

## 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(%)
<b>自行運用</b>	<b>2,030,548,903,388</b>	<b>37.38</b>
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
<b>委託經營</b>	<b>3,401,830,156,578</b>	<b>62.62</b>
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
<b>合 計</b>	<b>5,432,379,059,966</b>	<b>100.00</b>

## 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(%)
<b>自行運用</b>	<b>464,879,275,632</b>	<b>42.19</b>
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
<b>委託經營</b>	<b>636,995,424,130</b>	<b>57.81</b>
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
<b>合 計</b>	<b>1,101,874,699,762</b>	<b>100.00</b>

### (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 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	2,500,000,000	238,574,384	-5.42	-2.33	1	-2.73
HSBC	2,500,000,000	237,667,332	-5.68	-2.88	4	
道富	2,500,000,000	237,899,009	-5.65	-2.68	2	
UBS	2,500,000,000	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