

勞工退休基金運用情形

一、勞工退休基金整體績效

(一) 113 年截至 2 月底績效

基金與指標	新制基金	舊制基金	台灣 10 年期 公債殖利率	台灣加權 股價指數	MSCI 全球 股票指數	Barclays 全球債券指數
收益率/報酬率	4.32%	5.05%	1.23%	5.78%	4.90%	-2.62%

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(112 年)績效

基金與指標	新制基金	舊制基金	台灣 10 年期 公債殖利率	台灣加權 股價指數	MSCI 全球 股票指數	Barclays 全球債券指數
收益率/報酬率	12.60%	14.83%	1.21%	26.83%	22.20%	5.72%

(三) 近三年(110~112 年)平均績效

基金與指標	新制基金	舊制基金	台灣 10 年期 公債殖利率	台灣加權 股價指數	MSCI 全球 股票指數	Barclays 全球債券指數
收益率/報酬率	5.26%	5.83%	0.96%	6.77%	5.75%	-5.51%

(四) 近五年(108~112 年)平均績效

基金與指標	新制基金	舊制基金	台灣 10 年期 公債殖利率	台灣加權 股價指數	MSCI 全球 股票指數	Barclays 全球債券指數
收益率/報酬率	6.51%	7.90%	0.81%	13.01%	11.72%	-0.32%

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

113 年 2 月底止基金規模與收益			
基金運用規模			4 兆 1,029 億 9,668 萬元
113 年截至 2 月底止 運用收益數及收益率	自行運用	國內固定收益	19 億 4,916 萬元 1.53%
		國內權益證券 及國外投資	416 億 8,529 萬元 4.93%
	委託經營		1,299 億 5,199 萬元 5.43%
	合 計		1,735 億 8,644 萬元 4.32%

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 3：113 年 2 月之保證收益率為 1.5866%。

2. 舊制勞工退休基金

113 年 2 月底止基金規模與收益			
基金運用規模			10,061 億 2,421 萬元
113 年截至 2 月底止 運用收益數及收益率	自行運用	國內固定收益	6 億 8,176 萬元 1.46%
		國內權益證券 及國外投資	166 億 3,407 萬元 7.68%
	委託經營		248 億 8,986 萬元 4.82%
	合 計		422 億 569 萬元 5.05%

註：評價後報酬率係以當期報酬率（即收益÷113 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

113 年 2 月 29 日

單位：新臺幣元

項 目	餘 額	占基金運用比率(%)
自行運用	1,656,226,320,958	40.37
轉存金融機構	473,966,738,510	11.55
短期票券	80,342,823,471	1.96
公債、公司債、金融債券及特別股	226,808,105,710	5.53
股票及受益憑證投資(含期貨)	235,003,688,831	5.73
國外投資	640,104,964,436	15.60
固定收益	522,387,857,979	12.73
權益證券	58,762,372,603	1.43
另類投資	58,954,733,854	1.44
委託經營	2,446,770,359,440	59.63
國內委託經營	556,714,735,795	13.57
國外委託經營	1,890,055,623,645	46.06
固定收益	492,692,360,870	12.01
權益證券	970,164,058,590	23.64
另類投資	427,199,204,185	10.41
合 計	4,102,996,680,398	100.00

2. 舊制勞工退休基金

113 年 2 月 29 日

單位：新臺幣元

項 目	餘 額	占基金運用比率(%)
自行運用	501,123,182,256	49.81
轉存金融機構	154,386,216,859	15.34
短期票券	49,004,592,402	4.87
公債、金融債券、公司債及證券化商品	78,687,027,168	7.82
股票及受益憑證投資(含期貨)	115,333,295,448	11.47
國外投資	103,712,050,379	10.31
固定收益	55,300,919,014	5.50
權益證券	38,378,547,850	3.81
另類投資	10,032,583,515	1.00
委託經營	505,001,029,376	50.19
國內委託經營	105,331,201,343	10.47
國外委託經營	399,669,828,033	39.72
固定收益	98,372,654,947	9.78
權益證券	204,946,671,730	20.37
另類投資	96,350,501,356	9.57
合 計	1,006,124,211,632	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

113 年 2 月 29 日

單位：新臺幣元

項 目	金 額	占基金運用比率(%)
自 行 運 用	1,656,226,320,958	40.37
委 託 經 營	2,446,770,359,440	59.63

2. 舊制勞工退休基金

113 年 2 月 29 日

單位：新臺幣元

項 目	金 額	占基金運用比率(%)
自 行 運 用	501,123,182,256	49.81
委 託 經 營	505,001,029,376	50.19

(四)基金國內投資與國外投資比率

1. 新制勞工退休基金

113 年 2 月 29 日

單位：新臺幣元

項 目	金 額	占基金運用比率(%)
國 內 投 資	1,572,836,092,317	38.34
國 外 投 資	2,530,160,588,081	61.66

2. 舊制勞工退休基金

113 年 2 月 29 日

單位：新臺幣元

項 目	金 額	占基金運用比率(%)
國 內 投 資	502,742,333,220	49.97
國 外 投 資	503,381,878,412	50.03

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

113 年截至 2 月底

項 目	收益率(%)
國內權益證券	8.89

2. 舊制勞工退休基金

113 年截至 2 月底

項 目	收益率(%)
國內權益證券	8.83

(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

113 年 2 月 29 日

單位：新臺幣元

項 目	金 額	比 率 (%)
國內權益證券	235,003,688,831	5.73

2. 舊制勞工退休基金

113 年 2 月 29 日

單位：新臺幣元

項 目	金 額	比 率 (%)
國內權益證券	115,333,295,448	11.47

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 5)

單位：新臺幣元

投信 名稱	委託金額	目前淨資產	113 年截至 2 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (111.9.27~113.2.29)		
				投資報酬率 (%)	排名	目標報酬率 (%)
野村	28,072,603,831	38,301,945,342	10.47	36.44	—	8.99

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。

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	113 年截至 2 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (112.1.30~113.2.29)		
				投資報酬率 (%)	排名	目標報酬率 (%)
野村	6,829,066,771	9,020,515,642	10.98	32.09	—	6.87

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 4)

單位：新臺幣元

投信 名稱	委託金額	目前淨資產	113 年截至 2 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (110.7.16~113.2.29)		
				投資報酬率 (%)	排名	目標報酬率 (%)
野村	19,093,323,980	21,813,741,381	8.62	14.25	2	14.84
保德信	6,277,574,114	7,376,268,519	7.35	17.50	1	
合計	25,370,898,094	29,190,009,900	8.30	15.05	—	

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 4 年年底股票集中市場平均殖利率加計 200 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	113 年截至 2 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (111.12.5~113.2.29)		
				投資報酬率 (%)	排名	目標報酬率 (%)
國泰	10,445,113,310	11,873,327,559	3.33	13.67	—	7.83

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	113 年截至 2 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (112.7.15~113.2.29)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
復華	29,101,525,086	31,667,339,212	3.91	8.82	—	8.62

註：本批次為相對報酬型，以臺灣就業 99 指數為指定指標。

101 年第一次委託經營(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	113 年截至 2 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (109.4.20~113.2.29)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
國泰	8,014,871,501	16,392,736,231	5.54	104.53	1	106.42
滙豐	9,927,481,593	20,533,912,021	6.88	98.74	2	
合計	17,942,353,094	36,926,648,252	6.28	101.13	—	

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。

101 年第二次委託經營(續約 2)

單位：新臺幣元

投信 名稱	委託金額	目前淨資產	113 年截至 2 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (109.7.20~113.2.29)		
				投資報酬率 (%)	排名	目標報酬率 (%)
野村	9,057,257,704	13,806,269,592	10.98	52.43	1	20.81
統一	12,294,643,442	18,675,520,123	6.61	51.90	2	
合計	21,351,901,146	32,481,789,715	8.43	52.13	—	

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 4 年年底股票集中市場平均殖利率加計 200 個基本點為基準。

102 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	113 年截至 2 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (111.1.24~113.2.29)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
統一	14,437,134,744	17,583,523,142	9.49	21.79	1	15.20
復華	19,009,802,076	21,132,941,700	7.96	11.17	2	
合計	33,446,936,820	38,716,464,842	8.65	15.75	—	

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 年第一次委託經營第二期(續約 2)

單位：新臺幣元

投信 名稱	委託金額	目前淨資產	113 年截至 2 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (111.10.11~113.2.29)		
				投資報酬率 (%)	排名	目標報酬率 (%)
台新	15,841,461,125	20,442,272,729	4.49	29.04	—	8.75

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 250 個基本點為基準。

103 年第二次委託經營(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	113 年截至 2 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (110.12.1~113.2.29)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
國泰	14,836,482,661	18,353,233,204	3.69	25.16	5	28.40
統一	11,353,734,691	14,424,343,548	3.42	27.04	1	
復華	10,890,868,617	13,712,149,154	3.25	25.91	2	
滙豐	10,790,827,015	13,567,532,637	3.65	25.73	3	
安聯	15,017,345,063	18,629,140,918	3.17	25.37	4	
合計	62,889,258,047	78,686,399,461	3.43	25.79	—	

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	113 年截至 2 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (112.4.6~113.2.29)		
				投資報酬率 (%)	排名	目標報酬率 (%)
復華	4,799,121,512	5,732,103,463	7.64	19.44	1	5.72
安聯	3,601,238,896	4,064,043,121	4.72	12.85	2	
合計	8,400,360,408	9,796,146,584	6.41	16.62	—	

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。

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	113 年截至 2 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (112.2.7~113.2.29)		
				投資報酬率 (%)	排名	目標報酬率 (%)
安聯	14,088,712,403	18,021,712,177	9.48	27.92	1	6.73
國泰	6,318,453,600	7,322,211,435	3.39	15.89	3	
群益	6,382,621,945	7,590,874,092	2.39	18.93	2	
滙豐	7,096,535,878	8,206,166,954	3.83	15.64	4	
合計	33,886,323,826	41,140,964,658	5.87	21.41	—	

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	113 年截至 2 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (112.10.24~113.2.29)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
台新	8,254,694,051	9,661,038,671	5.58	17.04	2	16.90
安聯	12,775,472,416	14,867,659,756	5.52	16.38	5	
保德信	9,403,481,285	11,057,944,905	6.58	17.59	1	
統一	12,635,490,783	14,691,045,600	5.32	16.27	6	
國泰	10,445,956,159	12,136,781,695	5.69	16.19	7	
復華	7,235,716,436	8,427,635,099	5.49	16.47	4	
群益	4,439,275,178	5,187,939,079	5.92	16.86	3	
合計	65,190,086,308	76,030,044,805	5.69	16.63	—	

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

單位：新臺幣元

投信 名稱	委託金額	目前淨資產	113 年截至 2 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (108.5.24~113.2.29)		
				投資報酬率 (%)	排名	目標報酬率 (%)
安聯	6,000,000,000	11,140,877,884	9.84	94.05	2	28.52
施罗德	6,000,000,000	10,620,478,704	10.82	83.22	5	
統一	6,000,000,000	11,318,122,485	7.40	96.26	1	
野村	11,000,000,000	17,760,443,033	11.04	93.07	3	
國泰	11,000,000,000	17,682,507,437	6.18	84.79	4	
復華	6,000,000,000	9,400,980,309	7.79	65.96	6	
合計	46,000,000,000	77,923,409,852	8.78	85.91	—	

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 200 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	113 年截至 2 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (110.5.13~113.2.29)		
				投資報酬率 (%)	排名	目標報酬率 (%)
台新	8,000,000,000	9,745,083,536	4.68	21.81	3	16.25
安聯	8,000,000,000	9,703,396,810	8.22	21.29	4	
保德信	8,000,000,000	9,195,562,602	6.46	14.94	5	
國泰	8,000,000,000	10,162,431,507	7.31	27.03	1	
野村	8,000,000,000	9,897,257,648	10.74	23.72	2	
合計	40,000,000,000	48,703,732,103	7.47	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 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	113 年截至 2 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (111.5.13~113.2.29)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
安聯	3,000,000,000	4,766,763,126	2.16	53.27	3	63.54
保德信	3,000,000,000	4,824,795,973	1.93	56.36	1	
野村	3,000,000,000	4,903,499,844	2.80	55.43	2	
國泰	3,000,000,000	4,765,594,381	1.98	52.53	4	
富邦	3,000,000,000	4,724,412,352	2.47	50.17	5	
合計	15,000,000,000	23,985,065,676	2.27	53.56	—	

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	113 年截至 2 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (110.12.15~113.2.29)		
				投資報酬率 (%)	排名	目標報酬率 (%)
安聯	6,000,000,000	7,080,994,576	8.59	15.11	3	13.82
保德信	6,000,000,000	7,611,342,609	7.44	23.17	1	
國泰	6,000,000,000	7,043,707,842	5.72	15.43	2	
第一金	6,000,000,000	6,853,952,132	3.86	10.38	6	
野村	6,000,000,000	7,059,289,725	10.74	13.12	4	
富邦	6,000,000,000	7,051,983,312	7.46	13.11	5	
合計	36,000,000,000	42,701,270,196	7.28	15.06	—	

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	113 年截至 2 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (112.10.5~113.2.29)		
				投資 報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
安聯	2,000,000,000	2,139,261,934	4.59	6.96	7	2.54
施罗德	2,000,000,000	2,218,630,098	9.36	10.93	3	
國泰	2,000,000,000	2,343,684,447	7.48	17.18	1	
第一金	2,000,000,000	2,157,087,376	3.66	7.85	6	
野村	2,000,000,000	2,224,699,190	10.65	11.23	2	
華南 永昌	2,000,000,000	2,209,523,608	4.47	10.48	4	
滙豐	2,000,000,000	2,180,618,735	4.43	9.03	5	
合計	14,000,000,000	15,473,505,388	6.35	10.53	—	

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。

2. 舊制勞工退休基金

國內 98 年第二次委託經營(續約 4)

單位：新臺幣元

投信 名稱	委託金額	目前淨資產	113 年截至 2 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (111.1.28~113.2.29)		
				投資報酬率 (%)	排名	目標報酬率 (%)
富邦	12,256,867,963	13,641,322,108	8.45	11.30	2	12.74
統一	10,364,185,361	12,439,234,445	6.82	20.02	1	
合計	22,621,053,324	26,080,556,553	7.67	15.29	—	

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 4 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 101 年第一次委託經營(相對報酬)(續約 2)

單位：新臺幣元

投信 名稱	委託金額	目前淨資產	113 年截至 2 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (109.11.2~113.2.29)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
匯豐	3,685,000,000	7,128,850,953	6.87	64.16	—	69.13

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 2)

單位：新臺幣元

投信 名稱	委託金額	目前淨資產	113 年截至 2 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (109.05.04~113.2.29)		
				投資報酬率 (%)	排名	目標報酬率 (%)
野村	19,272,822,959	32,578,981,268	11.03	69.04	—	22.12

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 4 年年底股票集中市場平均殖利率加計 200 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	113 年截至 2 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (112.4.6~113.2.29)		
				投資報酬率 (%)	排名	目標報酬率 (%)
復華	4,800,107,976	5,733,248,326	7.64	19.44	1	5.72
安聯	3,601,947,821	4,064,856,719	4.72	12.85	2	
合計	8,402,055,797	9,798,105,045	6.40	16.62	—	

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 200 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	113 年截至 2 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (112.2.7~113.2.29)		
				投資報酬率 (%)	排名	目標報酬率 (%)
安聯	14,089,937,312	18,023,478,199	9.48	27.92	1	6.73
國泰	6,319,107,110	7,323,149,507	3.39	15.89	3	
群益	6,384,957,618	7,594,426,607	2.39	18.94	2	
滙豐	7,097,524,598	8,207,445,320	3.83	15.64	4	
合計	33,891,526,638	41,148,499,633	5.87	21.41	—	

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	113 年截至 2 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (111.5.13~113.2.29)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
安聯	1,000,000,000	1,589,051,946	2.16	53.32	3	63.54
保德信	1,000,000,000	1,608,338,270	1.93	56.37	1	
野村	1,000,000,000	1,634,585,187	2.80	55.44	2	
國泰	1,000,000,000	1,588,654,314	1.98	52.57	4	
富邦	1,000,000,000	1,574,790,102	2.47	50.26	5	
合計	5,000,000,000	7,995,419,819	2.27	53.60	—	

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	113 年截至 2 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (112.10.5~113.2.29)		
				投資報酬率 (%)	排名	目標報酬率 (%)
安聯	500,000,000	534,715,658	4.66	6.94	7	2.54
施羅德	500,000,000	554,687,111	9.37	10.94	3	
國泰	500,000,000	585,870,235	7.48	17.17	1	
第一金	500,000,000	539,278,909	3.66	7.86	6	
野村	500,000,000	556,495,943	10.73	11.30	2	
華南 永昌	500,000,000	552,492,881	4.48	10.50	4	
滙豐	500,000,000	545,159,992	4.43	9.03	5	
合計	3,500,000,000	3,868,700,729	6.38	10.53	—	

(二) 113 年 2 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	113 年截至 2 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (110.6.7~113.2.29)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
聯博	907,613,021	754,013,203	-2.93	-16.92	2	-17.07
富蘭克林 坦伯頓	1,151,737,838	1,051,498,387	-3.38	-13.51	1	
合計	2,059,350,859	1,805,511,590	-3.19	-15.26	—	

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	113 年截至 2 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (111.1.6~113.2.29)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
PIMCO	2,158,967,886	1,932,203,971	-3.22	-12.78	—	-13.95

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	113 年截至 2 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (111.2.6~113.2.29)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
貝萊德	1,734,805,538	1,968,028,089	5.03	13.44	1	9.83
摩根	1,485,120,883	1,680,948,060	5.28	13.19	2	
合計	3,219,926,421	3,648,976,149	5.14	13.32	—	

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	113 年截至 2 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (111.11.17~113.2.29)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
景順	656,507,639	712,317,791	-0.37	8.50	—	8.40

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	113 年截至 2 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (111.12.4~113.2.29)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
貝萊德	1,141,092,316	1,387,160,389	4.87	23.04	2	22.62
道富	1,513,655,177	1,843,034,036	5.00	23.29	1	
合計	2,654,747,493	3,230,194,425	4.94	23.18	—	

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	113 年截至 2 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (110.7.1~113.2.29)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
道富	934,565,605	1,075,578,792	2.96	15.09	1	13.65
貝萊德	939,726,931	1,079,307,551	2.77	14.85	2	
合計	1,874,292,536	2,154,886,343	2.87	14.97	—	

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	113 年截至 2 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (111.3.6~113.2.29)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
Cohen & Steers	2,410,932,432	2,186,186,765	-4.08	-13.42	1	-15.33
景順	1,487,127,452	1,345,690,582	-5.57	-14.84	2	
合計	3,898,059,884	3,531,877,347	-4.65	-13.95	—	

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	113 年截至 2 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (111. 7. 31~113. 2. 29)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
Pictet	618, 843, 493	681, 955, 387	-1. 67	10. 71	—	11. 22

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	113 年截至 2 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (112. 4. 18~113. 2. 29)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
道富	1, 113, 392, 347	1, 183, 692, 457	3. 13	6. 31	2	5. 94
貝萊德	1, 132, 011, 599	1, 205, 506, 056	3. 12	6. 49	1	
合計	2, 245, 403, 946	2, 389, 198, 513	3. 13	6. 40	—	

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	113 年截至 2 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (113. 1. 22~113. 2. 29)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
瑞萬通博	1, 716, 000, 834	1, 791, 429, 678	4. 40	4. 40	1	2. 69
MFS	1, 114, 480, 846	1, 152, 229, 839	3. 39	3. 39	2	
威靈頓	1, 427, 914, 919	1, 474, 531, 307	3. 26	3. 26	3	
合計	4, 258, 396, 599	4, 418, 190, 824	3. 75	3. 75	—	

102-1 全球信用主動債券型（續約）

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	113 年截至 2 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (108.4.25~113.2.29)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
RBC	1,036,338,464	1,097,457,815	-1.62	10.04	1	0.83
貝萊德	687,231,657	676,184,266	-1.93	1.23	3	
盧米斯	892,703,100	901,654,664	-1.99	3.88	2	
合計	2,616,273,221	2,675,296,745	-1.82	4.96	—	

104-1 全球高品質被動股票型（續約）

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	113 年截至 2 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (109.8.11~113.2.29)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
北美信託	1,796,617,127	2,586,359,010	8.71	53.99	2	52.40
LGIM	1,795,083,447	2,582,790,407	8.74	53.73	3	
Geode	1,775,075,832	2,563,417,369	8.72	54.23	1	
合計	5,366,776,406	7,732,566,786	8.72	53.98	—	

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	113 年截至 2 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (109.9.25~113.2.29)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
Magellan	1,437,520,518	1,556,797,185	-1.57	18.79	2	23.55
RREEF	926,848,763	1,139,478,199	-2.40	22.94	1	
合計	2,364,369,281	2,696,275,384	-1.89	20.44	—	

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	113 年截至 2 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (109.11.13~113.2.29)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
Brandywine	821,176,083	700,980,507	-4.91	-16.30	2	-16.07
盧米斯	471,104,127	426,594,319	-2.75	-12.59	1	
合計	1,292,280,210	1,127,574,826	-4.11	-15.06	—	

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	113 年截至 2 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (110.7.20~113.2.29)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標/目標 報酬率(%)
Allianz	578,698,278	588,116,877	2.66	-0.02	2	8.01/21.09
摩根	1,645,715,430	1,630,270,908	2.14	-0.94	3	
DWS	975,711,371	1,009,695,550	-0.51	3.26	1	
柏瑞	765,326,657	711,206,097	0.20	-7.07	4	
合計	3,965,451,736	3,939,289,432	1.17	-1.04	—	

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	113 年截至 2 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (110.8.24~113.2.29)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
貝萊德	949,175,052	963,714,698	2.89	1.53	—	1.97

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	113 年截至 2 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (111.6.22~113.2.29)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
貝萊德	601,552,002	746,229,776	3.41	26.14	4	25.75
DWS	648,715,051	826,882,444	3.80	27.75	1	
道富	749,045,562	929,779,079	3.78	27.71	2	
北美信託	702,047,560	873,557,530	3.59	26.26	3	
合計	2,701,360,175	3,376,448,829	3.66	27.00	—	

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	113 年截至 2 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (111.7.25~113.2.29)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標/目標 報酬率(%)
American Century	427,360,620	454,210,954	-0.37	6.28	3	7.51/11.51
富達	965,211,657	1,093,679,454	1.43	13.31	1	
TCW	1,039,618,153	1,109,131,695	-0.35	6.67	2	
合計	2,432,190,430	2,657,022,103	0.37	9.29	—	

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	113 年截至 2 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (113.1.23~113.2.29)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標/目標 報酬率(%)
景順	786,698,949	809,301,025	2.87	2.87	3	0.54/1.06
威靈頓	787,219,463	811,674,949	3.11	3.11	2	
CPR	778,885,217	824,570,753	5.87	5.87	1	
道富	706,462,703	724,873,591	2.61	2.61	4	
合計	3,059,266,332	3,170,420,318	3.63	3.63	—	

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

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	113 年截至 2 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (108.12.18~113.2.29)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
Amundi	400,000,000	478,325,837	3.89	9.83	4	12.15
DWS	400,000,000	442,501,280	1.12	3.87	5	
Nomura	400,000,000	524,235,027	1.06	21.05	3	
荷寶	300,000,000	439,585,116	4.01	28.69	1	
道富	300,000,000	430,018,459	3.95	24.90	2	
合計	1,800,000,000	2,314,665,719	2.73	16.85	—	

109-1 全球美元公司增值債券型

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	113 年截至 2 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (110.1.13~113.2.29)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
DWS	600,000,000	576,566,369	-1.53	-9.73	4	-8.82
INSIGHT	700,000,000	691,866,133	-1.13	-7.99	1	
摩根	400,000,000	369,991,144	-1.32	-9.31	3	
PIMCO	480,000,000	453,921,226	-1.29	-9.24	2	
WESTERN	400,000,000	364,929,213	-1.55	-10.22	5	
合計	2,580,000,000	2,457,274,085	-1.34	-9.28	—	

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	113 年截至 2 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (110.9.8~113.2.29)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
CBRE	350,000,000	339,925,076	-3.18	-2.36	2	-1.41
Clearbridge	450,000,000	439,569,325	-4.03	-0.22	1	
Magellan	350,000,000	333,697,327	-4.05	-6.10	4	
RREEF	350,000,000	338,584,663	-0.95	-2.94	3	
合計	1,500,000,000	1,451,776,391	-3.13	-2.87	—	

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	113 年截至 2 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (110.10.15~113.2.29)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標/目標 報酬率(%)
富達	400,000,000	370,077,586	2.74	-7.86	5	8.00/19.89
摩根	400,000,000	389,437,358	2.09	-2.82	4	
Ninety One	400,000,000	397,562,665	-1.96	-1.13	2	
Schroders	400,000,000	401,247,666	1.89	-0.10	1	
T. Rowe Price	400,000,000	399,750,401	2.35	-1.24	3	
合計	2,000,000,000	1,958,075,676	1.37	-2.62	—	

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	113 年截至 2 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (112.4.28~113.2.29)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
匯豐	200,000,000	231,004,783	5.17	18.52	4	19.01
LGIM	200,000,000	231,908,282	5.14	18.53	3	
摩根士坦利	200,000,000	227,850,291	4.76	15.78	5	
Schroders	200,000,000	234,049,312	6.34	21.01	2	
威靈頓	200,000,000	237,398,429	7.48	22.15	1	
合計	1,000,000,000	1,162,211,097	5.78	19.19	—	

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	113 年截至 2 月 累積投資報酬率(%)	委任迄今 (112. 7. 19~113. 2. 29)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標/目標 報酬率(%)
盧米斯	300,000,000	315,277,716	0.49	5.01	2	3.25/4.80
Ninety One	300,000,000	315,979,877	0.63	4.19	3	
PIMCO	300,000,000	316,705,658	0.25	4.13	4	
PGIM	300,000,000	312,923,386	1.37	5.26	1	
T. Rowe Price	300,000,000	300,019,278	0.44	0.46	6	
威靈頓	300,000,000	306,331,438	0.85	2.99	5	
合計	1,800,000,000	1,867,237,353	0.67	3.69	—	

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。

2. 舊制勞工退休基金

96 國際平衡型(續約 3)

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	113 年截至 2 月 累積投資報酬率(%)	委任迄今 (108. 6. 24~113. 2. 29)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
富達	686,579,222	936,976,362	1.94	29.69	—	31.36

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	113 年截至 2 月 累積投資報酬率(%)	委任迄今 (111. 1. 6~113. 2. 29)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
PIMCO	1,003,724,736	874,970,701	-3.25	-12.83	1	-13.95
盧米斯	948,693,762	813,329,818	-3.03	-14.27	2	
合計	1,952,418,498	1,688,300,519	-3.15	-13.53	—	

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	113 年截至 2 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (111.2.6~113.2.29)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
貝萊德	1,156,987,544	1,312,884,464	5.03	13.47	—	9.83

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	113 年截至 2 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (111.11.17~113.2.29)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
景順	281,124,998	304,697,390	-0.37	8.39	—	8.40

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	113 年截至 2 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (111.3.6~113.2.29)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
貝萊德	304,997,166	354,500,834	2.78	16.23	3	15.06
道富	360,436,214	420,120,587	3.01	16.56	1	
瑞銀	308,879,836	359,885,552	2.82	16.51	2	
Nomura	360,147,608	418,232,675	2.73	16.13	4	
合計	1,334,460,824	1,552,739,648	2.84	16.36	—	

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	113 年截至 2 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (112.4.18~113.2.29)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
貝萊德	751,993,706	801,185,874	3.13	6.54	—	5.94

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	113 年截至 2 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (113.1.22~113.2.29)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
瑞萬通博	414,056,068	432,243,863	4.39	4.39	1	2.69
MFS	315,296,707	325,951,783	3.38	3.38	2	
威靈頓	704,502,355	727,487,570	3.26	3.26	3	
合計	1,433,855,129	1,485,683,216	3.61	3.61	—	

102-2 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	113 年截至 2 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (108.5.29~113.2.29)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
Lazard	713,987,041	953,671,704	-0.05	34.59	—	16.38

102-2 全球不動產有價證券型 (續約)

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	113 年截至 2 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (108.8.27~113.2.29)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
信安環球	610,886,182	621,727,964	-4.72	-1.55	2	-5.47
Macquarie	126,937,100	130,439,298	-3.03	2.76	1	
合計	737,823,282	752,167,262	-4.43	-0.76	—	

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	113 年截至 2 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (110.7.20~113.2.29)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標/目標 報酬率(%)
Allianz	155,447,975	155,653,940	2.65	0.13	2	8.01/21.09
摩根	594,592,070	591,223,425	2.16	-0.57	3	
DWS	311,387,682	321,732,127	-0.52	3.32	1	
柏瑞	254,823,294	236,663,071	0.20	-7.13	4	
合計	1,316,251,021	1,305,272,563	1.18	-0.83	—	

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	113 年截至 2 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (111.6.22~113.2.29)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
貝萊德	127,303,524	160,321,771	3.41	25.94	4	25.75
DWS	147,528,441	188,354,266	3.80	27.67	2	
道富	157,982,595	201,872,223	3.79	27.78	1	
北美信託	158,484,700	199,833,690	3.59	26.09	3	
合計	591,299,260	750,381,950	3.66	26.90	—	

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	113 年截至 2 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (111.7.25~113.2.29)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標/目標 報酬率(%)
American Century	319,635,794	339,703,014	-0.38	6.28	3	7.51/11.51
富達	299,785,344	341,278,659	1.54	13.84	1	
TCW	328,000,470	350,083,025	-0.38	6.73	2	
合計	947,421,608	1,031,064,698	0.25	8.83	—	

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	113 年截至 2 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (113.1.23~113.2.29)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標/目標 報酬率(%)
景順	116,977,839	120,338,051	2.87	2.87	3	0.54/1.06
威靈頓	107,476,614	110,798,820	3.09	3.09	2	
CPR	115,110,097	121,862,222	5.87	5.87	1	
合計	339,564,550	352,999,093	3.96	3.96	—	

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	113 年截至 2 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (110.9.8~113.2.29)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標/目標 報酬率(%)
CBRE	30,000,000	29,311,179	-3.18	-2.30	2	-1.41
ClearBridge	30,000,000	29,973,260	-4.04	-0.09	1	
Magellan	30,000,000	28,330,897	-4.07	-5.56	4	
RREEF	30,000,000	29,297,107	-0.94	-2.34	3	
合計	120,000,000	116,912,443	-3.07	-2.57	—	

(二)113 年度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)

113年2月29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)

113年2月29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
113年2月份	119,308,178,499	127,726,302,389	8,418,123,890

(二)舊制勞工退休基金

單位：新臺幣元

	餘絀	收入	支出
113年2月份	31,152,373,686	31,295,243,770	142,870,084

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

113 年 2 月份		單位：新臺幣元
項 目	金 額	
現金收入	145,227,719,492	
現金支出	141,035,651,552	
現金增(減)數		4,192,067,940

(二)舊制勞工退休基金

113 年 2 月份		單位：新臺幣元
項 目	金 額	
現金收入	14,494,153,659	
現金支出	14,494,284,360	
現金增(減)數		-130,701