

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 6 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	28.19%	40.74%	1.53%	59.25%	11.25%	-0.21%

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 6 月底止基金規模與收益			
基金運用規模			5 兆 7,963 億 5,043 萬元
115 年截至 6 月底止 運用收益數及收益率	自行運用	國內固定收益	82 億 6,426 萬元 1.82%
		國內權益證券 及國外投資	4,228 億 4,137 萬元 38.36%
	委託經營		1 兆 967 億 5,345 萬元 32.25%
	合 計		1 兆 5,278 億 5,908 萬元 28.19%

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 6 月之保證收益率為 1.7108%。

2. 舊制勞工退休基金

115 年 6 月底止基金規模與收益			
基金運用規模			11,622 億 5,844 萬元
115 年截至 6 月底止 運用收益數及收益率	自行運用	國內固定收益	24 億 1,183 萬元 1.72%
		國內權益證券 及國外投資	1,717 億 8,734 萬元 92.14%
	委託經營		2,049 億 7,536 萬元 32.85%
	合 計		3,791 億 7,453 萬元 40.74%

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 6 月 30 日

單位：新臺幣元

項 目	餘 額	占基金運用比率(%)
自行運用	2,039,012,229,569	35.18
轉存金融機構	498,218,329,846	8.60
短期票券	153,766,771,194	2.65
公債、公司債、金融債券及特別股	249,685,462,861	4.31
股票及受益憑證投資(含期貨)	301,498,149,513	5.20
國外投資	835,843,516,155	14.42
固定收益	715,655,062,812	12.35
權益證券	74,774,832,699	1.29
另類投資	45,413,620,644	0.78
委託經營	3,757,338,200,194	64.82
國內委託經營	1,096,284,105,994	18.91
國外委託經營	2,661,054,094,200	45.91
固定收益	585,932,807,329	10.11
權益證券	1,518,091,521,122	26.19
另類投資	557,029,765,749	9.61
合 計	5,796,350,429,763	100.00

2. 舊制勞工退休基金

115 年 6 月 30 日

單位：新臺幣元

項 目	餘 額	占基金運用比率(%)
自行運用	515,241,051,164	44.33
轉存金融機構	206,753,965,948	17.79
短期票券	70,907,889,232	6.10
公債、金融債券、公司債及證券化商品	87,428,925,594	7.52
股票及受益憑證投資(含期貨)	95,909,996,878	8.25
國外投資	54,240,273,512	4.67
固定收益	30,843,423,120	2.65
權益證券	23,396,850,392	2.02
另類投資	0	0.00
委託經營	647,017,391,284	55.67
國內委託經營	177,545,692,702	15.27
國外委託經營	469,471,698,582	40.40
固定收益	108,036,669,123	9.30
權益證券	241,307,746,600	20.76
另類投資	120,127,282,859	10.34
合 計	1,162,258,442,448	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 6 月 30 日

單位：新臺幣元

項 目	金 額	占基金運用比率(%)
自 行 運 用	2,039,012,229,569	35.18
委 託 經 營	3,757,338,200,194	64.82

2. 舊制勞工退休基金

115 年 6 月 30 日

單位：新臺幣元

項 目	金 額	占基金運用比率(%)
自 行 運 用	515,241,051,164	44.33
委 託 經 營	647,017,391,284	55.67

(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 6 月 30 日

單位：新臺幣元

項 目	金 額	占基金運用比率(%)
國 內 投 資	2,299,452,819,408	39.67
國 外 投 資	3,496,897,610,355	60.33

2. 舊制勞工退休基金

115 年 6 月 30 日

單位：新臺幣元

項 目	金 額	占基金運用比率(%)
國 內 投 資	638,546,470,354	54.93
國 外 投 資	523,711,972,094	45.07

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 6 月底

項 目	收益率(%)
國內權益證券	135.41

2. 舊制勞工退休基金

115 年截至 6 月底

項 目	收益率(%)
國內權益證券	140.80

(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 6 月 30 日

單位：新臺幣元

項 目	金 額	比 率 (%)
國內權益證券	301,498,149,513	5.20

2. 舊制勞工退休基金

115 年 6 月 30 日

單位：新臺幣元

項 目	金 額	比 率 (%)
國內權益證券	95,909,996,878	8.25

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 6 月 累積投資報酬 (%)	委任迄今 (114.9.27~115.6.30)		
				投資報酬率 (%)	排名	目標報酬率 (%)
野村	53,037,175,831	117,216,440,397	85.38	121.01	—	4.75

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 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (112.1.30~115.6.30)		
				投資報酬率 (%)	排名	目標報酬率 (%)
野村	6,829,066,771	26,944,336,638	88.41	294.55	—	20.65

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 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (113.7.16~115.6.30)		
				投資報酬率 (%)	排名	目標報酬率 (%)
野村	25,455,695,879	66,490,441,397	84.71	161.20	1	11.49
玉山	7,430,070,832	15,401,269,847	64.02	107.28	2	
合計	32,885,766,711	81,891,711,244	80.43	149.02	—	

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。

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 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (111.12.5~115.6.30)		
				投資報酬率 (%)	排名	目標報酬率 (%)
國泰	10,445,113,310	29,252,741,164	75.16	180.06	—	21.61

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 6 月 累積投資報酬 (%)	委任迄今 (112.7.15~115.6.30)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
復華	29,101,525,086	89,558,163,782	84.68	207.74	—	192.64

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 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (113. 7. 20~115. 6. 30)		
				投資報酬率 (%)	排名	目標報酬率 (%)
野村	15, 198, 354, 580	46, 662, 272, 660	95. 19	207. 02	1	11. 42
統一	20, 913, 151, 881	46, 007, 771, 615	66. 21	119. 99	2	
合計	36, 111, 506, 461	92, 670, 044, 275	79. 64	156. 62	—	

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 6 月 累積投資報酬 (%)	委任迄今 (115. 1. 24~115. 6. 30)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
統一	37, 517, 851, 631	60, 767, 826, 884	61. 97	61. 97	1	45. 19
復華	39, 053, 243, 767	60, 714, 886, 085	55. 47	55. 47	2	
合計	76, 571, 095, 398	121, 482, 712, 969	58. 65	58. 65	—	

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 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (111. 10. 11~115. 6. 30)		
				投資報酬率 (%)	排名	目標報酬率 (%)
台新	15, 841, 461, 125	45, 210, 757, 604	60. 52	185. 40	—	22. 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。

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 6 月 累積投資報酬 (%)	委任迄今 (114.12.1~115.6.30)		
				投資報酬 率(%)	排名	指標報酬率 (%)
國泰	23,658,255,796	40,548,223,163	62.43	71.39	2	66.62
統一	20,210,724,588	34,180,153,225	60.30	69.12	5	
復華	19,554,752,074	33,489,971,132	61.37	71.26	3	
滙豐	16,812,903,049	28,490,812,845	60.67	69.46	4	
安聯	24,098,049,298	41,442,870,125	63.22	71.98	1	
合計	104,334,684,805	178,152,030,490	61.72	70.75	—	

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 6 月 累積投資報酬 (%)	委任迄今 (112.4.6~115.6.30)		
				投資報酬率 (%)	排名	目標報酬率 (%)
復華	4,799,121,512	15,643,167,621	83.59	225.96	1	19.50
安聯	3,601,238,896	8,855,866,454	52.39	145.91	2	
合計	8,400,360,408	24,499,034,075	70.93	191.64	—	

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 6 月 累積投資報酬 (%)	委任迄今 (112.2.7~115.6.30)		
				投資報酬率 (%)	排名	目標報酬率 (%)
安聯	15,088,712,403	51,353,992,119	72.86	247.07	1	20.51
國泰	5,018,453,600	14,706,636,821	78.00	170.43	3	
群益	6,382,621,945	15,881,715,753	61.68	148.83	4	
滙豐	7,096,535,878	19,290,103,216	73.78	171.82	2	
合計	33,586,323,826	101,232,447,909	71.89	199.09	—	

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 6 月 累積投資報酬 (%)	委任迄今 (112.10.24~115.6.30)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
台新	8,254,694,051	27,561,119,140	69.27	233.88	7	233.22
安聯	12,775,472,416	43,969,364,295	74.63	244.17	4	
玉山	9,403,481,285	32,458,320,697	71.28	245.17	3	
統一	12,635,490,783	42,692,132,366	72.87	237.87	6	
國泰	10,445,956,159	36,519,687,730	74.01	249.61	2	
復華	7,235,716,436	24,603,215,571	72.01	240.02	5	
群益	4,439,275,178	15,667,722,077	73.93	252.93	1	
合計	65,190,086,308	223,471,561,876	72.69	242.80	—	

註：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 6 月 累積投資報酬 (%)	委任迄今 (113.5.24~115.6.30)		
				投資報酬率 (%)	排名	目標報酬率 (%)
安聯	13,613,817,760	34,959,497,939	72.08	157.97	4	12.38
施羅德	11,400,361,947	34,832,121,681	88.43	205.54	2	
統一	13,638,402,860	34,541,020,017	77.39	154.05	5	
野村	20,601,693,072	65,584,458,258	94.55	220.08	1	
國泰	19,457,627,824	46,512,828,487	79.47	139.05	6	
復華	9,724,896,734	25,543,932,311	83.09	162.67	3	
合計	88,436,800,197	241,973,858,693	83.52	174.65	—	

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（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 6 月 累積投資報酬 (%)	委任迄今 (115.5.31~115.6.30)		
				投資報酬率 (%)	排名	目標報酬率 (%)
台新	17,743,902,371	18,275,932,892	3.00	3.00	4	0.83
安聯	25,118,214,883	26,467,785,253	5.37	5.37	1	
玉山	18,706,659,825	19,431,931,249	3.88	3.88	3	
國泰	23,159,171,521	24,223,983,214	4.60	4.60	2	
野村	34,803,007,809	34,909,980,939	0.31	0.31	5	
合計	119,530,956,409	123,309,613,547	3.16	3.16	—	

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。

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 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (111.5.13~115.6.30)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
安聯	3,000,000,000	8,119,040,401	59.46	161.06	2	164.70
玉山	3,000,000,000	8,006,808,777	54.09	159.49	3	
野村	3,000,000,000	8,142,867,535	53.08	158.11	4	
國泰	3,000,000,000	8,347,803,573	54.80	167.18	1	
富邦	3,000,000,000	8,107,453,650	56.92	157.70	5	
合計	15,000,000,000	40,723,973,936	55.64	160.72	—	

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 6 月 累積投資報酬 (%)	委任迄今 (110.12.15~115.6.30)		
				投資報酬率 (%)	排名	目標報酬率 (%)
安聯	8,000,000,000	24,503,226,743	72.91	215.41	3	27.60
玉山	8,000,000,000	19,847,858,127	63.57	152.98	6	
國泰	8,000,000,000	22,881,002,147	80.84	200.14	4	
第一金	8,000,000,000	21,083,206,379	100.34	163.01	5	
野村	8,000,000,000	28,004,991,296	85.83	253.34	1	
富邦	8,000,000,000	24,946,592,925	76.38	217.91	2	
合計	48,000,000,000	141,266,877,617	79.51	200.61	—	

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。

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 6 月 累積投資報酬 (%)	委任迄今 (112.10.5~115.6.30)		
				投資 報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
安聯	7,000,000,000	14,188,624,135	51.21	131.36	6	16.32
施罗德	7,000,000,000	21,422,349,865	85.58	252.69	2	
國泰	7,000,000,000	18,428,471,954	85.07	213.35	3	
第一金	7,000,000,000	18,686,912,565	97.49	163.23	4	
野村	7,000,000,000	22,439,815,890	94.83	261.93	1	
華南 永昌	7,000,000,000	12,176,003,848	65.69	87.06	7	
滙豐	7,000,000,000	16,346,491,624	73.88	159.67	5	
合計	49,000,000,000	123,688,669,881	80.27	181.19	—	

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 6 月 累積投資報酬 (%)	委任迄今 (114.4.1~115.6.30)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標報酬率 (%)
安聯	5,500,000,000	10,665,887,383	67.64	168.38	1	130.33
兆豐 國際	5,500,000,000	9,736,490,954	56.60	137.69	4	
宏利	5,500,000,000	10,202,284,557	68.56	145.76	2	
施羅德	5,500,000,000	9,797,690,852	62.28	133.56	6	
野村	5,500,000,000	9,797,987,866	61.70	133.85	5	
摩根	5,500,000,000	10,017,346,808	63.82	141.02	3	
合計	33,000,000,000	60,217,688,420	63.45	143.37	—	

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 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (114.11.14~115.6.30)		
				投資 報酬率(%)	排名	目標報酬率 (%)
安聯	9,000,000,000	14,275,597,029	63.19	70.51	5	3.91
貝萊德	9,000,000,000	14,863,361,502	73.33	79.73	3	
施羅德	9,000,000,000	15,573,219,651	75.00	86.48	1	
野村	9,000,000,000	14,710,501,824	71.65	79.73	2	
摩根	9,000,000,000	14,746,594,539	70.88	77.49	4	
合計	45,000,000,000	74,169,274,545	70.84	78.82	—	

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。

114 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 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (115.6.9~115.6.30)		
				投資 報酬率(%)	排名	目標報酬率 (%)
元大	1,500,000,000	1,544,532,768	2.97	2.97	1	0.37
安聯	1,500,000,000	1,528,889,549	1.93	1.93	2	
施罗德	1,500,000,000	1,474,347,055	-1.71	-1.71	5	
野村	1,500,000,000	1,489,331,693	-0.71	-0.71	4	
摩根	1,500,000,000	1,492,945,981	-0.47	-0.47	3	
合計	7,500,000,000	7,530,047,046	0.40	0.40	—	

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 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (114.1.28~115.6.30)		
				投資報酬率 (%)	排名	目標報酬率 (%)
富邦	15,603,507,854	38,359,381,288	80.22	145.84	1	8.94
統一	13,492,877,440	32,352,469,472	78.77	139.77	2	
合計	29,096,385,294	70,711,850,760	79.55	143.03	—	

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 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 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (113.11.2~115.6.30)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
滙豐	6,530,798,735	14,343,878,377	63.61	119.63	—	110.19

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 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (113.05.04~115.6.30)		
				投資報酬率 (%)	排名	目標報酬率 (%)
野村	27,357,530,009	90,231,466,119	92.64	229.82	—	12.71

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 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (112.4.6~115.6.30)		
				投資報酬率 (%)	排名	目標報酬率 (%)
復華	4,800,107,976	15,645,123,639	83.57	225.93	1	19.50
安聯	2,601,947,821	7,826,480,914	51.85	145.05	2	
合計	7,402,055,797	23,471,604,553	70.82	191.44	—	

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 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (112.2.7~115.6.30)		
				投資報酬率 (%)	排名	目標報酬率 (%)
安聯	15,089,937,312	51,358,244,668	72.85	247.07	1	20.51
國泰	3,019,107,110	12,455,309,447	76.58	168.30	3	
群益	4,384,957,618	13,791,567,566	61.63	148.82	4	
滙豐	5,597,524,598	17,686,130,717	73.35	171.16	2	
合計	28,091,526,638	95,291,252,398	71.31	198.10	—	

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 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (111.5.13~115.6.30)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
安聯	1,000,000,000	2,706,686,839	59.46	161.16	2	164.70
玉山	1,000,000,000	2,669,200,613	54.09	159.50	3	
野村	1,000,000,000	2,714,567,903	53.08	158.14	4	
國泰	1,000,000,000	2,782,915,914	54.80	167.26	1	
富邦	1,000,000,000	2,703,351,908	56.95	157.95	5	
合計	5,000,000,000	13,576,723,177	55.64	160.82	—	

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 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (112.10.5~115.6.30)		
				投資報酬率 (%)	排名	目標報酬率 (%)
安聯	3,000,000,000	6,050,588,599	52.49	134.93	6	16.32
施羅德	3,000,000,000	9,020,550,899	85.70	254.52	2	
國泰	3,000,000,000	7,844,558,558	85.24	219.02	3	
第一金	3,000,000,000	8,188,549,495	97.61	164.66	4	
野村	3,000,000,000	9,442,116,713	94.81	260.62	1	
華南永昌	3,000,000,000	5,294,936,141	65.68	91.63	7	
滙豐	3,000,000,000	6,920,131,080	73.89	161.55	5	
合計	21,000,000,000	52,761,431,485	80.53	183.79	—	

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 6 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 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (115.6.7~115.6.30)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
聯博	900,495,639	904,273,863	0.42	0.42	1	0.22
富蘭克林 坦伯頓	1,338,657,958	1,341,820,410	0.24	0.24	2	
合計	2,239,153,597	2,246,094,273	0.31	0.31	—	

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 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (111.1.6~115.6.30)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
PIMCO	2,408,967,886	2,387,519,613	-1.36	-4.04	—	-6.84

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 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (111.2.6~115.6.30)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
貝萊德	1,834,805,538	3,376,689,378	15.89	86.24	1	67.42
JPMorgan	1,585,120,883	2,650,009,158	10.89	69.28	2	
合計	3,419,926,421	6,026,698,536	13.64	78.39	—	

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 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (111.11.17~115.6.30)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
景順	656,507,639	1,293,736,356	17.16	97.06	—	92.70

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 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (111.12.4~115.6.30)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
貝萊德	1,321,092,316	2,354,366,982	11.94	88.71	2	86.91
道富	1,783,655,177	3,169,367,035	11.39	89.33	1	
合計	3,104,747,493	5,523,734,017	11.63	89.06	—	

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 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (110.7.1~115.6.30)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
道富	934,565,605	1,683,240,295	12.87	80.11	1	76.09
貝萊德	939,726,931	1,687,228,552	12.75	79.54	2	
合計	1,874,292,536	3,370,468,847	12.81	79.83	—	

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 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (111.3.6~115.6.30)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
Cohen & Steers	2,555,932,432	2,862,400,816	8.60	10.01	1	6.76
景順	1,417,127,452	1,509,443,756	9.71	5.07	2	
合計	3,973,059,884	4,371,844,572	9.00	8.14	—	

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 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (111. 7. 31~115. 6. 30)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
Pictet	618, 843, 493	777, 512, 698	-0. 65	26. 22	—	28. 36

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 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (112. 4. 18~115. 6. 30)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
道富	1, 263, 392, 347	1, 620, 549, 706	2. 33	30. 79	2	29. 61
貝萊德	1, 352, 011, 599	1, 731, 937, 050	2. 27	30. 97	1	
合計	2, 615, 403, 946	3, 352, 486, 756	2. 30	30. 88	—	

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 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (113. 1. 22~115. 6. 30)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
瑞萬通博	1, 796, 000, 834	2, 103, 142, 921	2. 44	17. 72	3	44. 40
MFS	1, 164, 480, 846	1, 718, 286, 608	13. 84	48. 24	1	
威靈頓	1, 507, 914, 919	2, 214, 513, 943	10. 61	47. 69	2	
合計	4, 468, 396, 599	6, 035, 943, 472	8. 47	35. 79	—	

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 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (113.4.25~115.6.30)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
RBC	1,186,559,371	1,368,088,535	-0.13	15.92	1	14.96
貝萊德	670,392,768	768,686,725	-0.04	14.66	3	
盧米斯	941,561,542	1,077,741,805	0.17	14.81	2	
合計	2,798,513,681	3,214,517,065	-0.01	15.23	—	

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 6 月 累積投資報酬 (%)	委任迄今 (114.8.11~115.6.30)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
北美信託	3,222,313,413	3,975,580,764	12.28	23.43	1	23.05
LGIM	3,208,355,339	3,924,793,719	11.41	22.39	3	
Geode	3,189,006,741	3,922,563,590	11.98	23.06	2	
合計	9,619,675,493	11,822,938,073	11.89	22.96	—	

104-2 全球基礎建設有價證券型（續約）

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	115 年截至 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (114.9.25~115.6.30)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
Magellan	1,159,305,130	1,314,198,402	9.20	13.36	1	11.82
RREEF	1,668,471,152	1,837,050,463	9.12	10.10	2	
合計	2,827,776,282	3,151,248,865	9.15	11.44	—	

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 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (114.11.13~115.6.30)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率(%)
盧米斯	819,799,803	806,000,804	-2.62	-1.68	—	-1.98

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 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (110.7.20~115.6.30)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標/目標報酬率(%)
Allianz	878,698,278	1,216,881,012	3.21	47.89	1	19.11/43.87
JPMorgan	1,645,715,430	2,051,054,273	3.82	24.63	3	
DWS	1,175,711,371	1,508,632,702	3.36	31.92	2	
柏瑞	315,326,657	422,609,458	7.56	18.81	4	
合計	4,015,451,736	5,199,177,445	3.75	28.61	—	

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 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (110.8.24~115.6.30)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
貝萊德	949,175,052	1,718,850,535	30.72	81.09	—	73.68

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 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (111.6.22~115.6.30)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
貝萊德	641,552,002	1,185,258,602	19.65	92.66	4	91.82
DWS	848,715,051	1,521,841,215	19.17	96.27	1	
道富	849,045,562	1,540,819,815	19.19	96.06	2	
北美信託	762,047,560	1,412,257,857	19.36	94.28	3	
合計	3,101,360,175	5,660,177,489	19.33	94.88	—	

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 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (111.7.25~115.6.30)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標/目標 報酬率(%)
American Century	427,360,620	522,878,367	1.77	22.35	3	18.56/28.40
富達	905,211,657	1,162,781,169	1.57	27.11	1	
TCW	1,039,618,153	1,288,075,614	1.90	23.88	2	
合計	2,372,190,430	2,973,735,150	1.75	24.99	—	

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 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (113.1.23~115.6.30)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標/目標 報酬率(%)
景順	1,006,698,949	1,499,061,173	12.51	57.53	1	10.87/23.06
威靈頓	867,219,463	1,138,462,866	4.63	34.37	4	
CPR	938,885,217	1,306,411,183	11.86	44.57	2	
道富	806,462,703	1,089,442,729	3.28	40.25	3	
合計	3,619,266,332	5,033,377,951	8.42	44.58	—	

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 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (113.12.18~115.6.30)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
Nomura	559,865,985	755,063,861	5.92	35.53	1	37.30
荷寶	506,416,368	666,220,874	4.35	32.63	3	
道富	441,937,598	589,558,972	3.52	33.40	2	
合計	1,508,219,951	2,010,843,707	4.69	33.94	—	

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 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (115.1.13~115.6.30)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
Insight	1,059,063,706	1,066,146,323	0.71	0.71	2	0.81
JPMorgan	558,802,476	563,258,369	0.86	0.86	1	
PIMCO	674,765,647	679,241,622	0.70	0.70	3	
合計	2,292,631,829	2,308,646,314	0.74	0.74	—	

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 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (110.9.8~115.6.30)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
CBRE	430,000,000	580,461,284	9.92	39.08	2	39.15
Clearbridge	700,000,000	959,489,456	12.84	52.78	1	
Magellan	350,000,000	493,495,061	9.31	38.87	3	
RREEF	430,000,000	577,076,771	10.66	37.88	4	
合計	1,910,000,000	2,610,522,572	10.88	42.54	—	

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 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (110.10.15~115.6.30)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標/目標 報酬率(%)
富達	400,000,000	530,861,963	14.64	32.17	2	19.10/42.66
JPMorgan	400,000,000	490,825,152	3.81	22.49	4	
Ninety One	400,000,000	491,407,437	2.91	22.20	5	
Schroders	400,000,000	538,748,367	7.74	34.13	1	
T. Rowe Price	400,000,000	512,385,696	7.70	26.59	3	
合計	2,000,000,000	2,564,228,615	7.33	27.52	—	

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 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (112.4.28~115.6.30)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
滙豐	400,000,000	625,894,366	13.30	84.37	1	74.22
LGIM	400,000,000	599,547,682	9.39	74.62	4	
摩根士丹利	400,000,000	606,502,238	10.10	74.84	3	
Schroders	400,000,000	578,856,765	7.88	69.56	5	
威靈頓	400,000,000	621,800,879	10.89	83.53	2	
合計	2,000,000,000	3,032,601,930	10.33	77.38	—	

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 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (112.7.19~115.6.30)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標/目標 報酬率(%)
盧米斯	600,000,000	689,474,316	1.19	21.28	1	13.87/21.25
Ninety One	500,000,000	587,169,093	1.64	20.02	4	
PIMCO	500,000,000	593,735,886	1.21	21.00	2	
PGIM	600,000,000	685,961,345	2.27	20.84	3	
T. Rowe Price	500,000,000	557,731,817	2.58	12.58	6	
威靈頓	500,000,000	573,497,628	3.06	17.47	5	
合計	3,200,000,000	3,687,570,085	1.96	18.87	—	

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 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (113.6.27~115.6.30)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
Amundi	400,000,000	533,036,158	11.50	39.01	4	43.40
LGIM	400,000,000	543,970,609	11.37	43.25	3	
道富	400,000,000	544,895,177	11.27	43.73	1	
北美信託	400,000,000	545,430,771	11.38	43.66	2	
合計	1,600,000,000	2,167,332,715	11.38	42.41	—	

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 6 月 累積投資報酬 (%)	委任迄今 (114.6.18~115.6.30)		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率(%)
貝萊德	400,000,000	437,857,077	9.80	12.22	4	12.01
Center Square	400,000,000	446,072,975	12.15	14.11	1	
富達	400,000,000	443,552,741	10.80	13.61	2	
RREEF	400,000,000	442,377,627	11.05	13.20	3	
合計	1,600,000,000	1,769,860,420	10.95	13.29	—	

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 6 月 累積投資報酬 (%)	委任迄今 (114.11.25~115.6.30)		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率(%)
貝萊德	400,000,000	420,213,973	6.85	10.35	1	9.69
HSBC	400,000,000	418,936,760	6.42	9.58	4	
道富	400,000,000	419,048,449	6.40	9.75	3	
UBS	400,000,000	419,200,289	6.44	9.80	2	
合計	1,600,000,000	1,677,399,471	6.53	9.87	—	

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	115 年截至 6 月 累積投資報酬率 (%)	委任迄今 (113.6.24~115.6.30)		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率(%)
富達	753,144,454	1,016,210,408	10.47	34.93	—	28.10

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 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (111.1.6~115.6.30)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
PIMCO	1,003,724,736	965,136,838	-1.29	-3.84	1	-6.84
盧米斯	1,018,693,762	959,369,331	-0.68	-7.03	2	
合計	2,022,418,498	1,924,506,169	-0.99	-5.41	—	

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 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (111.2.6~115.6.30)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
貝萊德	956,987,544	1,997,179,617	15.72	85.73	—	67.42

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 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (111.11.17~115.6.30)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
景順	181,124,998	385,583,924	17.14	95.80	—	92.70

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 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (111.3.6~115.6.30)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
貝萊德	54,997,166	303,753,501	13.14	81.30	4	78.27
道富	160,436,214	456,179,013	12.79	81.86	2	
瑞銀	108,879,836	361,201,485	12.76	81.48	3	
Nomura	110,147,608	405,779,245	13.59	81.90	1	
合計	434,460,824	1,526,913,244	13.08	81.65	—	

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 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (112.4.18~115.6.30)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
貝萊德	751,993,706	985,141,909	2.24	31.00	—	29.61

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 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (113.1.22~115.6.30)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
瑞萬通博	414,056,068	487,132,500	2.43	17.65	3	44.40
MFS	315,296,707	466,898,109	13.79	48.08	1	
威靈頓	704,502,354	1,040,412,062	10.60	47.68	2	
合計	1,433,855,129	1,994,442,671	9.19	39.10	—	

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 6 月 累積投資報酬 (%)	委任迄今 (113.5.29~115.6.30)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
Lazard	954,418,976	1,392,892,642	5.83	45.94	—	39.22

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 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (113.8.27~115.6.30)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
信安環球	708,888,643	783,215,005	9.91	10.48	2	12.23
Nomura	144,937,350	171,360,770	11.55	18.23	1	
合計	853,825,993	954,575,775	10.20	11.80	—	

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 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (110.7.20~115.6.30)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標/目標 報酬率(%)
Allianz	205,447,975	282,822,171	3.27	48.09	1	19.11/43.87
摩根	594,592,070	746,373,228	3.98	25.53	3	
DWS	341,387,682	442,398,214	3.40	32.03	2	
柏瑞	174,823,294	216,266,708	7.60	18.81	4	
合計	1,316,251,021	1,687,860,321	4.16	28.28	—	

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 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (111.6.22~115.6.30)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
貝萊德	127,303,524	244,150,280	19.38	91.79	4	91.82
DWS	147,528,441	289,249,461	19.13	96.06	1	
道富	157,982,595	309,226,906	19.06	95.73	2	
北美信託	158,484,700	307,546,859	19.37	94.05	3	
合計	591,299,260	1,150,173,506	19.23	94.52	—	

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 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (111.7.25~115.6.30)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標/目標 報酬率(%)
American Century	319,635,794	390,945,769	1.78	22.31	3	18.56/28.40
富達	279,785,344	361,280,453	1.59	27.64	1	
TCW	328,000,470	408,867,040	1.93	24.65	2	
合計	927,421,608	1,161,093,262	1.77	24.84	—	

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 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (113.1.23~115.6.30)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標/目標 報酬率(%)
景順	116,977,839	184,334,919	12.59	57.58	1	10.87/23.06
威靈頓	107,476,614	144,364,581	4.61	34.32	3	
CPR	115,110,097	166,555,642	11.96	44.69	2	
合計	339,564,550	495,255,142	9.94	45.85	—	

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 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (110.9.8~115.6.30)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
CBRE	60,000,000	82,674,922	9.93	39.43	3	39.15
ClearBridge	60,000,000	90,350,775	12.78	54.53	1	
Magellan	60,000,000	74,789,670	9.29	39.82	2	
RREEF	60,000,000	82,224,651	10.61	38.70	4	
合計	240,000,000	330,040,018	10.72	42.67	—	

(二)115 年 6 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6月30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6月30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6月份	73,791,536,366	173,568,830,423	99,777,294,057

(二)舊制勞工退休基金

單位：新臺幣元

	餘絀	收入	支出
115年6月份	-7,990,638,363	3,094,675,118	11,085,313,481

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 6 月份		單位：新臺幣元
項 目	金 額	
現金收入	181,256,688,993	
現金支出	174,654,479,358	
現金增(減)數		6,602,209,635

(二)舊制勞工退休基金

115 年 6 月份		單位：新臺幣元
項 目	金 額	
現金收入	108,919,115,125	
現金支出	108,919,106,657	
現金增(減)數		8,468