第一次委託經營

單位：新臺幣元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	115 年截至 3 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (110.12.15~115.3.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	目標報酬率 (%)
安聯	8,000,000,000	17,185,394,354	21.27	121.21	3	26.18
玉山	8,000,000,000	12,626,354,180	4.06	60.93	6	
國泰	8,000,000,000	14,781,312,413	16.82	93.89	4	
第一金	8,000,000,000	13,077,932,083	24.27	63.15	5	
野村	8,000,000,000	18,510,289,118	22.83	133.55	1	
富邦	8,000,000,000	17,675,639,048	24.97	125.25	2	
合計	48,000,000,000	93,856,921,196	19.27	99.72	—	

註：1.本批次為絕對報酬型，契約目標報酬率係以臺灣證交所公告之最近5年年底股票集中市場平均殖利率加計250個基本點為基準。

111 年第一次委託經營

單位：新臺幣元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	115 年截至 3 月 累積投資報酬 (%)	委任迄今 (112.10.5~115.3.31)		
				投資 報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
安聯	7,000,000,000	10,155,732,943	8.23	65.60	5	14.90
施羅德	7,000,000,000	13,228,668,047	14.60	117.79	2	
國泰	7,000,000,000	11,452,532,531	15.02	94.74	3	
第一金	7,000,000,000	11,731,956,348	23.99	65.26	6	
野村	7,000,000,000	14,835,339,208	28.81	139.28	1	
華南 永昌	7,000,000,000	8,284,415,453	12.73	27.28	7	
滙豐	7,000,000,000	11,039,666,706	17.43	75.37	4	
合計	49,000,000,000	80,728,311,236	17.66	83.53	—	

註：本批次為絕對報酬型，契約目標報酬率係以臺灣證交所公告之最近5年年底股票集中市場平均殖利率加計250個基本點為基準。

112 年第一次委託經營（相對報酬）

單位：新臺幣元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	115 年截至 3 月 累積投資報酬 (%)	委任迄今 (114.4.1~115.3.31)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標報酬率 (%)
安聯	4,000,000,000	6,020,741,716	11.31	78.19	1	57.76
兆豐 國際	4,000,000,000	5,729,429,998	10.04	67.03	2	
宏利	4,000,000,000	5,845,371,340	14.43	66.83	3	
施羅德	4,000,000,000	5,546,498,483	9.65	57.81	6	
野村	4,000,000,000	5,613,455,186	10.48	59.77	5	
摩根	4,000,000,000	5,795,264,249	12.42	65.39	4	
合計	24,000,000,000	34,550,760,972	11.39	65.84	—	

註：本批次為相對報酬型，以臺灣加權股價報酬指數為指定指標。

113 年第一次委託經營

單位：新臺幣元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	115 年截至 3 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (114.11.14~115.3.31)		
				投資 報酬率(%)	排名	目標報酬率 (%)
安聯	6,000,000,000	6,895,870,423	13.12	18.20	5	2.37
貝萊德	6,000,000,000	7,086,437,248	17.62	21.96	3	
施羅德	6,000,000,000	7,025,058,513	12.66	20.04	4	
野村	6,000,000,000	7,281,035,804	19.96	25.61	1	
摩根	6,000,000,000	7,214,320,398	18.36	22.94	2	
合計	30,000,000,000	35,502,722,386	16.33	21.76	—	

註：本批次為絕對報酬型，契約目標報酬率係以臺灣證交所公告之最近 5 年年底股票集中市場平均殖利率加計 300 個基本點為基準。

2. 舊制勞工退休基金

國內 98 年第二次委託經營(續約 5)

單位：新臺幣元

投信 名稱	委託金額	目前淨資產	115 年截至 3 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (114.1.28~115.3.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	目標報酬率 (%)
富邦	15,603,507,854	26,782,335,058	25.83	71.64	1	7.40
統一	13,492,877,440	20,461,390,106	13.06	51.65	2	
合計	29,096,385,294	47,243,725,164	19.96	62.37	—	

註：本批次為絕對報酬型，契約目標報酬率係以臺灣證交所公告之最近 5 年年底股票集中市場平均殖利率加計 300 個基本點為基準。

國內 101 年第一次委託經營(相對報酬)(續約 3)

單位：新臺幣元

投信 名稱	委託金額	目前淨資產	115 年截至 3 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (113.11.2~115.3.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
滙豐	6,530,798,735	9,740,560,495	11.10	49.15	—	43.97

註：本批次為相對報酬型，以臺灣加權股價報酬指數為指定指標。

國內 101 年第二次委託經營(續約 3)

單位：新臺幣元

投信 名稱	委託金額	目前淨資產	115 年截至 3 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (113.05.04~115.3.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	目標報酬率 (%)
野村	27,357,530,009	59,559,389,221	27.15	117.71	—	11.29

註：本批次為絕對報酬型，契約目標報酬率係以臺灣證交所公告之最近 5 年年底股票集中市場平均殖利率加計 250 個基本點為基準。

國內 104 年第一次委託經營(續約 2)

單位：新臺幣元

投信 名稱	委託金額	目前淨資產	115 年截至 3 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (112. 4. 6~115. 3. 31)		
				投資報酬率 (%)	排名	目標報酬率 (%)
復華	4,800,107,976	9,771,829,267	14.66	103.58	1	18.07
安聯	3,601,947,821	6,311,426,892	8.58	75.22	2	
合計	8,402,055,797	16,083,256,159	12.19	91.42	—	

註：本批次為絕對報酬型，契約目標報酬率係以臺灣證交所公告之最近 5 年年底股票集中市場平均殖利率加計 250 個基本點為基準。

國內 106 年第一次委託經營(續約)

單位：新臺幣元

投信 名稱	委託金額	目前淨資產	115 年截至 3 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (112. 2. 7~115. 3. 31)		
				投資報酬率 (%)	排名	目標報酬率 (%)
安聯	15,089,937,312	35,983,801,556	21.11	143.17	1	19.09
國泰	5,019,107,110	9,480,809,183	14.73	74.32	4	
群益	6,384,957,618	11,163,194,836	13.57	74.84	3	
滙豐	7,097,524,598	13,017,130,050	17.25	83.40	2	
合計	33,591,526,638	69,644,935,625	18.23	105.73	—	

註：本批次為絕對報酬型，契約目標報酬率係以臺灣證交所公告之最近 5 年年底股票集中市場平均殖利率加計 250 個基本點為基準。

國內 109 年第二次委託經營

單位：新臺幣元

投信 名稱	委託金額	目前淨資產	115 年截至 3 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (111. 5. 13~115. 3. 31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
安聯	1,000,000,000	1,804,423,766	6.30	74.10	5	80.32
玉山	1,000,000,000	1,809,026,478	4.43	75.88	4	
野村	1,000,000,000	1,856,877,122	4.71	76.58	2	
國泰	1,000,000,000	1,890,070,110	5.13	81.52	1	
富邦	1,000,000,000	1,843,447,788	7.03	75.90	3	
合計	5,000,000,000	9,203,845,264	5.51	76.81	—	

註：本批次為相對報酬型，以臺灣企業社會責任中小型報酬指數為指定指標。

國內 111 年第一次委託經營

單位：新臺幣元

投信 名稱	委託金額	目前淨資產	115 年截至 3 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (112.10.5~115.3.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	目標報酬率 (%)
安聯	3,000,000,000	4,310,802,909	8.64	67.38	5	14.90
施羅德	3,000,000,000	5,567,228,965	14.61	118.80	2	
國泰	3,000,000,000	4,872,218,390	15.05	98.14	3	
第一金	3,000,000,000	5,128,524,597	23.76	65.76	6	
野村	3,000,000,000	6,243,573,073	28.82	138.46	1	
華南 永昌	3,000,000,000	3,601,581,881	12.69	30.35	7	
滙豐	3,000,000,000	4,673,958,390	17.45	76.65	4	
合計	21,000,000,000	34,397,888,205	17.69	85.02	—	

註：本批次為絕對報酬型，契約目標報酬率係以臺灣證交所公告之最近 5 年年底股票集中市場平均殖利率加計 250 個基本點為基準。

(二) 115 年 3 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. 受託機構經營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 全球主動債券型 (續約 3)

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	115 年截至 3 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (110.6.7~115.3.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
聯博	987,613,021	892,006,447	-1.72	-10.63	2	-10.77
富蘭克林 坦伯頓	1,351,737,838	1,329,760,696	-1.78	-7.55	1	
合計	2,339,350,859	2,221,767,143	-1.76	-9.18	—	

97-2 全球增值債券型 (續約 3)

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	115 年截至 3 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (111.1.6~115.3.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
PIMCO	2,408,967,886	2,358,655,874	-2.55	-5.20	—	-7.42

97-2 全球增值股票型 (續約 3)

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	115 年截至 3 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (111.2.6~115.3.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
貝萊德	1,834,805,538	2,932,615,041	0.65	61.74	1	45.67
JPMorgan	1,585,120,883	2,318,754,201	-2.97	48.12	2	
合計	3,419,926,421	5,251,369,242	-0.98	55.44	—	

98-1 亞太（日本除外）主動股票型（續約 3） 單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	115 年截至 3 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (111.11.17~115.3.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
景順	656,507,639	1,115,086,813	0.98	69.85	—	54.53

98-1 全球被動股票型（續約 3） 單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	115 年截至 3 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (111.12.4~115.3.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
貝萊德	1,241,092,316	1,962,736,347	-2.87	63.73	2	62.63
道富	1,663,655,177	2,637,290,560	-3.09	64.72	1	
合計	2,904,747,493	4,600,026,907	-3.00	64.29	—	

100-1 全球基本面指數被動股票型（續約 2） 單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	115 年截至 3 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (110.7.1~115.3.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
道富	934,565,605	1,533,551,587	2.84	64.09	1	60.42
貝萊德	939,726,931	1,536,967,728	2.71	63.55	2	
合計	1,874,292,536	3,070,519,315	2.77	63.82	—	

100-1 全球不動產有價證券型（續約 2） 單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	115 年截至 3 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (111.3.6~115.3.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
Cohen & Steers	2,555,932,432	2,648,493,426	0.48	1.79	1	-1.30
景順	1,567,127,452	1,526,784,252	0.89	-3.38	2	
合計	4,123,059,884	4,175,277,678	0.63	-0.17	—	

101-1 全球新興市場主動債券型 (續約 2)

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	115 年截至 3 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (111. 7. 31~115. 3. 31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
Pictet	618, 843, 493	761, 896, 210	-2. 65	23. 69	—	25. 44

101-1 全球低波動指數被動股票型 (續約 2)

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	115 年截至 3 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (112. 4. 18~115. 3. 31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
道富	1, 263, 392, 347	1, 577, 424, 532	-0. 39	27. 31	2	26. 32
貝萊德	1, 352, 011, 599	1, 687, 370, 610	-0. 36	27. 60	1	
合計	2, 615, 403, 946	3, 264, 795, 142	-0. 38	27. 46	—	

102-1 全球高股利增值股票型 (續約 2)

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	115 年截至 3 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (113. 1. 22~115. 3. 31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
瑞萬通博	1, 796, 000, 834	1, 987, 220, 781	-3. 21	11. 23	3	36. 66
MFS	1, 164, 480, 846	1, 602, 955, 916	6. 20	38. 29	1	
威靈頓	1, 507, 914, 919	2, 067, 002, 248	3. 24	37. 86	2	
合計	4, 468, 396, 599	5, 657, 178, 945	1. 66	27. 27	—	

102-1 全球信用主動債券型 (續約 2)

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	115 年截至 3 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (113.4.25~115.3.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
RBC	1,186,559,371	1,347,633,634	-1.63	14.19	1	13.32
貝萊德	670,392,768	757,239,288	-1.53	12.95	3	
盧米斯	941,561,542	1,061,294,436	-1.36	13.06	2	
合計	2,798,513,681	3,166,167,358	-1.51	13.50	—	

104-1 全球高品質被動股票型 (續約 2)

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	115 年截至 3 月 累積投資報酬 (%)	委任迄今 (114.8.11~115.3.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
北美信託	3,222,313,413	3,437,311,274	-2.93	6.72	1	6.63
LGIM	3,208,355,339	3,413,492,364	-3.10	6.44	3	
Geode	3,189,006,741	3,396,032,975	-3.05	6.54	2	
合計	9,619,675,493	10,246,836,613	-3.02	6.57	—	

104-2 全球基礎建設有價證券型 (續約 2)

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	115 年截至 3 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (114.9.25~115.3.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
Magellan	1,159,305,130	1,274,057,261	5.87	9.90	2	12.34
RREEF	1,668,471,152	1,844,705,522	9.57	10.56	1	
合計	2,827,776,282	3,118,762,783	8.03	10.29	—	

104-1 全球主權信用增值債券型 (續約)

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	115 年截至 3 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (114. 11. 13~115. 3. 31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率(%)
盧米斯	819, 799, 803	795, 268, 617	-3. 92	-2. 99	—	-2. 99

105-1 全球多元資產型 (續約)

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	115 年截至 3 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (110. 7. 20~115. 3. 31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標/目標報酬率(%)
Allianz	878, 698, 278	1, 267, 935, 153	7. 54	54. 10	1	18. 06/41. 56
JPMorgan	1, 645, 715, 430	1, 920, 326, 047	-2. 80	16. 69	3	
DWS	1, 175, 711, 371	1, 437, 993, 573	-1. 48	25. 75	2	
柏瑞	315, 326, 657	376, 891, 760	-4. 08	5. 95	4	
合計	4, 015, 451, 736	5, 003, 146, 533	-0. 16	23. 76	—	

註：本批次為絕對報酬型，契約目標報酬率係以 US 3-Month T-Bill (指標報酬率)加計 500 個基本點為基準。

105-1 亞太混合指數增值股票型 (續約)

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	115 年截至 3 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (110. 8. 24~115. 3. 31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
貝萊德	949, 175, 052	1, 334, 474, 655	1. 49	40. 59	—	35. 38

106-1 全球 ESG 混合指數被動股票型(續約)

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	115 年截至 3 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (111. 6. 22~115. 3. 31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
貝萊德	641, 552, 002	989, 287, 306	-0. 13	60. 81	4	60. 25
DWS	848, 715, 051	1, 274, 391, 226	-0. 20	64. 36	1	
道富	849, 045, 562	1, 290, 031, 792	-0. 21	64. 15	2	
北美信託	762, 047, 560	1, 181, 992, 669	-0. 10	62. 60	3	
合計	3, 101, 360, 175	4, 735, 702, 993	-0. 16	63. 05	—	

106-1 絕對報酬債券型(續約)

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	115 年截至 3 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (111. 7. 25~115. 3. 31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標/目標 報酬率(%)
American Century	427, 360, 620	515, 426, 558	0. 32	20. 61	3	17. 51/26. 73
富達	905, 211, 657	1, 148, 179, 845	0. 30	25. 51	1	
TCW	1, 039, 618, 153	1, 270, 283, 546	0. 49	22. 17	2	
合計	2, 372, 190, 430	2, 933, 889, 949	0. 39	23. 31	—	

註：本批次為絕對報酬型，契約目標報酬率係以 US 3-Month T-Bill(指標報酬率)加計 250 個基本點為基準。

107-1 絕對報酬股票型 (續約)

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	115年截至3月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (113.1.23~115.3.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標/目標 報酬率(%)
景順	906,698,949	1,253,907,692	0.99	41.40	1	9.89/20.83
威靈頓	787,219,463	969,600,503	-4.09	23.17	4	
CPR	858,885,217	1,129,487,219	3.17	33.34	3	
道富	706,462,703	990,132,855	3.21	40.15	2	
合計	3,259,266,332	4,343,128,269	0.85	34.47	—	

註：本批次為絕對報酬型，契約目標報酬率係以 US 3-Month T-Bill (指標報酬率)加計 500 個基本點為基準。

108-1 全球新興市場動態多元因子指數增值股票型 (續約)

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	115年截至3月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (113.12.18~115.3.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
Nomura	559,865,985	707,633,079	-0.73	27.01	3	30.61
荷寶	506,416,368	640,715,598	0.35	27.55	2	
道富	441,937,598	569,555,910	0.01	28.88	1	
合計	1,508,219,951	1,917,904,587	-0.15	27.75	—	

109-1 全球美元公司增值債券型(續約)

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	115年截至3月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (115.1.13~115.3.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
Insight	919,063,706	913,195,137	-0.64	-0.64	2	-0.57
JPMorgan	488,802,477	486,141,332	-0.54	-0.54	1	
PIMCO	594,765,647	590,629,509	-0.70	-0.70	3	
合計	2,002,631,830	1,989,965,978	-0.63	-0.63	—	

110-1 全球基礎建設有價證券型

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	115年截至3月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (110.9.8~115.3.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
CBRE	430,000,000	573,961,621	8.69	37.53	2	35.98
Clearbridge	700,000,000	944,030,965	11.02	50.31	1	
Magellan	350,000,000	484,102,245	7.23	36.23	3	
RREEF	430,000,000	560,983,009	7.57	34.04	4	
合計	1,910,000,000	2,563,077,840	8.87	39.95	—	

110-1 全球多元資產型

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	115年截至3月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (110.10.15~115.3.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標/目標 報酬率(%)
富達	400,000,000	460,490,603	-0.55	14.65	5	18.05/40.36
JPMorgan	400,000,000	459,447,063	-2.83	14.66	4	
Ninety One	400,000,000	464,378,117	-2.75	15.48	3	
Schroders	400,000,000	491,070,612	-1.79	22.26	1	
T. Rowe Price	400,000,000	468,268,515	-1.58	15.69	2	
合計	2,000,000,000	2,343,654,910	-1.90	16.55	—	

註：本批次為絕對報酬型，契約目標報酬率係以 US 3-Month T-Bill (指標報酬率)加計 500 個基本點為基準。

111-1 全球氣候變遷增值股票型

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	115年截至3月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (112.4.28~115.3.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
滙豐	400,000,000	529,501,270	-4.15	55.98	1	49.81
LGIM	400,000,000	514,220,271	-6.18	49.77	3	
摩根士丹利	400,000,000	518,379,259	-5.90	49.44	4	
Schroders	400,000,000	498,588,500	-7.08	46.05	5	
威靈頓	400,000,000	526,380,341	-6.12	55.37	2	
合計	2,000,000,000	2,587,069,641	-5.88	51.32	—	

111-2 絕對報酬債券型

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	115年截至3月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (112.7.19~115.3.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標/目標 報酬率(%)
盧米斯	600,000,000	680,736,240	-0.09	19.75	1	12.86/19.62
Ninety One	500,000,000	575,737,609	-0.34	17.68	4	
PIMCO	500,000,000	581,791,144	-0.82	18.56	3	
PGIM	600,000,000	676,076,577	0.79	19.10	2	
T. Rowe Price	500,000,000	545,923,448	0.41	10.20	6	
威靈頓	500,000,000	561,918,166	0.98	15.10	5	
合計	3,200,000,000	3,622,183,184	0.16	16.76	—	

註：本批次為絕對報酬型，契約目標報酬率係以 US 3-Month T-Bill(指標報酬率)加計 250 個基本點為基準。

112-1 全球被動股票型

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	115年截至3月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (113.6.27~115.3.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
Amundi	400,000,000	463,235,127	-3.10	20.81	4	24.77
LGIM	400,000,000	473,268,409	-3.10	24.63	3	
道富	400,000,000	474,498,558	-3.11	25.16	1	
北美信託	400,000,000	474,711,114	-3.06	25.03	2	
合計	1,600,000,000	1,885,713,208	-3.09	23.91	—	

113-1 全球永續不動產有價證券型

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	115年截至3月 累積投資報酬 (%)	委任迄今 (114.6.18~115.3.31)		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率(%)
貝萊德	400,000,000	400,908,482	0.54	2.75	4	3.30
Center Square	400,000,000	405,760,241	2.02	3.80	3	
富達	400,000,000	409,631,935	2.33	4.92	1	
RREEF	400,000,000	406,705,901	2.09	4.07	2	
合計	1,600,000,000	1,623,006,559	1.74	3.89	—	

114-1 全球氣候轉型被動股票型

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	115年截至3月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (114.11.25~115.3.31)		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率(%)
貝萊德	250,000,000	238,574,384	-5.42	-2.33	1	-2.73
HSBC	250,000,000	237,667,332	-5.68	-2.88	4	
道富	250,000,000	237,899,009	-5.65	-2.68	2	
UBS	250,000,000	237,885,150	-5.67	-2.70	3	
合計	1,000,000,000	952,025,875	-5.61	-2.65	—	

2. 舊制勞工退休基金

96 國際平衡型(續約 4)

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	114年截至3月 累積投資報酬率(%)	委任迄今 (113.6.24~115.3.31)		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率(%)
富達	753,144,454	906,892,941	-1.42	20.41	—	17.20

97-1 全球增值債券型(續約 3)

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	115 年截至 3 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (111. 1. 6~115. 3. 31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
PIMCO	1, 003, 724, 736	953, 293, 043	-2. 51	-5. 02	1	-7. 42
盧米斯	1, 018, 693, 762	950, 125, 537	-1. 63	-7. 92	2	
合計	2, 022, 418, 498	1, 903, 418, 580	-2. 07	-6. 44	—	

97-1 全球增值股票型(續約 3)

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	115 年截至 3 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (111. 2. 6~115. 3. 31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
貝萊德	1, 256, 987, 544	2, 006, 009, 092	0. 80	61. 79	—	45. 67

98-1 亞太(日本除外)主動股票型(續約 3)

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	114 年截至 3 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (111. 11. 17~115. 3. 31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
景順	181, 124, 998	332, 333, 101	0. 96	68. 76	—	54. 53

100-1 全球基本面指數被動股票型(續約 2)

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	115 年截至 3 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (111. 3. 6~115. 3. 31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
貝萊德	304, 997, 166	502, 343, 811	2. 78	64. 70	3	62. 40
道富	360, 436, 214	597, 358, 311	2. 79	65. 73	1	
瑞銀	308, 879, 836	510, 480, 120	2. 69	65. 27	2	
Nomura	360, 147, 608	592, 400, 789	2. 72	64. 49	4	
合計	1, 334, 460, 824	2, 202, 583, 031	2. 74	65. 05	—	

101-1 全球低波動指數被動股票型(續約 2)

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	115 年截至 3 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (112. 4. 18~115. 3. 31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
貝萊德	751, 993, 706	959, 998, 709	-0. 37	27. 66	—	26. 32

102-1 年全球高股利增值股票型(續約 2)

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	115 年截至 3 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (113. 1. 22~115. 3. 31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
瑞萬通博	414, 056, 068	460, 289, 434	-3. 21	11. 17	3	36. 66
MFS	315, 296, 707	435, 629, 022	6. 17	38. 16	1	
威靈頓	704, 502, 354	971, 124, 087	3. 23	37. 85	2	
合計	1, 433, 855, 129	1, 867, 042, 543	2. 22	30. 21	—	

102-2 全球基礎建設有價證券型(續約 2)

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	115 年截至 3 月 累積投資報酬 (%)	委任迄今 (113.5.29~115.3.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
Lazard	954,418,976	1,378,591,455	4.74	44.44	—	39.87

102-2 全球不動產有價證券型 (續約 2)

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	115 年截至 3 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (113.8.27~115.3.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
信安環球	708,888,643	718,039,338	0.77	1.29	2	3.41
Nomura	144,937,350	155,362,273	1.14	7.19	1	
合計	853,825,993	873,401,611	0.83	2.29	—	

註：Macquarie 於 114.12.1 更名為 Nomura。

105-1 全球多元資產型 (續約)

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	115 年截至 3 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (110.7.20~115.3.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標/目標 報酬率(%)
Allianz	205,447,975	294,745,450	7.63	54.33	1	18.06/41.56
摩根	594,592,070	697,804,381	-2.78	17.36	3	
DWS	341,387,682	421,540,070	-1.48	25.80	2	
柏瑞	174,823,294	192,799,458	-4.07	5.92	4	
合計	1,316,251,021	1,606,889,359	-0.84	22.13	—	

註：本批次為絕對報酬型，契約目標報酬率係以 USD 3-Month T-Bill (指標報酬率)加計 500 個基點為基準。

106-1 全球 ESG 混合指數被動股票型 (續約)

單位:美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	115 年截至 3 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (111.6.22~115.3.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
貝萊德	127,303,524	204,204,599	-0.15	60.41	4	60.25
DWS	147,528,441	242,285,378	-0.21	64.23	1	
道富	157,982,595	259,008,235	-0.27	63.95	2	
北美信託	158,484,700	257,445,247	-0.07	62.44	3	
合計	591,299,260	962,943,459	-0.18	62.85	—	

106-1 絕對報酬債券型(續約)

單位:美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	115 年截至 3 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (111.7.25~115.3.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標/目標 報酬率(%)
American Century	319,635,794	385,364,669	0.33	20.56	3	17.51/26.73
富達	279,785,344	356,745,101	0.31	26.04	1	
TCW	328,000,470	402,975,209	0.46	22.86	2	
合計	927,421,608	1,145,084,979	0.37	23.12	—	

註：本批次為絕對報酬型，契約目標報酬率係以 US 3-Month T-Bill(指標報酬率)加計 250 個基點為基準。

107-1 絕對報酬股票型(續約)

單位:美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	115 年截至 3 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (113.1.23~115.3.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標/目標 報酬率(%)
景順	116,977,839	165,343,562	0.99	41.35	1	9.89/20.83
威靈頓	107,476,614	132,383,489	-4.07	23.17	3	
CPR	115,110,097	153,493,424	3.18	33.34	2	
合計	339,564,550	451,220,475	0.16	32.88	—	

註：本批次為絕對報酬型，契約目標報酬率係以 USD 3-Month T-Bill (指標報酬率)加計 500 個基點為基準。

110-1 全球基礎建設有價證券型

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	115年截至3月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (110.9.8~115.3.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
CBRE	60,000,000	81,746,790	8.69	37.86	2	35.98
ClearBridge	60,000,000	88,898,708	10.97	52.04	1	
Magellan	60,000,000	73,367,900	7.22	37.16	3	
RREEF	60,000,000	79,933,729	7.53	34.83	4	
合計	240,000,000	323,947,127	8.68	40.03	—	

(二)115年3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)

115年3月31日

1. 避險：

種類	避險比率
權益證券避險	0%
匯率避險	0%

2. 投資：無

(二)舊制勞工退休基金自營部位

(依交易目的)

115年3月31日

1. 避險：

種類	避險比率
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：新臺幣元

	餘絀	收入	支出
115年3月份	-250,652,953,747	121,976,401,171	372,629,354,918

(二)舊制勞工退休基金

單位：新臺幣元

	餘絀	收入	支出
115年3月份	-64,896,014,243	-64,706,183,829	189,830,414

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

115年3月份		單位：新臺幣元
項 目	金 額	
現金收入	284,377,129,723	
現金支出	280,130,304,366	
現金增(減)數		4,246,825,357

(二)舊制勞工退休基金

115年3月份		單位：新臺幣元
項 目	金 額	
現金收入	36,731,512,202	
現金支出	36,731,242,621	
現金增(減)數		269,581