

勞工退休基金運用情形

一、勞工退休基金整體績效

(一) 本年度迄今(108年12月)績效

| 基金別 | 收益率 | 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 |
|------|--------|-------------|----------|------------|----------------|
| 新制基金 | 11.45% | 0.72% | 23.33% | 26.60% | 6.84% |
| 舊制基金 | 13.47% | | | | |

註：股、債指數係依據勞動部103年12月15日勞動福4字第1030136646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。

(二) 近一年(108年)績效

| 基金別 | 收益率 | 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 |
|------|--------|-------------|----------|------------|----------------|
| 新制基金 | 11.45% | 0.72% | 23.33% | 26.60% | 6.84% |
| 舊制基金 | 13.47% | | | | |

(三) 近三年(106~108年)平均績效

| 基金別 | 收益率 | 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 |
|------|-------|-------------|----------|------------|----------------|
| 新制基金 | 5.94% | 0.91% | 9.04% | 12.44% | 4.27% |
| 舊制基金 | 6.42% | | | | |

(四) 近五年(104~108年)平均績效

| 基金別 | 收益率 | 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 |
|------|-------|-------------|----------|------------|----------------|
| 新制基金 | 4.54% | 0.99% | 5.21% | 8.41% | 2.31% |
| 舊制基金 | 4.88% | | | | |

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

| 至 108 年 12 月底止基金規模與收益 | | | |
|--------------------------------|------|------------------------|------------------------------|
| 基金運用規模 | | 2 兆 4, 448 億 4, 733 萬元 | |
| 108 年截至 12 月底止 運用總損益及評價後報酬率 | 自行運用 | 國內固定收益 | 82 億 4, 380 萬元 1.12% |
| | | 國內權益證券 及國外投資 | 352 億 2, 385 萬元 12.20% |
| | 委託經營 | | 2, 235 億 3, 952 萬元 17.06% |
| | 合 計 | | 2, 670 億 717 萬元 11.45% |
| 夏普指標(Sharpe ratio) | | 0.97 | |

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：評價後報酬率係以當期報酬率（即收益÷108 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。

註 3：108 年 12 月之保證收益率為 1.0541%。

2. 舊制勞工退休基金

| 至 108 年 12 月底止基金規模與收益 | | | |
|--------------------------------|------|--------------------|------------------------------|
| 基金運用規模 | | 9, 425 億 2, 998 萬元 | |
| 108 年截至 12 月底止 運用總損益及評價後報酬率 | 自行運用 | 國內固定收益 | 24 億 5, 182 萬元 0.95% |
| | | 國內權益證券 及國外投資 | 412 億 2, 654 萬元 19.27% |
| | 委託經營 | | 706 億 9, 748 萬元 15.68% |
| | 合 計 | | 1, 143 億 7, 584 萬元 13.47% |
| 夏普指標(Sharpe ratio) | | 0.96 | |

註 1：評價後報酬率係以當期報酬率（即收益÷108 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。

註 2：夏普指標如係計算自行運用國內股票部分，為 0.71。

(二) 資產配置

1. 新制勞工退休基金

截至 108 年 12 月底

單位：新台幣元

| 項 目 | 餘 額 | 占基金運用比例(%) |
|-----------------|--------------------------|---------------|
| 自行運用 | 1,060,422,421,823 | 43.37 |
| 轉存金融機構 | 501,875,808,453 | 20.53 |
| 短期票券 | 38,221,717,901 | 1.56 |
| 公債、公司債、金融債券及特別股 | 210,383,231,940 | 8.60 |
| 股票及受益憑證投資(含期貨) | 96,098,270,743 | 3.93 |
| 國外投資 | 213,843,392,786 | 8.75 |
| 固定收益 | 142,760,037,562 | 5.84 |
| 權益證券 | 37,184,964,723 | 1.52 |
| 另類投資 | 33,898,390,501 | 1.39 |
| 委託經營 | 1,384,424,906,861 | 56.63 |
| 國內委託經營 | 335,282,342,157 | 13.72 |
| 國外委託經營 | 1,049,142,564,704 | 42.91 |
| 固定收益 | 266,315,951,517 | 10.89 |
| 權益證券 | 538,461,997,817 | 22.02 |
| 另類投資 | 244,364,615,370 | 10.00 |
| 合 計 | 2,444,847,328,684 | 100.00 |

2. 舊制勞工退休基金

截至 108 年 12 月底

單位：新台幣元

| 項 目 | 餘 額 | 占基金運用比例(%) |
|-------------------|------------------------|---------------|
| 自行運用 | 464,542,260,286 | 49.29 |
| 轉存金融機構 | 157,904,851,707 | 16.75 |
| 短期票券 | 42,522,353,799 | 4.51 |
| 公債、金融債券、公司債及證券化商品 | 63,303,025,499 | 6.71 |
| 股票及受益憑證投資(含期貨) | 83,087,046,397 | 8.82 |
| 國外投資 | 117,724,982,884 | 12.50 |
| 固定收益 | 58,509,523,832 | 6.21 |
| 權益證券 | 41,431,215,173 | 4.40 |
| 另類投資 | 17,784,243,879 | 1.89 |
| 委託經營 | 477,987,717,049 | 50.71 |
| 國內委託經營 | 113,153,642,183 | 12.00 |
| 國外委託經營 | 364,834,074,866 | 38.71 |
| 固定收益 | 104,694,368,173 | 11.11 |
| 權益證券 | 186,571,954,280 | 19.79 |
| 另類投資 | 73,567,752,413 | 7.81 |
| 合 計 | 942,529,977,335 | 100.00 |

(三) 基金自營投資與委外投資比例

1. 新制勞工退休基金

截至 108 年 12 月底

單位：新台幣元

| 項 目 | 金 額 | 占基金運用比例(%) |
|------|-------------------|------------|
| 自行運用 | 1,060,422,421,823 | 43.37 |
| 委託經營 | 1,384,424,906,861 | 56.63 |

2. 舊制勞工退休基金

截至 108 年 12 月底

單位：新台幣元

| 項 目 | 金 額 | 占基金運用比例(%) |
|------|-----------------|------------|
| 自行運用 | 464,542,260,286 | 49.29 |
| 委託經營 | 477,987,717,049 | 50.71 |

(四)基金國內投資與國外投資比例

1. 新制勞工退休基金

截至 108 年 12 月底

單位：新台幣元

| 項 目 | 金 額 | 占基金運用比例 (%) |
|---------|-------------------|-------------|
| 國 內 投 資 | 1,181,861,371,194 | 48.34 |
| 國 外 投 資 | 1,262,985,957,490 | 51.66 |

2. 舊制勞工退休基金

截至 108 年 12 月底

單位：新台幣元

| 項 目 | 金 額 | 占基金運用比例 (%) |
|---------|-----------------|-------------|
| 國 內 投 資 | 459,970,919,585 | 48.79 |
| 國 外 投 資 | 482,559,057,750 | 51.21 |

三、基金自營投資概況

(一)基金自營投資績效 (國內權益證券)

1. 新制勞工退休基金

截至 108 年 12 月底

| 項 目 | 收益率 (%) |
|--------|---------|
| 國內權益證券 | 24.05 |

2. 舊制勞工退休基金

截至 108 年 12 月底

| 項 目 | 收益率 (%) |
|--------|---------|
| 國內權益證券 | 28.48 |

(二)基金自營股票及受益憑證投資比例概況

1. 新制勞工退休基金

截至 108 年 12 月底 單位：新台幣元

| 項 目 | 金 額 | 比 例 (%) |
|--------|----------------|---------|
| 國內權益證券 | 96,098,270,743 | 3.93 |

2. 舊制勞工退休基金

截至 108 年 12 月底 單位：新台幣元

| 項 目 | 金 額 | 比 例 (%) |
|--------|----------------|---------|
| 國內權益證券 | 83,087,046,397 | 8.82 |

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 4)

單位：新台幣元

| 投信 名稱 | 委託金額 | 目前淨資產 | 108 年截至 12 月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (108.9.27~108.12.31) | | |
|----------|----------------|----------------|---------------------------|------------------------------|------------|-----------------|
| | | | | 投資 報酬率(%) | 委託經 營排名 | 大盤/目標 報酬率(%) |
| 野村 | 18,580,874,211 | 20,294,322,285 | 9.22 | 9.22 | — | 10.35/1.69 |

97 年第一次委託經營(續約 3)

單位：新台幣元

| 投信 名稱 | 委託金額 | 目前淨資產 | 108 年截至 12 月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (106.1.20~108.12.31) | | |
|----------|---------------|---------------|---------------------------|------------------------------|------------|-----------------|
| | | | | 投資 報酬率(%) | 委託經 營排名 | 大盤/目標 報酬率(%) |
| 野村 | 7,198,313,969 | 9,187,984,857 | 13.08 | 27.64 | — | 28.75/18.15 |

98 年第一次委託經營(續約 3)

單位：新台幣元

| 投信 名稱 | 委託金額 | 目前淨資產 | 108 年截至 12 月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (107.7.16~108.12.31) | | |
|----------|----------------|----------------|---------------------------|------------------------------|------------|-----------------|
| | | | | 投資 報酬率(%) | 委託經 營排名 | 大盤/目標 報酬率(%) |
| 野村 | 12,940,861,671 | 14,909,725,859 | 23.80 | 15.21 | 1 | 10.42/9.24 |
| 保德信 | 5,153,416,157 | 5,594,052,634 | 17.64 | 8.55 | 2 | |
| 合計 | 18,094,277,828 | 20,503,778,493 | 22.06 | 13.32 | — | |

99 年第二次委託經營(續約 2)

單位：新台幣元

| 投信 名稱 | 委託金額 | 目前淨資產 | 108 年截至 12 月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (107.12.3~108.12.31) | | |
|----------|---------------|---------------|---------------------------|------------------------------|------------|-----------------|
| | | | | 投資 報酬率(%) | 委託經 營排名 | 大盤/目標 報酬率(%) |
| 國泰 | 9,241,043,825 | 9,610,944,586 | 3.81 | 4.00 | — | 21.33/6.90 |

100 年第一次委託經營(續約 2)(相對報酬)

單位：新台幣元

| 投信 名稱 | 委託金額 | 目前淨資產 | 108 年截至 12 月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (108.7.15~108.12.31) | | |
|----------|----------------|----------------|---------------------------|------------------------------|------------|-----------------|
| | | | | 投資 報酬率(%) | 委託經 營排名 | 大盤/指標 報酬率(%) |
| 復華 | 19,495,508,988 | 21,710,123,897 | 11.36 | 11.36 | — | 10.83/11.83 |

註：本次委託為相對報酬委託經營，以就業 99 指數為指定指標。

100 年第二次委託經營(續約 2)

單位：新台幣元

| 投信 名稱 | 委託金額 | 目前淨資產 | 108 年截至 12 月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (108.8.12~108.12.31) | | |
|----------|----------------|----------------|---------------------------|------------------------------|------------|-----------------|
| | | | | 投資 報酬率(%) | 委託經 營排名 | 大盤/目標 報酬率(%) |
| 復華 | 21,522,022,333 | 23,528,794,644 | 9.32 | 9.32 | — | 14.32/2.50 |

101 年第一次委託經營(續約)(相對報酬)

單位：新台幣元

| 投信 名稱 | 委託金額 | 目前淨資產 | 108 年截至 12 月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (105.4.18~108.12.31) | | |
|----------|----------------|----------------|---------------------------|------------------------------|------------|-----------------|
| | | | | 投資 報酬率(%) | 委託經 營排名 | 大盤/指標 報酬率(%) |
| 國泰 | 5,387,135,656 | 8,885,799,248 | 30.66 | 64.94 | 1 | 37.89/62.45 |
| 滙豐中華 | 10,927,481,593 | 17,374,829,794 | 29.57 | 59.00 | 2 | |
| 合計 | 16,314,617,249 | 26,260,629,042 | 29.94 | 60.96 | — | |

註：本次委託為相對報酬委託經營，以加權股價報酬指數為指定指標。

101 年第二次委託經營(續約)

單位：新台幣元

| 投信 名稱 | 委託金額 | 目前淨資產 | 108 年截至 12 月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (105.7.18~108.12.31) | | |
|----------|----------------|----------------|---------------------------|------------------------------|------------|-----------------|
| | | | | 投資 報酬率(%) | 委託經 營排名 | 大盤/目標 報酬率(%) |
| 野村 | 6,850,998,495 | 9,741,487,764 | 23.55 | 42.19 | 2 | 34.05/21.14 |
| 統一 | 8,019,680,328 | 11,413,455,325 | 16.93 | 47.08 | 1 | |
| 合計 | 14,870,678,823 | 21,154,943,089 | 19.89 | 44.43 | — | |

102 年第一次委託經營(續約)

單位：新台幣元

| 投信名稱 | 委託金額 | 目前淨資產 | 108 年截至 12 月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (106. 6. 7~108. 12. 31) | | |
|------|-------------------|-------------------|---------------------------|---------------------------------|------------|-----------------|
| | | | | 投資 報酬率(%) | 委託經 營排名 | 大盤/目標 報酬率(%) |
| 統一 | 4, 126, 252, 099 | 5, 896, 156, 080 | 19. 64 | 52. 63 | 1 | 17. 55/15. 90 |
| 復華 | 6, 481, 866, 342 | 8, 570, 165, 914 | 18. 74 | 32. 22 | 2 | |
| 合計 | 10, 608, 118, 441 | 14, 466, 321, 994 | 19. 11 | 39. 18 | — | |

102 年第二次委託經營(續約) (相對報酬)

單位：新台幣元

| 投信名稱 | 委託金額 | 目前淨資產 | 108 年截至 12 月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (107. 1. 22~108. 12. 31) | | |
|------|-------------------|-------------------|---------------------------|----------------------------------|------------|-----------------|
| | | | | 投資 報酬率(%) | 委託經 營排名 | 大盤/指標 報酬率(%) |
| 統一 | 7, 009, 597, 591 | 9, 236, 012, 116 | 32. 29 | 31. 76 | 1 | 7. 59/17. 11 |
| 復華 | 10, 038, 542, 112 | 11, 614, 514, 036 | 32. 11 | 16. 85 | 3 | |
| 群益 | 6, 918, 664, 544 | 8, 534, 520, 907 | 28. 20 | 23. 36 | 2 | |
| 滙豐中華 | 5, 006, 530, 255 | 5, 643, 499, 442 | 26. 96 | 14. 24 | 4 | |
| 合計 | 28, 973, 334, 502 | 35, 028, 546, 501 | 30. 31 | 20. 75 | — | |

註：本次委託為相對報酬委託經營，以加權股價報酬指數為指定指標。

103 年第一次委託經營第一期(續約)

單位：新台幣元

| 投信名稱 | 委託金額 | 目前淨資產 | 108 年截至 12 月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (107. 8. 13~108. 12. 31) | | |
|------|-------------------|-------------------|---------------------------|----------------------------------|------------|-----------------|
| | | | | 投資 報酬率(%) | 委託經 營排名 | 大盤/目標 報酬率(%) |
| 統一 | 9, 046, 774, 993 | 10, 591, 835, 061 | 22. 87 | 17. 08 | 1 | 9. 23/8. 77 |
| 復華 | 8, 967, 102, 893 | 9, 769, 083, 118 | 26. 13 | 8. 94 | 2 | |
| 合計 | 18, 013, 877, 886 | 20, 360, 918, 179 | 24. 41 | 13. 03 | — | |

103 年第一次委託經營第二期(續約)

單位：新台幣元

| 投信名稱 | 委託金額 | 目前淨資產 | 108 年截至 12 月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (107.10.8~108.12.31) | | |
|------|----------------|----------------|---------------------------|------------------------------|------------|-----------------|
| | | | | 投資 報酬率(%) | 委託經 營排名 | 大盤/目標 報酬率(%) |
| 台新 | 7,934,673,726 | 9,608,089,864 | 21.13 | 21.09 | 1 | 14.07/7.84 |
| 群益 | 8,622,603,994 | 10,098,296,678 | 18.58 | 17.11 | 2 | |
| 合計 | 16,557,277,720 | 19,706,386,542 | 19.81 | 19.02 | — | |

103 年第二次委託經營(相對報酬)

單位：新台幣元

| 投信名稱 | 委託金額 | 目前淨資產 | 108 年截至 12 月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (106.12.1~108.12.31) | | |
|------|----------------|----------------|---------------------------|------------------------------|------------|-----------------|
| | | | | 投資 報酬率(%) | 委託經 營排名 | 大盤/指標 報酬率(%) |
| 國泰 | 6,000,000,000 | 7,068,481,011 | 23.79 | 21.22 | 1 | 13.60/22.56 |
| 統一 | 6,000,000,000 | 6,996,241,551 | 21.25 | 19.78 | 2 | |
| 復華 | 6,000,000,000 | 6,965,362,891 | 21.81 | 18.68 | 4 | |
| 滙豐中華 | 6,000,000,000 | 6,970,981,590 | 23.24 | 18.63 | 5 | |
| 安聯 | 6,000,000,000 | 6,988,159,814 | 24.30 | 18.69 | 3 | |
| 合計 | 30,000,000,000 | 34,989,226,857 | 22.87 | 19.40 | — | |

註：本次委託為相對報酬委託經營，採分批撥款，上述績效係採幾何報酬率計算；以臺灣高薪 100 報酬指數為指定指標。

104 年第一次委託經營 (續約)

單位：新台幣元

| 投信名稱 | 委託金額 | 目前淨資產 | 108 年截至 12 月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (108.4.1~108.12.31) | | |
|------|----------------|----------------|---------------------------|-----------------------------|------------|-----------------|
| | | | | 投資 報酬率(%) | 委託經 營排名 | 大盤/目標 報酬率(%) |
| 統一 | 8,286,046,084 | 9,470,220,732 | 14.29 | 14.29 | 2 | 12.74/4.84 |
| 復華 | 3,651,168,229 | 4,355,099,348 | 19.28 | 19.28 | 1 | |
| 安聯 | 2,973,766,298 | 3,356,899,966 | 12.88 | 12.88 | 3 | |
| 合計 | 14,910,980,611 | 17,182,220,046 | 15.23 | 15.23 | — | |

106 年第一次委託經營

單位：新台幣元

| 投信名稱 | 委託金額 | 目前淨資產 | 108 年截至 12 月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (107. 2. 7~108. 12. 31) | | |
|------|----------------|----------------|---------------------------|---------------------------------|------------|-----------------|
| | | | | 投資 報酬率(%) | 委託經 營排名 | 大盤/目標 報酬率(%) |
| 台新 | 5,000,000,000 | 5,324,855,445 | 12.85 | 0.86 | 6 | 15.31/11.57 |
| 安聯 | 5,000,000,000 | 6,363,026,942 | 25.90 | 30.22 | 1 | |
| 保德信 | 5,000,000,000 | 5,738,506,114 | 17.36 | 13.66 | 4 | |
| 國泰 | 5,000,000,000 | 5,079,737,059 | 3.76 | -0.52 | 7 | |
| 復華 | 5,000,000,000 | 6,153,508,143 | 24.48 | 23.12 | 2 | |
| 群益 | 5,000,000,000 | 5,462,422,148 | 14.44 | 9.20 | 5 | |
| 滙豐中華 | 5,000,000,000 | 5,771,458,175 | 16.08 | 16.66 | 3 | |
| 合計 | 35,000,000,000 | 39,893,514,026 | 16.49 | 13.23 | — | |

107 年第一次委託經營(相對報酬)

單位：新台幣元

| 投信名稱 | 委託金額 | 目前淨資產 | 108 年截至 12 月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (107. 10. 24~108. 12. 31) | | |
|------|----------------|----------------|---------------------------|-----------------------------------|------------|-----------------|
| | | | | 投資 報酬率(%) | 委託經 營排名 | 大盤/指標 報酬率(%) |
| 台新 | 2,000,000,000 | 2,670,444,281 | 32.28 | 33.52 | 1 | 22.73/28.35 |
| 安聯 | 2,000,000,000 | 2,645,321,810 | 32.51 | 32.27 | 2 | |
| 保德信 | 2,000,000,000 | 2,575,870,700 | 30.24 | 28.79 | 7 | |
| 統一 | 2,000,000,000 | 2,578,258,861 | 31.06 | 28.91 | 6 | |
| 國泰 | 2,000,000,000 | 2,594,389,098 | 30.81 | 29.72 | 5 | |
| 復華 | 2,000,000,000 | 2,602,397,193 | 30.71 | 30.12 | 3 | |
| 群益 | 2,000,000,000 | 2,597,130,852 | 29.99 | 29.86 | 4 | |
| 合計 | 14,000,000,000 | 18,263,812,795 | 31.09 | 30.46 | — | |

註：本批次委託為相對報酬委託經營，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：新台幣元

| 投信名稱 | 委託金額 | 目前淨資產 | 108 年截至 12 月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (108.5.24~108.12.31) | | |
|------|----------------|----------------|---------------------------|------------------------------|------------|-----------------|
| | | | | 投資 報酬率(%) | 委託經 營排名 | 大盤/目標 報酬率(%) |
| 安聯 | 3,000,000,000 | 3,412,266,144 | 13.74 | 13.74 | 4 | 16.38/3.80 |
| 施羅德 | 3,000,000,000 | 3,365,067,322 | 12.17 | 12.17 | 6 | |
| 統一 | 3,000,000,000 | 3,450,113,749 | 15.00 | 15.00 | 3 | |
| 野村 | 3,000,000,000 | 3,609,025,344 | 20.30 | 20.30 | 1 | |
| 國泰 | 3,000,000,000 | 3,303,636,256 | 10.12 | 10.12 | 7 | |
| 復華 | 3,000,000,000 | 3,488,865,729 | 16.30 | 16.30 | 2 | |
| 群益 | 3,000,000,000 | 3,407,059,161 | 13.57 | 13.57 | 5 | |
| 合計 | 21,000,000,000 | 24,036,033,705 | 14.46 | 14.46 | — | |

2. 舊制勞工退休基金

國內 98 年第二次委託經營(續約 3)

單位：新台幣元

| 投信名稱 | 委託金額 | 目前淨資產 | 108 年截至 12 月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (108.1.28~108.12.31) | | |
|------|----------------|----------------|---------------------------|------------------------------|------------|-----------------|
| | | | | 投資 報酬率(%) | 委託經 營排名 | 大盤/目標 報酬率(%) |
| 富邦 | 5,957,934,152 | 6,828,665,045 | 14.61 | 14.61 | 2 | 20.34/5.95 |
| 統一 | 6,491,384,983 | 7,583,216,658 | 16.82 | 16.82 | 1 | |
| 合計 | 12,449,319,135 | 14,411,881,703 | 15.76 | 15.76 | — | |

國內 101 年第一次委託經營(相對報酬)(續約)

單位：新台幣元

| 投信名稱 | 委託金額 | 目前淨資產 | 108 年截至 12 月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (105.10.31~108.12.31) | | |
|------|---------------|---------------|---------------------------|-------------------------------|------------|-----------------|
| | | | | 投資 報酬率(%) | 委託經 營排名 | 大盤/指標 報酬率(%) |
| 匯豐中華 | 5,684,367,652 | 8,055,172,160 | 29.75 | 41.71 | — | 28.91/45.83 |

註：本次委託為相對報酬委託經營，採分批撥款，上述績效係採幾何報酬率計算；以加權股價報酬指數為指定指標。

國內 101 年第二次委託經營(續約)

單位：新台幣元

| 投信名稱 | 委託金額 | 目前淨資產 | 108 年截至 12 月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (105.05.03~108.12.31) | | |
|------|----------------|----------------|---------------------------|-------------------------------|------------|-----------------|
| | | | | 投資 報酬率(%) | 委託經 營排名 | 大盤/目標 報酬率(%) |
| 野村 | 16,650,814,154 | 26,444,945,965 | 24.64 | 58.82 | — | 43.20/22.36 |

國內 102 年第一次委託經營(續約)

單位：新台幣元

| 投信名稱 | 委託金額 | 目前淨資產 | 108 年截至 12 月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (106.6.7~108.12.31) | | |
|------|----------------|----------------|---------------------------|-----------------------------|------------|-----------------|
| | | | | 投資 報酬率(%) | 委託經 營排名 | 大盤/目標 報酬率(%) |
| 統一 | 4,126,679,953 | 5,897,075,508 | 19.64 | 52.63 | 1 | 17.55/15.90 |
| 復華 | 12,007,032,629 | 15,893,960,007 | 18.69 | 32.37 | 2 | |
| 合計 | 16,133,712,582 | 21,791,035,515 | 18.94 | 36.80 | — | |

國內 104 年第一次委託經營(續約)

單位：新台幣元

| 投信名稱 | 委託金額 | 目前淨資產 | 108 年截至 12 月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (108.4.1~108.12.31) | | |
|------|----------------|----------------|---------------------------|-----------------------------|------------|-----------------|
| | | | | 投資 報酬率(%) | 委託經 營排名 | 大盤/目標 報酬率(%) |
| 統一 | 8,286,785,149 | 9,471,222,796 | 14.29 | 14.29 | 2 | 12.74/4.84 |
| 復華 | 3,651,419,951 | 4,355,465,304 | 19.28 | 19.28 | 1 | |
| 安聯 | 2,974,008,140 | 3,357,226,599 | 12.89 | 12.89 | 3 | |
| 合計 | 14,912,213,240 | 17,183,914,699 | 15.23 | 15.23 | — | |

國內 106 年第一次委託經營

單位：新台幣元

| 投信名稱 | 委託金額 | 目前淨資產 | 108 年截至 12 月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (107. 2. 7~108. 12. 31) | | |
|------|----------------|----------------|---------------------------|---------------------------------|------------|-----------------|
| | | | | 投資 報酬率(%) | 委託經 營排名 | 大盤/目標 報酬率(%) |
| 台新 | 5,000,000,000 | 5,325,009,377 | 12.85 | 0.86 | 6 | 15.31/11.57 |
| 安聯 | 5,000,000,000 | 6,363,334,924 | 25.90 | 30.23 | 1 | |
| 保德信 | 5,000,000,000 | 5,738,742,068 | 17.36 | 13.67 | 4 | |
| 國泰 | 5,000,000,000 | 5,079,898,249 | 3.76 | -0.51 | 7 | |
| 復華 | 5,000,000,000 | 6,153,754,258 | 24.48 | 23.13 | 2 | |
| 群益 | 5,000,000,000 | 5,462,778,554 | 14.44 | 9.21 | 5 | |
| 匯豐中華 | 5,000,000,000 | 5,771,814,527 | 16.08 | 16.67 | 3 | |
| 合計 | 35,000,000,000 | 39,895,331,957 | 16.49 | 13.24 | — | |

(二) 108 年 12 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 2)

單位：美元

| 受託機構 | 委託金額 | 目前淨資產 | 108 年截至 12 月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (105.6.6~108.12.31) | | |
|-------------|---------------|---------------|---------------------------|-----------------------------|----|--------------|
| | | | | 投資 報酬率(%) | 排名 | 指標報酬率 (%) |
| 聯博 | 793,101,125 | 845,873,066 | 5.54 | 6.65 | 2 | 7.48 |
| 富蘭克林 坦伯頓 | 744,405,663 | 802,810,487 | 8.77 | 7.85 | 1 | |
| 合計 | 1,537,506,788 | 1,648,683,553 | 7.09 | 7.23 | — | |

97-2 全球增值債券型 (續約 2)

單位：美元

| 受託機構 | 委託金額 | 目前淨資產 | 108 年截至 12 月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (106.1.6~108.12.31) | | |
|-------|---------------|---------------|---------------------------|-----------------------------|----|--------------|
| | | | | 投資 報酬率(%) | 排名 | 指標報酬率 (%) |
| PIMCO | 1,219,586,290 | 1,358,549,658 | 7.67 | 14.22 | — | 12.85 |

97-2 全球增值股票型 (續約 2)

單位：美元

| 受託機構 | 委託金額 | 目前淨資產 | 108 年截至 12 月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (106.2.6~108.12.31) | | |
|------|---------------|---------------|---------------------------|-----------------------------|----|--------------|
| | | | | 投資 報酬率(%) | 排名 | 指標報酬率 (%) |
| 貝萊德 | 967,348,593 | 1,345,754,997 | 25.86 | 39.12 | 1 | 37.31 |
| 摩根 | 802,177,668 | 1,107,379,691 | 27.21 | 38.05 | 2 | |
| 合計 | 1,769,526,261 | 2,453,134,688 | 26.47 | 38.63 | — | |

98-1 亞太（日本除外）主動股票型（續約 2）

單位：美元

| 受託機構 | 委託金額 | 目前淨資產 | 108 年截至 12 月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (106.11.17~108.12.31) | | |
|------|-------------|-------------|---------------------------|-------------------------------|----|--------------|
| | | | | 投資 報酬率(%) | 排名 | 指標報酬率 (%) |
| 景順 | 602,621,073 | 612,111,058 | 18.80 | 5.17 | — | 5.24 |

98-1 全球被動股票型（續約 2）

單位：美元

| 受託機構 | 委託金額 | 目前淨資產 | 108 年截至 12 月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (106.12.4~108.12.31) | | |
|------|---------------|---------------|---------------------------|------------------------------|----|--------------|
| | | | | 投資 報酬率(%) | 排名 | 指標報酬率 (%) |
| 貝萊德 | 535,489,288 | 630,250,028 | 26.93 | 17.70 | 2 | 16.98 |
| 道富 | 728,826,441 | 859,987,786 | 27.01 | 18.00 | 1 | |
| 合計 | 1,264,315,729 | 1,490,237,814 | 26.98 | 17.87 | — | |

99-1 全球新興市場主動股票型（續約 2）

單位：美元

| 受託機構 | 委託金額 | 目前淨資產 | 108 年截至 12 月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (107.8.27~108.12.31) | | |
|------|-------------|-------------|---------------------------|------------------------------|----|--------------|
| | | | | 投資 報酬率(%) | 排名 | 指標報酬率 (%) |
| 瑞萬通博 | 757,229,489 | 832,922,957 | 16.29 | 10.00 | — | 8.67 |

100-1 全球基本面指數被動股票型（續約）

單位：美元

| 受託機構 | 委託金額 | 目前淨資產 | 108 年截至 12 月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (105.7.1~108.12.31) | | |
|------|---------------|---------------|---------------------------|-----------------------------|----|--------------|
| | | | | 投資 報酬率(%) | 排名 | 指標報酬率 (%) |
| 道富 | 662,180,574 | 934,096,076 | 22.15 | 46.58 | 1 | 45.53 |
| 貝萊德 | 666,301,910 | 938,393,341 | 22.03 | 46.32 | 2 | |
| 合計 | 1,328,482,484 | 1,872,489,417 | 22.09 | 46.45 | — | |

100-1 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 | 108年截至12月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (106.3.6~108.12.31) | | |
|----------------|---------------|---------------|------------------------|-----------------------------|----|--------------|
| | | | | 投資 報酬率(%) | 排名 | 指標報酬率 (%) |
| Cohen & Steers | 1,251,936,411 | 1,626,393,436 | 25.85 | 35.63 | 1 | 27.02 |
| 景順 | 1,084,104,927 | 1,370,835,222 | 23.04 | 28.54 | 2 | |
| 合計 | 2,336,041,338 | 2,997,228,658 | 24.53 | 32.17 | — | |

101-1 全球新興市場主動債券型 (續約)

單位：美元

| 受託機構 | 委託金額 | 目前淨資產 | 108年截至12月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (106.7.31~108.12.31) | | |
|---------|-------------|---------------|------------------------|------------------------------|----|--------------|
| | | | | 投資 報酬率(%) | 排名 | 指標報酬率 (%) |
| Ashmore | 454,453,121 | 500,913,990 | 11.51 | 10.22 | 2 | 14.14 |
| Pictet | 454,291,634 | 516,677,474 | 14.68 | 13.73 | 1 | |
| 合計 | 908,744,755 | 1,017,591,464 | 13.10 | 11.98 | — | |

101-1 全球低波動指數被動股票型 (續約)

單位：美元

| 受託機構 | 委託金額 | 目前淨資產 | 108年截至12月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (107.4.18~108.12.31) | | |
|------|---------------|---------------|------------------------|------------------------------|----|--------------|
| | | | | 投資 報酬率(%) | 排名 | 指標報酬率 (%) |
| 道富 | 798,231,848 | 887,192,262 | 16.68 | 11.30 | 2 | 10.90 |
| 貝萊德 | 794,293,722 | 883,086,497 | 16.58 | 11.32 | 1 | |
| 合計 | 1,592,525,570 | 1,770,278,759 | 16.63 | 11.31 | — | |

102-1 全球高股利增值股票型 (續約)

單位：美元

| 受託機構 | 委託金額 | 目前淨資產 | 108年截至12月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (108.1.22~108.12.31) | | |
|------|---------------|---------------|------------------------|------------------------------|----|--------------|
| | | | | 投資 報酬率(%) | 排名 | 指標報酬率 (%) |
| 瑞萬通博 | 756,315,337 | 934,161,700 | 23.51 | 23.51 | 1 | 18.72 |
| MFS | 603,318,800 | 696,452,410 | 15.44 | 15.44 | 3 | |
| 威靈頓 | 631,647,315 | 765,955,893 | 21.26 | 21.26 | 2 | |
| 合計 | 1,991,281,452 | 2,396,570,003 | 20.35 | 20.35 | — | |

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 | 108年截至12月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (108.4.25~108.12.31) | | |
|---------|---------------|---------------|------------------------|------------------------------|----|--------------|
| | | | | 投資 報酬率(%) | 排名 | 指標報酬率 (%) |
| Bluebay | 586,338,464 | 621,566,076 | 7.41 | 7.41 | 1 | 6.46 |
| 貝萊德 | 587,231,657 | 619,911,844 | 7.00 | 7.00 | 2 | |
| 盧米斯 | 592,703,100 | 624,739,519 | 6.78 | 6.78 | 3 | |
| 合計 | 1,766,273,221 | 1,866,217,439 | 7.06 | 7.06 | — | |

104-1 全球高品質被動股票型

單位：美元

| 受託機構 | 委託金額 | 目前淨資產 | 108年截至12月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (104.8.11~108.12.31) | | |
|-------|---------------|---------------|------------------------|------------------------------|----|--------------|
| | | | | 投資 報酬率(%) | 排名 | 指標報酬率 (%) |
| 北美信託 | 650,000,000 | 1,095,471,675 | 35.24 | 66.87 | 1 | 66.05 |
| LGIM | 650,000,000 | 1,094,387,409 | 35.04 | 66.43 | 2 | |
| Geode | 650,000,000 | 1,093,894,887 | 35.33 | 66.43 | 3 | |
| 合計 | 1,950,000,000 | 3,283,753,971 | 35.20 | 66.58 | — | |

104-2 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 | 108年截至12月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (104.9.25~108.12.31) | | |
|----------------|---------------|---------------|------------------------|------------------------------|----|--------------|
| | | | | 投資 報酬率(%) | 排名 | 指標報酬率 (%) |
| Cohen & Steers | 300,000,000 | 442,813,013 | 27.19 | 41.28 | 4 | 49.79 |
| 麥格理 | 500,000,000 | 680,785,515 | 27.18 | 45.51 | 3 | |
| Magellan | 900,000,000 | 1,189,585,612 | 26.60 | 62.25 | 1 | |
| RREEF | 500,000,000 | 688,314,403 | 29.91 | 51.73 | 2 | |
| 合計 | 2,200,000,000 | 3,001,498,543 | 27.49 | 50.37 | — | |

104-1 全球主權信用增值債券型

單位：美元

| 受託機構 | 委託金額 | 目前淨資產 | 108年截至12月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (104.11.13~108.12.31) | | |
|------------|---------------|---------------|------------------------|-------------------------------|----|--------------|
| | | | | 投資 報酬率(%) | 排名 | 指標報酬率 (%) |
| NNIP | 200,000,000 | 214,671,632 | 7.61 | 12.90 | 3 | 22.39 |
| Brandywine | 500,000,000 | 561,494,999 | 9.90 | 22.74 | 1 | |
| 盧米斯 | 300,000,000 | 351,291,490 | 9.12 | 20.34 | 2 | |
| 合計 | 1,000,000,000 | 1,127,458,121 | 9.21 | 18.82 | — | |

105-1 全球多元資產型

單位：美元

| 受託機構 | 委託金額 | 目前淨資產 | 108年截至12月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (105.7.20~108.12.31) | | |
|------|---------------|---------------|------------------------|------------------------------|----|-----------------|
| | | | | 投資 報酬率(%) | 排名 | 指標/目標 報酬率(%) |
| 安聯 | 370,000,000 | 400,091,673 | 8.24 | 7.89 | 4 | 6.43/23.69 |
| 摩根 | 1,100,000,000 | 1,298,938,903 | 14.88 | 30.22 | 1 | |
| DWS | 600,000,000 | 700,153,597 | 15.25 | 20.32 | 2 | |
| 柏瑞 | 600,000,000 | 699,699,780 | 14.39 | 18.79 | 3 | |
| 合計 | 2,670,000,000 | 3,098,883,953 | 13.59 | 20.07 | — | |

註：本批次為絕對報酬型。

105-1 亞太混合指數增值股票型

單位：美元

| 受託機構 | 委託金額 | 目前淨資產 | 108年截至12月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (105.8.24~108.12.31) | | |
|------|---------------|---------------|------------------------|------------------------------|----|--------------|
| | | | | 投資 報酬率(%) | 排名 | 指標報酬率 (%) |
| 貝萊德 | 500,000,000 | 629,549,835 | 14.43 | 28.04 | 1 | 30.24 |
| 北美信託 | 300,000,000 | 373,145,319 | 11.76 | 17.20 | 3 | |
| 領航 | 450,000,000 | 539,374,028 | 10.66 | 22.49 | 2 | |
| 合計 | 1,250,000,000 | 1,542,069,182 | 12.35 | 22.59 | — | |

106-1 全球 ESG 混合指數被動股票型

單位：美元

| 受託機構 | 委託金額 | 目前淨資產 | 108年截至12月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (106.6.22~108.12.31) | | |
|------|---------------|---------------|------------------------|------------------------------|----|--------------|
| | | | | 投資 報酬率(%) | 排名 | 指標報酬率 (%) |
| 貝萊德 | 300,000,000 | 365,177,702 | 25.43 | 30.08 | 3 | 29.71 |
| DWS | 350,000,000 | 421,798,924 | 25.68 | 30.09 | 2 | |
| 道富 | 350,000,000 | 421,594,036 | 25.47 | 30.05 | 4 | |
| 北美信託 | 350,000,000 | 422,348,146 | 25.56 | 30.25 | 1 | |
| 合計 | 1,350,000,000 | 1,630,918,808 | 25.54 | 30.11 | — | |

106-1 絕對報酬債券型

單位：美元

| 受託機構 | 委託金額 | 目前淨資產 | 108年截至12月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (106.7.25~108.12.31) | | |
|------------------|---------------|---------------|------------------------|------------------------------|----|-----------------|
| | | | | 投資 報酬率(%) | 排名 | 指標/目標 報酬率(%) |
| American Century | 400,000,000 | 421,027,572 | 5.39 | 5.40 | 4 | 4.49/10.59 |
| 富達 | 550,000,000 | 605,179,748 | 16.44 | 12.33 | 1 | |
| 富蘭克林 坦伯頓 | 400,000,000 | 420,171,784 | 4.31 | 5.63 | 3 | |
| TCW | 550,000,000 | 586,272,300 | 6.84 | 9.55 | 2 | |
| 合計 | 1,900,000,000 | 2,032,651,404 | 8.20 | 8.28 | — | |

註：本批次為絕對報酬型。

107-1 絕對報酬股票型

單位：美元

| 受託機構 | 委託金額 | 目前淨資產 | 108年截至12月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (108.1.23~108.12.31) | | |
|------|---------------|---------------|------------------------|------------------------------|----|-----------------|
| | | | | 投資 報酬率(%) | 排名 | 指標/目標 報酬率(%) |
| 野村 | 400,000,000 | 399,638,420 | -1.45 | -1.45 | 5 | 2.16/6.86 |
| 景順 | 400,000,000 | 422,032,066 | 9.16 | 9.16 | 3 | |
| 威靈頓 | 400,000,000 | 439,766,279 | 16.02 | 16.02 | 1 | |
| CPR | 400,000,000 | 422,231,150 | 8.05 | 8.05 | 4 | |
| 道富 | 400,000,000 | 435,278,012 | 14.66 | 14.66 | 2 | |
| 合計 | 2,000,000,000 | 2,118,945,927 | 9.27 | 9.27 | — | |

註：本批次為絕對報酬型。

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 | 108年截至12月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (108.12.18~108.12.31) | | |
|--------|-------------|-------------|------------------------|-------------------------------|----|--------------|
| | | | | 投資 報酬率(%) | 排名 | 指標報酬率 (%) |
| Amundi | 100,000,000 | 100,547,864 | 0.55 | 0.55 | 5 | 1.37 |
| DWS | 100,000,000 | 100,602,239 | 0.60 | 0.60 | 4 | |
| 野村 | 100,000,000 | 100,823,319 | 0.82 | 0.82 | 3 | |
| 荷寶 | 100,000,000 | 101,681,374 | 1.68 | 1.68 | 1 | |
| 道富 | 100,000,000 | 101,057,210 | 1.06 | 1.06 | 2 | |
| 合計 | 500,000,000 | 504,712,006 | 0.94 | 0.94 | — | |

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 | 108 年截至 12 月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (108.6.24~108.12.31) | | |
|------|-------------|-------------|---------------------------|------------------------------|----|--------------|
| | | | | 投資 報酬率(%) | 排名 | 指標 報酬率(%) |
| 富達 | 886,579,222 | 935,204,737 | 5.48 | 5.48 | — | 6.20 |

97-1 全球增值債券型(續約 2)

單位：美元

| 受託機構 | 委託金額 | 目前淨資產 | 108 年截至 12 月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (106.1.6~108.12.31) | | |
|-------|---------------|---------------|---------------------------|-----------------------------|----|--------------|
| | | | | 投資 報酬率(%) | 排名 | 指標 報酬率(%) |
| PIMCO | 1,023,576,760 | 1,158,590,345 | 7.69 | 14.39 | 1 | 12.85 |
| 盧米斯 | 798,763,197 | 891,547,770 | 7.15 | 13.03 | 2 | |
| 合計 | 1,822,339,957 | 2,050,138,115 | 7.45 | 13.80 | — | |

97-1 全球增值股票型(續約 2)

單位：美元

| 受託機構 | 委託金額 | 目前淨資產 | 108 年截至 12 月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (106.2.6~108.12.31) | | |
|------|-------------|---------------|---------------------------|-----------------------------|----|--------------|
| | | | | 投資 報酬率(%) | 排名 | 指標 報酬率(%) |
| 貝萊德 | 756,337,413 | 1,052,590,385 | 25.90 | 39.17 | — | 37.30 |

98-1 亞太(日本除外)主動股票型(續約 2)

單位：美元

| 受託機構 | 委託金額 | 目前淨資產 | 108 年截至 12 月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (106.11.17~108.12.31) | | |
|------|-------------|-------------|---------------------------|-------------------------------|----|--------------|
| | | | | 投資 報酬率(%) | 排名 | 指標 報酬率(%) |
| 景順 | 307,323,526 | 310,872,279 | 18.86 | 5.24 | — | 5.24 |

100-1 全球基本面指數被動股票型(續約)

單位：美元

| 受託機構 | 委託金額 | 目前淨資產 | 108年截至12月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (106.3.6~108.12.31) | | |
|------|---------------|---------------|------------------------|-----------------------------|----|--------------|
| | | | | 投資 報酬率(%) | 排名 | 指標 報酬率(%) |
| 貝萊德 | 305,588,950 | 398,847,185 | 22.31 | 25.08 | 4 | 24.15 |
| 道富 | 308,539,390 | 403,496,325 | 22.59 | 25.34 | 3 | |
| 瑞銀 | 306,994,134 | 401,774,943 | 22.15 | 25.36 | 2 | |
| 野村 | 307,549,840 | 403,192,803 | 22.38 | 25.54 | 1 | |
| 合計 | 1,228,672,314 | 1,607,311,256 | 22.36 | 25.33 | — | |

101-1 全球低波動指數被動股票型(續約)

單位：美元

| 受託機構 | 委託金額 | 目前淨資產 | 108年截至12月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (107.6.13~108.12.31) | | |
|------|-------------|-------------|------------------------|------------------------------|----|--------------|
| | | | | 投資 報酬率(%) | 排名 | 指標 報酬率(%) |
| 貝萊德 | 671,455,711 | 746,928,951 | 16.85 | 11.24 | — | 10.95 |

102-1 年全球高股利增值股票型(續約)

單位：美元

| 受託機構 | 委託金額 | 目前淨資產 | 108年截至12月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (108.1.22~108.12.31) | | |
|------|---------------|---------------|------------------------|------------------------------|----|--------------|
| | | | | 投資 報酬率(%) | 排名 | 指標 報酬率(%) |
| 瑞萬通博 | 287,169,673 | 354,685,968 | 23.51 | 23.51 | 1 | 18.72 |
| MFS | 246,618,331 | 284,860,871 | 15.51 | 15.51 | 3 | |
| 威靈頓 | 503,548,464 | 610,848,008 | 21.31 | 21.31 | 2 | |
| 合計 | 1,037,336,468 | 1,250,394,847 | 20.54 | 20.54 | — | |

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 | 108年截至12月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (108.5.29~108.12.31) | | |
|--------|-------------|-------------|------------------------|------------------------------|----|--------------|
| | | | | 投資 報酬率(%) | 排名 | 指標 報酬率(%) |
| Lazard | 713,987,040 | 782,295,519 | 10.40 | 10.40 | — | 10.54 |

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 | 108年截至12月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (108.8.27~108.12.31) | | |
|----------|-------------|-------------|------------------------|------------------------------|----|--------------|
| | | | | 投資 報酬率(%) | 排名 | 指標 報酬率(%) |
| 信安 環球 | 510,886,182 | 534,259,369 | 5.02 | 5.02 | 2 | 5.14 |
| AMP | 126,937,100 | 133,484,116 | 5.16 | 5.16 | 1 | |
| 合計 | 637,823,282 | 667,743,485 | 5.03 | 5.03 | — | |

105-1 全球多元資產型

單位：美元

| 受託機構 | 委託金額 | 目前淨資產 | 108年截至12月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (105.7.20~108.12.31) | | |
|------|---------------|---------------|------------------------|------------------------------|----|-----------------|
| | | | | 投資 報酬率(%) | 排名 | 指標/目標 報酬率(%) |
| 安聯 | 120,000,000 | 129,943,414 | 8.28 | 7.94 | 4 | 6.43/23.69 |
| 摩根 | 450,000,000 | 518,419,387 | 14.98 | 30.73 | 1 | |
| DWS | 250,000,000 | 282,977,033 | 15.07 | 20.20 | 2 | |
| 柏瑞 | 200,000,000 | 232,840,037 | 14.35 | 18.98 | 3 | |
| 合計 | 1,020,000,000 | 1,164,179,871 | 13.47 | 19.85 | — | |

註：本批次為絕對報酬型。

106-1 全球 ESG 混合指數被動股票型

單位：美元

| 受託機構 | 委託金額 | 目前淨資產 | 108 年截至 12 月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (106. 6. 22~108. 12. 31) | | |
|------|-------------|-------------|---------------------------|----------------------------------|----|--------------|
| | | | | 投資 報酬率(%) | 排名 | 指標 報酬率(%) |
| 貝萊德 | 150,000,000 | 184,183,440 | 25.36 | 29.78 | 4 | 29.71 |
| DWS | 150,000,000 | 184,633,287 | 25.69 | 30.21 | 2 | |
| 道富 | 150,000,000 | 184,835,371 | 25.50 | 30.29 | 1 | |
| 北美信託 | 150,000,000 | 184,575,208 | 25.59 | 30.04 | 3 | |
| 合計 | 600,000,000 | 738,227,306 | 25.53 | 30.08 | — | |

106-1 絕對報酬債券型

單位：美元

| 受託機構 | 委託金額 | 目前淨資產 | 108 年截至 12 月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (106. 7. 25~108. 12. 31) | | |
|------------------|---------------|---------------|---------------------------|----------------------------------|----|-----------------|
| | | | | 投資 報酬率(%) | 排名 | 指標/目標 報酬率(%) |
| American Century | 300,000,000 | 315,041,283 | 5.45 | 5.52 | 4 | 4.50/10.59 |
| 富達 | 300,000,000 | 337,832,384 | 16.42 | 12.32 | 1 | |
| 富蘭克林 坦伯頓 | 300,000,000 | 312,590,380 | 4.08 | 5.76 | 3 | |
| TCW | 300,000,000 | 323,189,416 | 6.77 | 9.49 | 2 | |
| 合計 | 1,200,000,000 | 1,288,653,463 | 8.11 | 8.30 | — | |

註：本批次為絕對報酬型。

107-1 絕對報酬股票型

單位：美元

| 受託機構 | 委託金額 | 目前淨資產 | 108 年截至 12 月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (108. 1. 23~108. 12. 31) | | |
|------|-------------|-------------|---------------------------|----------------------------------|----|-----------------|
| | | | | 投資 報酬率(%) | 排名 | 指標/目標 報酬率(%) |
| 野村 | 80,000,000 | 79,816,993 | -1.58 | -1.58 | 5 | 2.16/6.86 |
| 景順 | 80,000,000 | 84,559,665 | 9.08 | 9.08 | 3 | |
| 威靈頓 | 80,000,000 | 87,529,797 | 15.99 | 15.99 | 1 | |
| CPR | 80,000,000 | 84,426,494 | 7.97 | 7.97 | 4 | |
| 道富 | 80,000,000 | 86,668,767 | 14.44 | 14.44 | 2 | |
| 合計 | 400,000,000 | 423,001,716 | 9.17 | 9.17 | — | |

註：本批次為絕對報酬型。

(二)108年12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)

108年12月31日

1. 避險：

| 種類 | 避險比例 |
|--------|-------|
| 權益證券避險 | 0% |
| 匯率避險 | 5.77% |

2. 投資：無

(二)舊制勞工退休基金自營部位

(依交易目的)

108年12月31日

1. 避險：

| 種類 | 避險比例 |
|--------|------|
| 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：新台幣元

| | 餘絀 | 收入 | 支出 |
|---------|----------------|----------------|----------------|
| 108年12月 | 35,780,414,434 | 52,558,951,376 | 16,778,536,942 |

註：上述金額係依權責基礎填列。

(二)舊制勞工退休基金

單位：新台幣元

| | 餘絀 | 收入 | 支出 |
|---------|----------------|----------------|---------------|
| 108年12月 | 13,784,069,618 | 20,417,175,250 | 6,633,105,632 |

註：上述金額係依權責基礎填列。

八、勞工退休基金投資運用現金收支表

(一)新制勞工退休基金

108年12月份

單位：新台幣元

| 項 目 | 金 額 |
|---------|-----------------|
| 基金收入 | 307,757,847,200 |
| 基金支出 | 313,232,349,262 |
| 現金增(減)數 | -5,474,502,062 |

註：本表採現金基礎。

(二)舊制勞工退休基金

108年12月份

單位：新台幣元

| 項 目 | 金 額 |
|---------|----------------|
| 基金收入 | 33,785,135,418 |
| 基金支出 | 33,785,233,571 |
| 現金增(減)數 | -98,153 |

註：本表採現金基礎。