

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11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 | 9.96% | 0.73% | 18.12% | 22.29% | 6.22% |
| 舊制基金 | 11.85% | | | | |

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(107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 | -2.07% | 0.94% | -8.60% | -9.42% | -1.20% |
| 舊制基金 | -2.15% | | | | |

(三) 近三年(105~107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 | 2.77% | 0.95% | 5.27% | 6.60% | 2.70% |
| 舊制基金 | 3.13% | | | | |

(四) 近五年(103~107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 | 2.80% | 1.17% | 2.47% | 4.26% | 1.08% |
| 舊制基金 | 3.17% | | | | |

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 11 月底止基金規模與收益 | | | |
|--------------------------------|------|-----------------|----------------------------|
| 基金運用規模 | | | 2 兆 4,334 億 8,048 萬元 |
| 108 年截至 11 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 | 74 億 5,700 萬元 1.11% |
| | | 國內權益證券 及國外投資 | 304 億 1,132 萬元 10.57% |
| | 委託經營 | | 1,933 億 7,152 萬元 14.84% |
| | 合 計 | | 2,312 億 3,984 萬元 9.96% |

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 11 月之保證收益率為 1.0541%。

2. 舊制勞工退休基金

| 至 108 年 11 月底止基金規模與收益 | | | |
|--------------------------------|------|-----------------|----------------------------|
| 基金運用規模 | | | 9,450 億 374 萬元 |
| 108 年截至 11 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 | 22 億 4,244 萬元 0.95% |
| | | 國內權益證券 及國外投資 | 351 億 4,543 萬元 16.34% |
| | 委託經營 | | 632 億 390 萬元 14.05% |
| | 合 計 | | 1,005 億 9,177 萬元 11.85% |

註：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。

(二) 資產配置

1. 新制勞工退休基金

截至 108 年 11 月底

單位：新台幣元

| 項 目 | 餘 額 | 占基金運用比例(%) |
|-----------------|--------------------------|---------------|
| 自行運用 | 1,064,178,149,176 | 43.73 |
| 轉存金融機構 | 511,837,806,190 | 21.03 |
| 短期票券 | 37,789,641,078 | 1.55 |
| 公債、公司債、金融債券及特別股 | 211,880,049,007 | 8.71 |
| 股票及受益憑證投資(含期貨) | 90,686,377,551 | 3.73 |
| 國外投資 | 211,984,275,350 | 8.71 |
| 固定收益 | 141,952,820,053 | 5.83 |
| 權益證券 | 37,089,229,657 | 1.53 |
| 另類投資 | 32,942,225,640 | 1.35 |
| 委託經營 | 1,369,302,326,013 | 56.27 |
| 國內委託經營 | 333,431,236,707 | 13.71 |
| 國外委託經營 | 1,035,871,089,306 | 42.56 |
| 固定收益 | 259,916,879,348 | 10.68 |
| 權益證券 | 529,394,990,928 | 21.75 |
| 另類投資 | 246,559,219,030 | 10.13 |
| 合 計 | 2,433,480,475,189 | 100.00 |

2. 舊制勞工退休基金

截至 108 年 11 月底

單位：新台幣元

| 項 目 | 餘 額 | 占基金運用比例(%) |
|-------------------|------------------------|---------------|
| 自行運用 | 463,869,582,183 | 49.09 |
| 轉存金融機構 | 153,713,820,036 | 16.27 |
| 短期票券 | 40,518,802,816 | 4.29 |
| 公債、金融債券、公司債及證券化商品 | 66,625,879,875 | 7.05 |
| 股票及受益憑證投資(含期貨) | 85,733,284,740 | 9.07 |
| 國外投資 | 117,277,794,716 | 12.41 |
| 固定收益 | 57,865,658,273 | 6.12 |
| 權益證券 | 41,670,883,242 | 4.41 |
| 另類投資 | 17,741,253,201 | 1.88 |
| 委託經營 | 481,134,162,636 | 50.91 |
| 國內委託經營 | 112,670,043,044 | 11.92 |
| 國外委託經營 | 368,464,119,592 | 38.99 |
| 固定收益 | 105,755,605,469 | 11.19 |
| 權益證券 | 188,154,174,428 | 19.91 |
| 另類投資 | 74,554,339,695 | 7.89 |
| 合 計 | 945,003,744,819 | 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 11 月底

單位：新台幣元

| 項 目 | 金 額 | 占基金運用比例(%) |
|------|-------------------|------------|
| 自行運用 | 1,064,178,149,176 | 43.73 |
| 委託經營 | 1,369,302,326,013 | 56.27 |

2. 舊制勞工退休基金

截至 108 年 11 月底

單位：新台幣元

| 項 目 | 金 額 | 占基金運用比例(%) |
|------|-----------------|------------|
| 自行運用 | 463,869,582,183 | 49.09 |
| 委託經營 | 481,134,162,636 | 50.91 |

(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 11 月底

單位：新台幣元

| 項 目 | 金 額 | 占基金運用比例 (%) |
|---------|-------------------|-------------|
| 國 內 投 資 | 1,185,625,110,533 | 48.73 |
| 國 外 投 資 | 1,247,855,364,656 | 51.27 |

2. 舊制勞工退休基金

截至 108 年 11 月底

單位：新台幣元

| 項 目 | 金 額 | 占基金運用比例 (%) |
|---------|-----------------|-------------|
| 國 內 投 資 | 459,261,830,511 | 48.60 |
| 國 外 投 資 | 485,741,914,308 | 51.40 |

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 11 月底

| 項 目 | 收益率 (%) |
|--------|---------|
| 國內權益證券 | 19.48 |

2. 舊制勞工退休基金

截至 108 年 11 月底

| 項 目 | 收益率 (%) |
|--------|---------|
| 國內權益證券 | 22.47 |

(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 11 月底 單位：新台幣元

| 項 目 | 金 額 | 比 例 (%) |
|--------|----------------|---------|
| 國內權益證券 | 90,686,377,551 | 3.73 |

2. 舊制勞工退休基金

截至 108 年 11 月底 單位：新台幣元

| 項 目 | 金 額 | 比 例 (%) |
|--------|----------------|---------|
| 國內權益證券 | 85,733,284,740 | 9.07 |

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 11 月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (108.9.27~108.11.30) | | |
|----------|----------------|----------------|---------------------------|------------------------------|------------|-----------------|
| | | | | 投資 報酬率(%) | 委託經 營排名 | 大盤/目標 報酬率(%) |
| 野村 | 18,580,874,211 | 19,556,362,676 | 5.25 | 5.25 | — | 5.68/1.14 |

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 11 月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (106.1.20~108.11.30) | | |
|------|---------------|---------------|---------------------------|------------------------------|------------|-----------------|
| | | | | 投資 報酬率(%) | 委託經 營排名 | 大盤/目標 報酬率(%) |
| 野村 | 7,198,313,969 | 9,015,364,320 | 10.96 | 25.24 | — | 23.30/17.61 |

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 11 月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (107.7.16~108.11.30) | | |
|------|----------------|----------------|---------------------------|------------------------------|------------|-----------------|
| | | | | 投資 報酬率(%) | 委託經 營排名 | 大盤/目標 報酬率(%) |
| 野村 | 12,940,861,671 | 14,345,375,435 | 19.11 | 10.85 | 1 | 5.75/8.70 |
| 保德信 | 5,153,416,157 | 5,421,136,566 | 14.00 | 5.20 | 2 | |
| 合計 | 18,094,277,828 | 19,766,512,001 | 17.67 | 9.24 | — | |

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 11 月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (107.12.3~108.11.30) | | |
|------|---------------|---------------|---------------------------|------------------------------|------------|-----------------|
| | | | | 投資 報酬率(%) | 委託經 營排名 | 大盤/目標 報酬率(%) |
| 國泰 | 9,241,043,825 | 9,544,465,658 | 3.09 | 3.28 | — | 16.20/6.35 |

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 11 月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (108.7.15~108.11.30) | | |
|------|----------------|----------------|---------------------------|------------------------------|------------|-----------------|
| | | | | 投資 報酬率(%) | 委託經 營排名 | 大盤/指標 報酬率(%) |
| 復華 | 19,495,508,988 | 20,860,562,561 | 7.00 | 7.00 | — | 6.15/7.73 |

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 11 月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (108.8.12~108.11.30) | | |
|------|----------------|----------------|---------------------------|------------------------------|------------|-----------------|
| | | | | 投資 報酬率(%) | 委託經 營排名 | 大盤/目標 報酬率(%) |
| 復華 | 21,522,022,333 | 22,655,575,905 | 5.27 | 5.27 | — | 9.48/1.95 |

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 11 月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (105.4.18~108.11.30) | | |
|------|----------------|----------------|---------------------------|------------------------------|------------|-----------------|
| | | | | 投資 報酬率(%) | 委託經 營排名 | 大盤/指標 報酬率(%) |
| 國泰 | 5,387,135,656 | 8,459,833,512 | 24.39 | 57.04 | 1 | 32.06/55.30 |
| 滙豐中華 | 10,927,481,593 | 16,637,176,405 | 24.07 | 52.25 | 2 | |
| 合計 | 16,314,617,249 | 25,097,009,917 | 24.18 | 53.83 | — | |

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 11 月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (105.7.18~108.11.30) | | |
|------|----------------|----------------|---------------------------|------------------------------|------------|-----------------|
| | | | | 投資 報酬率(%) | 委託經 營排名 | 大盤/目標 報酬率(%) |
| 野村 | 6,850,998,495 | 9,375,174,175 | 18.90 | 36.84 | 2 | 28.38/20.60 |
| 統一 | 8,019,680,328 | 11,094,047,721 | 13.66 | 42.96 | 1 | |
| 合計 | 14,870,678,823 | 20,469,221,896 | 16.00 | 39.75 | — | |

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 11 月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (106.6.7~108.11.30) | | |
|------|----------------|----------------|---------------------------|-----------------------------|------------|-----------------|
| | | | | 投資 報酬率(%) | 委託經 營排名 | 大盤/目標 報酬率(%) |
| 統一 | 4,126,252,099 | 5,705,658,920 | 15.77 | 47.70 | 1 | 12.57/15.36 |
| 復華 | 6,481,866,342 | 8,311,364,060 | 15.16 | 28.22 | 2 | |
| 合計 | 10,608,118,441 | 14,017,022,980 | 15.41 | 34.85 | — | |

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 11 月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (107.1.22~108.11.30) | | |
|------|----------------|----------------|---------------------------|------------------------------|------------|-----------------|
| | | | | 投資 報酬率(%) | 委託經 營排名 | 大盤/指標 報酬率(%) |
| 統一 | 7,009,597,591 | 8,824,484,070 | 26.40 | 25.89 | 1 | 3.04/11.95 |
| 復華 | 10,038,542,112 | 11,048,490,911 | 25.67 | 11.16 | 3 | |
| 群益 | 6,918,664,544 | 8,170,896,293 | 22.74 | 18.10 | 2 | |
| 滙豐中華 | 5,006,530,255 | 5,413,789,060 | 21.79 | 9.59 | 4 | |
| 合計 | 28,973,334,502 | 33,457,660,334 | 24.47 | 15.33 | — | |

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 11 月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (107.8.13~108.11.30) | | |
|------|----------------|----------------|---------------------------|------------------------------|------------|-----------------|
| | | | | 投資 報酬率(%) | 委託經 營排名 | 大盤/目標 報酬率(%) |
| 統一 | 9,046,774,993 | 10,267,636,655 | 19.11 | 13.49 | 1 | 4.61/8.23 |
| 復華 | 8,967,102,893 | 9,290,960,285 | 19.96 | 3.61 | 2 | |
| 合計 | 18,013,877,886 | 19,558,596,940 | 19.51 | 8.58 | — | |

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 11 月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (107.10.8~108.11.30) | | |
|------|----------------|----------------|---------------------------|------------------------------|------------|-----------------|
| | | | | 投資 報酬率(%) | 委託經 營排名 | 大盤/目標 報酬率(%) |
| 台新 | 7,934,673,726 | 9,404,609,321 | 18.57 | 18.53 | 1 | 9.25/7.29 |
| 群益 | 8,622,603,994 | 9,789,326,981 | 14.95 | 13.53 | 2 | |
| 合計 | 16,557,277,720 | 19,193,936,302 | 16.70 | 15.92 | — | |

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 11 月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (106.12.1~108.11.30) | | |
|------|----------------|----------------|---------------------------|------------------------------|------------|-----------------|
| | | | | 投資 報酬率(%) | 委託經 營排名 | 大盤/指標 報酬率(%) |
| 國泰 | 6,000,000,000 | 6,815,924,277 | 19.36 | 16.88 | 1 | 8.80/18.34 |
| 統一 | 6,000,000,000 | 6,765,656,129 | 17.25 | 15.83 | 2 | |
| 復華 | 6,000,000,000 | 6,736,131,310 | 17.80 | 14.77 | 3 | |
| 滙豐中華 | 6,000,000,000 | 6,737,153,531 | 19.11 | 14.65 | 4 | |
| 安聯 | 6,000,000,000 | 6,731,985,153 | 19.75 | 14.34 | 5 | |
| 合計 | 30,000,000,000 | 33,786,850,400 | 18.65 | 15.30 | — | |

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 11 月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (108.4.1~108.11.30) | | |
|------|----------------|----------------|---------------------------|-----------------------------|------------|-----------------|
| | | | | 投資 報酬率(%) | 委託經 營排名 | 大盤/目標 報酬率(%) |
| 統一 | 8,286,046,084 | 9,163,580,473 | 10.59 | 10.59 | 2 | 7.97/4.29 |
| 復華 | 3,651,168,229 | 4,167,213,092 | 14.13 | 14.13 | 1 | |
| 安聯 | 2,973,766,298 | 3,241,299,171 | 9.00 | 9.00 | 3 | |
| 合計 | 14,910,980,611 | 16,572,092,736 | 11.14 | 11.14 | — | |

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 11 月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (107.2.7~108.11.30) | | |
|------|----------------|----------------|---------------------------|-----------------------------|------------|-----------------|
| | | | | 投資 報酬率(%) | 委託經 營排名 | 大盤/目標 報酬率(%) |
| 台新 | 5,000,000,000 | 5,289,036,426 | 12.09 | 0.18 | 6 | 10.43/11.04 |
| 安聯 | 5,000,000,000 | 6,148,865,639 | 21.66 | 25.84 | 1 | |
| 保德信 | 5,000,000,000 | 5,565,092,574 | 13.81 | 10.22 | 4 | |
| 國泰 | 5,000,000,000 | 5,049,305,572 | 3.14 | -1.11 | 7 | |
| 復華 | 5,000,000,000 | 5,879,763,264 | 18.94 | 17.65 | 2 | |
| 群益 | 5,000,000,000 | 5,374,162,889 | 12.59 | 7.43 | 5 | |
| 滙豐中華 | 5,000,000,000 | 5,624,435,633 | 13.12 | 13.69 | 3 | |
| 合計 | 35,000,000,000 | 38,930,661,997 | 13.68 | 10.50 | — | |

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 11 月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (107.10.24~108.11.30) | | |
|------|----------------|----------------|---------------------------|-------------------------------|------------|-----------------|
| | | | | 投資 報酬率(%) | 委託經 營排名 | 大盤/指標 報酬率(%) |
| 台新 | 2,000,000,000 | 2,555,951,158 | 26.61 | 27.80 | 1 | 17.54/22.55 |
| 安聯 | 2,000,000,000 | 2,517,655,452 | 26.11 | 25.88 | 2 | |
| 保德信 | 2,000,000,000 | 2,462,173,340 | 24.49 | 23.11 | 7 | |
| 統一 | 2,000,000,000 | 2,468,768,284 | 25.50 | 23.44 | 6 | |
| 國泰 | 2,000,000,000 | 2,480,510,807 | 25.07 | 24.03 | 5 | |
| 復華 | 2,000,000,000 | 2,489,618,770 | 25.04 | 24.48 | 3 | |
| 群益 | 2,000,000,000 | 2,482,768,280 | 24.26 | 24.14 | 4 | |
| 合計 | 14,000,000,000 | 17,457,446,091 | 25.30 | 24.70 | — | |

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 11 月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (108.5.24~108.11.30) | | |
|------|----------------|----------------|---------------------------|------------------------------|------------|-----------------|
| | | | | 投資 報酬率(%) | 委託經 營排名 | 大盤/目標 報酬率(%) |
| 安聯 | 3,000,000,000 | 3,305,169,559 | 10.17 | 10.17 | 4 | 11.46/3.27 |
| 施罗德 | 3,000,000,000 | 3,218,077,851 | 7.27 | 7.27 | 7 | |
| 統一 | 3,000,000,000 | 3,347,968,339 | 11.60 | 11.60 | 3 | |
| 野村 | 3,000,000,000 | 3,483,148,823 | 16.10 | 16.10 | 1 | |
| 國泰 | 3,000,000,000 | 3,218,286,326 | 7.28 | 7.28 | 6 | |
| 復華 | 3,000,000,000 | 3,372,713,303 | 12.42 | 12.42 | 2 | |
| 群益 | 3,000,000,000 | 3,303,549,561 | 10.12 | 10.12 | 5 | |
| 合計 | 21,000,000,000 | 23,248,913,762 | 10.71 | 10.71 | — | |

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 11 月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (108.1.28~108.11.30) | | |
|------|----------------|----------------|---------------------------|------------------------------|------------|-----------------|
| | | | | 投資 報酬率(%) | 委託經 營排名 | 大盤/目標 報酬率(%) |
| 富邦 | 5,957,934,152 | 6,581,452,776 | 10.47 | 10.47 | 2 | 15.25/5.40 |
| 統一 | 6,491,384,983 | 7,365,214,386 | 13.46 | 13.46 | 1 | |
| 合計 | 12,449,319,135 | 13,946,667,162 | 12.03 | 12.03 | — | |

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 11 月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (105.10.31~108.11.30) | | |
|------|---------------|---------------|---------------------------|-------------------------------|------------|-----------------|
| | | | | 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 | 7,703,014,837 | 24.08 | 35.51 | — | 23.45/39.41 |

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 11 月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (105.05.03~108.11.30) | | |
|------|----------------|----------------|---------------------------|-------------------------------|------------|-----------------|
| | | | | 投資 報酬率(%) | 委託經 營排名 | 大盤/目標 報酬率(%) |
| 野村 | 16,650,814,154 | 25,376,989,987 | 19.61 | 52.41 | — | 37.14/21.82 |

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 11 月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (106.6.7~108.11.30) | | |
|------|----------------|----------------|---------------------------|-----------------------------|------------|-----------------|
| | | | | 投資 報酬率(%) | 委託經 營排名 | 大盤/目標 報酬率(%) |
| 統一 | 4,126,679,953 | 5,706,555,447 | 15.78 | 47.70 | 1 | 12.57/15.36 |
| 復華 | 12,007,032,629 | 15,408,859,741 | 15.07 | 28.33 | 2 | |
| 合計 | 16,133,712,582 | 21,115,415,188 | 15.26 | 32.56 | — | |

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 11 月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (108. 4. 1~108. 11. 30) | | |
|------|-------------------|-------------------|---------------------------|---------------------------------|------------|-----------------|
| | | | | 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, 164, 547, 825 | 10. 59 | 10. 59 | 2 | 7. 97/4. 29 |
| 復華 | 3, 651, 419, 951 | 4, 167, 564, 008 | 14. 14 | 14. 14 | 1 | |
| 安聯 | 2, 974, 008, 140 | 3, 241, 614, 013 | 9. 00 | 9. 00 | 3 | |
| 合計 | 14, 912, 213, 240 | 16, 573, 725, 846 | 11. 14 | 11. 14 | — | |

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 11 月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (107. 2. 7~108. 11. 30) | | |
|------|-------------------|-------------------|---------------------------|---------------------------------|------------|-----------------|
| | | | | 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, 289, 177, 009 | 12. 10 | 0. 19 | 6 | 10. 43/11. 04 |
| 安聯 | 5, 000, 000, 000 | 6, 149, 148, 995 | 21. 67 | 25. 84 | 1 | |
| 保德信 | 5, 000, 000, 000 | 5, 565, 310, 754 | 13. 81 | 10. 23 | 4 | |
| 國泰 | 5, 000, 000, 000 | 5, 049, 452, 418 | 3. 14 | -1. 11 | 7 | |
| 復華 | 5, 000, 000, 000 | 5, 879, 988, 128 | 18. 95 | 17. 65 | 2 | |
| 群益 | 5, 000, 000, 000 | 5, 374, 497, 445 | 12. 60 | 7. 44 | 5 | |
| 匯豐中華 | 5, 000, 000, 000 | 5, 624, 769, 930 | 13. 13 | 13. 70 | 3 | |
| 合計 | 35, 000, 000, 000 | 38, 932, 344, 679 | 13. 68 | 10. 51 | — | |

(二) 108 年 11 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 11 月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (105.6.6~108.11.30) | | |
|-------------|---------------|---------------|---------------------------|-----------------------------|----|--------------|
| | | | | 投資 報酬率(%) | 排名 | 指標報酬率 (%) |
| 聯博 | 793,101,125 | 841,318,889 | 4.97 | 6.08 | 2 | 6.89 |
| 富蘭克林 坦伯頓 | 744,405,663 | 795,497,634 | 7.78 | 6.86 | 1 | |
| 合計 | 1,537,506,788 | 1,636,816,523 | 6.32 | 6.46 | — | |

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 11 月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (106.1.6~108.11.30) | | |
|-------|---------------|---------------|---------------------------|-----------------------------|----|--------------|
| | | | | 投資 報酬率(%) | 排名 | 指標報酬率 (%) |
| PIMCO | 1,219,586,290 | 1,343,943,889 | 6.51 | 12.99 | — | 12.23 |

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 11 月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (106.2.6~108.11.30) | | |
|------|---------------|---------------|---------------------------|-----------------------------|----|--------------|
| | | | | 投資 報酬率(%) | 排名 | 指標報酬率 (%) |
| 貝萊德 | 967,348,593 | 1,304,364,024 | 21.99 | 34.84 | 1 | 32.63 |
| 摩根 | 802,177,668 | 1,067,208,139 | 22.59 | 33.04 | 2 | |
| 合計 | 1,769,526,261 | 2,371,572,163 | 22.26 | 34.02 | — | |

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 11 月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (106.11.17~108.11.30) | | |
|------|-------------|-------------|---------------------------|-------------------------------|----|--------------|
| | | | | 投資 報酬率(%) | 排名 | 指標報酬率 (%) |
| 景順 | 602,621,073 | 576,995,974 | 11.98 | -0.86 | — | -0.51 |

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 11 月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (106.12.4~108.11.30) | | |
|------|---------------|---------------|---------------------------|------------------------------|----|--------------|
| | | | | 投資 報酬率(%) | 排名 | 指標報酬率 (%) |
| 貝萊德 | 535,489,288 | 608,823,308 | 22.61 | 13.69 | 2 | 13.00 |
| 道富 | 728,826,441 | 830,447,622 | 22.65 | 13.94 | 1 | |
| 合計 | 1,264,315,729 | 1,439,270,930 | 22.63 | 13.84 | — | |

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 11 月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (107.8.27~108.11.30) | | |
|------|-------------|-------------|---------------------------|------------------------------|----|--------------|
| | | | | 投資 報酬率(%) | 排名 | 指標報酬率 (%) |
| 瑞萬通博 | 757,229,489 | 785,874,930 | 9.72 | 3.78 | — | 1.26 |

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 11 月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (105.7.1~108.11.30) | | |
|------|---------------|---------------|---------------------------|-----------------------------|----|--------------|
| | | | | 投資 報酬率(%) | 排名 | 指標報酬率 (%) |
| 道富 | 662,180,574 | 901,216,931 | 17.85 | 41.42 | 1 | 40.43 |
| 貝萊德 | 666,301,910 | 905,508,419 | 17.76 | 41.19 | 2 | |
| 合計 | 1,328,482,484 | 1,806,725,350 | 17.80 | 41.30 | — | |

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11月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (106.3.6~108.11.30) | | |
|----------------|---------------|---------------|------------------------|-----------------------------|----|--------------|
| | | | | 投資 報酬率(%) | 排名 | 指標報酬率 (%) |
| Cohen & Steers | 1,251,936,411 | 1,607,303,864 | 24.37 | 34.04 | 1 | 25.10 |
| 景順 | 1,084,104,927 | 1,350,187,130 | 21.19 | 26.60 | 2 | |
| 合計 | 2,336,041,338 | 2,957,490,994 | 22.88 | 30.42 | — | |

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11月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (106.7.31~108.11.30) | | |
|---------|-------------|-------------|------------------------|------------------------------|----|--------------|
| | | | | 投資 報酬率(%) | 排名 | 指標報酬率 (%) |
| Ashmore | 454,453,121 | 488,241,670 | 8.69 | 7.43 | 2 | 11.66 |
| Pictet | 454,291,634 | 504,985,680 | 12.08 | 11.16 | 1 | |
| 合計 | 908,744,755 | 993,227,350 | 10.39 | 9.30 | — | |

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11月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (107.4.18~108.11.30) | | |
|------|---------------|---------------|------------------------|------------------------------|----|--------------|
| | | | | 投資 報酬率(%) | 排名 | 指標報酬率 (%) |
| 道富 | 798,231,848 | 862,777,630 | 13.47 | 8.23 | 2 | 7.85 |
| 貝萊德 | 794,293,722 | 858,713,389 | 13.36 | 8.25 | 1 | |
| 合計 | 1,592,525,570 | 1,721,491,019 | 13.42 | 8.24 | — | |

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11月 累積投資報酬率(%) | 委任迄今 (108.1.22~108.11.30) | | |
|------|---------------|---------------|-------------------------|------------------------------|----|--------------|
| | | | | 投資 報酬率(%) | 排名 | 指標報酬率 (%) |
| 瑞萬通博 | 756,315,337 | 910,719,401 | 20.42 | 20.42 | 1 | 14.33 |
| MFS | 603,318,800 | 667,506,853 | 10.64 | 10.64 | 3 | |
| 威靈頓 | 631,647,315 | 738,681,426 | 16.95 | 16.95 | 2 | |
| 合計 | 1,991,281,452 | 2,316,907,680 | 16.35 | 16.35 | — | |

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11月 累積投資報酬率(%) | 委任迄今 (108.4.25~108.11.30) | | |
|---------|---------------|---------------|-------------------------|------------------------------|----|--------------|
| | | | | 投資 報酬率(%) | 排名 | 指標報酬率 (%) |
| Bluebay | 586,338,464 | 613,139,564 | 5.95 | 5.95 | 2 | 5.60 |
| 貝萊德 | 587,231,657 | 614,283,938 | 6.03 | 6.03 | 1 | |
| 盧米斯 | 592,703,100 | 619,073,643 | 5.81 | 5.81 | 3 | |
| 合計 | 1,766,273,221 | 1,846,497,145 | 5.93 | 5.93 | — | |

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11月 累積投資報酬率(%) | 委任迄今 (104.8.11~108.11.30) | | |
|-------|---------------|---------------|-------------------------|------------------------------|----|--------------|
| | | | | 投資 報酬率(%) | 排名 | 指標報酬率 (%) |
| 北美信託 | 650,000,000 | 1,052,532,232 | 29.94 | 60.33 | 1 | 59.57 |
| LGIM | 650,000,000 | 1,052,476,566 | 29.87 | 60.06 | 2 | |
| Geode | 650,000,000 | 1,051,425,870 | 30.08 | 59.97 | 3 | |
| 合計 | 1,950,000,000 | 3,156,434,668 | 29.96 | 60.12 | — | |

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11月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (104.9.25~108.11.30) | | |
|----------------|---------------|---------------|------------------------|------------------------------|----|--------------|
| | | | | 投資 報酬率(%) | 排名 | 指標報酬率 (%) |
| Cohen & Steers | 300,000,000 | 422,765,486 | 21.43 | 34.88 | 4 | 42.21 |
| 麥格理 | 500,000,000 | 645,156,759 | 20.52 | 37.89 | 3 | |
| Magellan | 900,000,000 | 1,152,551,183 | 22.66 | 57.20 | 1 | |
| RREEF | 500,000,000 | 656,992,337 | 24.00 | 44.82 | 2 | |
| 合計 | 2,200,000,000 | 2,877,465,765 | 22.22 | 44.16 | — | |

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11月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (104.11.13~108.11.30) | | |
|------------|---------------|---------------|------------------------|-------------------------------|----|--------------|
| | | | | 投資 報酬率(%) | 排名 | 指標報酬率 (%) |
| NNIP | 200,000,000 | 210,416,125 | 5.47 | 10.66 | 3 | 20.09 |
| Brandywine | 500,000,000 | 540,395,145 | 5.77 | 18.13 | 1 | |
| 盧米斯 | 300,000,000 | 343,683,349 | 6.76 | 17.73 | 2 | |
| 合計 | 1,000,000,000 | 1,094,494,619 | 6.02 | 15.34 | — | |

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11月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (105.7.20~108.11.30) | | |
|------|---------------|---------------|------------------------|------------------------------|----|-----------------|
| | | | | 投資 報酬率(%) | 排名 | 指標/目標 報酬率(%) |
| 安聯 | 370,000,000 | 391,508,662 | 5.92 | 5.58 | 4 | 6.26/23.10 |
| 摩根 | 1,100,000,000 | 1,283,088,483 | 13.48 | 28.64 | 1 | |
| DWS | 600,000,000 | 686,717,016 | 13.04 | 18.01 | 2 | |
| 柏瑞 | 600,000,000 | 674,106,073 | 10.21 | 14.44 | 3 | |
| 合計 | 2,670,000,000 | 3,035,420,234 | 11.26 | 17.61 | — | |

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11月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (105.8.24~108.11.30) | | |
|------|---------------|---------------|------------------------|------------------------------|----|--------------|
| | | | | 投資 報酬率(%) | 排名 | 指標報酬率 (%) |
| 貝萊德 | 500,000,000 | 604,959,206 | 9.96 | 23.04 | 1 | 25.10 |
| 北美信託 | 300,000,000 | 358,086,571 | 7.25 | 12.47 | 3 | |
| 領航 | 450,000,000 | 520,653,712 | 6.82 | 18.24 | 2 | |
| 合計 | 1,250,000,000 | 1,483,699,489 | 8.10 | 17.95 | — | |

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11月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (106.6.22~108.11.30) | | |
|------|---------------|---------------|------------------------|------------------------------|----|--------------|
| | | | | 投資 報酬率(%) | 排名 | 指標報酬率 (%) |
| 貝萊德 | 300,000,000 | 353,707,001 | 21.49 | 25.99 | 3 | 25.68 |
| DWS | 350,000,000 | 408,637,391 | 21.76 | 26.03 | 2 | |
| 道富 | 350,000,000 | 408,249,501 | 21.49 | 25.93 | 4 | |
| 北美信託 | 350,000,000 | 409,033,400 | 21.60 | 26.14 | 1 | |
| 合計 | 1,350,000,000 | 1,579,627,293 | 21.59 | 26.02 | — | |

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11月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (106.7.25~108.11.30) | | |
|------------------|---------------|---------------|------------------------|------------------------------|----|-----------------|
| | | | | 投資 報酬率(%) | 排名 | 指標/目標 報酬率(%) |
| American Century | 400,000,000 | 418,340,380 | 4.71 | 4.73 | 4 | 4.36/10.25 |
| 富達 | 400,000,000 | 446,725,826 | 14.88 | 10.83 | 1 | |
| 富蘭克林 坦伯頓 | 400,000,000 | 418,568,598 | 3.91 | 5.22 | 3 | |
| TCW | 400,000,000 | 434,276,783 | 6.46 | 9.17 | 2 | |
| 合計 | 1,600,000,000 | 1,717,911,587 | 7.43 | 7.50 | — | |

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11月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (108.1.23~108.11.30) | | |
|------|---------------|---------------|------------------------|------------------------------|----|-----------------|
| | | | | 投資 報酬率(%) | 排名 | 指標/目標 報酬率(%) |
| 野村 | 400,000,000 | 394,287,043 | -2.77 | -2.77 | 5 | 1.99/6.27 |
| 景順 | 400,000,000 | 415,445,749 | 7.46 | 7.46 | 3 | |
| 威靈頓 | 400,000,000 | 429,910,676 | 13.42 | 13.42 | 1 | |
| CPR | 400,000,000 | 413,346,194 | 5.78 | 5.78 | 4 | |
| 道富 | 400,000,000 | 428,378,503 | 12.84 | 12.84 | 2 | |
| 合計 | 2,000,000,000 | 2,081,368,165 | 7.33 | 7.33 | — | |

註：本批次為絕對報酬型。

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11月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (108.6.24~108.11.30) | | |
|------|-------------|-------------|------------------------|------------------------------|----|--------------|
| | | | | 投資 報酬率(%) | 排名 | 指標 報酬率(%) |
| 富達 | 886,579,222 | 920,369,335 | 3.81 | 3.81 | — | 4.25 |

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11月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (106.1.6~108.11.30) | | |
|-------|---------------|---------------|------------------------|-----------------------------|----|--------------|
| | | | | 投資 報酬率(%) | 排名 | 指標 報酬率(%) |
| PIMCO | 1,023,576,760 | 1,146,136,463 | 6.53 | 13.16 | 1 | 12.23 |
| 盧米斯 | 798,763,197 | 883,831,711 | 6.22 | 12.05 | 2 | |
| 合計 | 1,822,339,957 | 2,029,968,174 | 6.39 | 12.68 | — | |

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 11 月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (106.2.6~108.11.30) | | |
|------|-------------|---------------|---------------------------|-----------------------------|----|--------------|
| | | | | 投資 報酬率(%) | 排名 | 指標 報酬率(%) |
| 貝萊德 | 756,337,413 | 1,020,228,849 | 22.03 | 34.89 | — | 32.63 |

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 11 月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (106.11.17~108.11.30) | | |
|------|-------------|-------------|---------------------------|-------------------------------|----|--------------|
| | | | | 投資 報酬率(%) | 排名 | 指標 報酬率(%) |
| 景順 | 307,323,526 | 293,087,074 | 12.06 | -0.78 | — | -0.51 |

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 11 月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (106.3.6~108.11.30) | | |
|------|---------------|---------------|---------------------------|-----------------------------|----|--------------|
| | | | | 投資 報酬率(%) | 排名 | 指標 報酬率(%) |
| 貝萊德 | 305,588,950 | 384,759,440 | 17.99 | 20.66 | 4 | 19.80 |
| 道富 | 308,539,390 | 389,237,148 | 18.26 | 20.91 | 3 | |
| 瑞銀 | 306,994,134 | 387,765,885 | 17.89 | 20.99 | 2 | |
| 野村 | 307,549,840 | 389,103,757 | 18.11 | 21.16 | 1 | |
| 合計 | 1,228,672,314 | 1,550,866,230 | 18.06 | 20.93 | — | |

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 11 月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (107.6.13~108.11.30) | | |
|------|-------------|-------------|---------------------------|------------------------------|----|--------------|
| | | | | 投資 報酬率(%) | 排名 | 指標 報酬率(%) |
| 貝萊德 | 671,455,711 | 725,930,470 | 13.57 | 8.11 | — | 7.89 |

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11月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (108.1.22~108.11.30) | | |
|------|---------------|---------------|------------------------|------------------------------|----|--------------|
| | | | | 投資 報酬率(%) | 排名 | 指標 報酬率(%) |
| 瑞萬通博 | 287,169,673 | 345,786,317 | 20.41 | 20.41 | 1 | 14.33 |
| MFS | 246,618,331 | 272,960,604 | 10.68 | 10.68 | 3 | |
| 威靈頓 | 503,548,464 | 589,087,425 | 16.99 | 16.99 | 2 | |
| 合計 | 1,037,336,468 | 1,207,834,346 | 16.44 | 16.44 | — | |

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11月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (108.5.29~108.11.30) | | |
|--------|-------------|-------------|------------------------|------------------------------|----|--------------|
| | | | | 投資 報酬率(%) | 排名 | 指標 報酬率(%) |
| Lazard | 713,987,040 | 751,579,638 | 6.07 | 6.07 | — | 4.95 |

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11月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (108.8.27~108.11.30) | | |
|----------|-------------|-------------|------------------------|------------------------------|----|--------------|
| | | | | 投資 報酬率(%) | 排名 | 指標 報酬率(%) |
| 信安 環球 | 510,886,182 | 534,612,514 | 5.09 | 5.09 | 1 | 4.62 |
| AMP | 126,937,100 | 133,108,790 | 4.86 | 4.86 | 2 | |
| 合計 | 637,823,282 | 667,721,304 | 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11月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (105.7.20~108.11.30) | | |
|------|---------------|---------------|------------------------|------------------------------|----|-----------------|
| | | | | 投資 報酬率(%) | 排名 | 指標/目標 報酬率(%) |
| 安聯 | 120,000,000 | 127,152,922 | 5.96 | 5.63 | 4 | 6.26/23.10 |
| 摩根 | 450,000,000 | 511,944,574 | 13.55 | 29.09 | 1 | |
| DWS | 250,000,000 | 277,554,759 | 12.86 | 17.89 | 2 | |
| 柏瑞 | 200,000,000 | 224,327,098 | 10.17 | 14.63 | 3 | |
| 合計 | 1,020,000,000 | 1,140,979,353 | 11.20 | 17.46 | — | |

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11月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (106.6.22~108.11.30) | | |
|------|-------------|-------------|------------------------|------------------------------|----|--------------|
| | | | | 投資 報酬率(%) | 排名 | 指標 報酬率(%) |
| 貝萊德 | 150,000,000 | 178,383,904 | 21.41 | 25.69 | 4 | 25.68 |
| DWS | 150,000,000 | 178,870,181 | 21.77 | 26.15 | 1 | |
| 道富 | 150,000,000 | 178,881,743 | 21.45 | 26.09 | 2 | |
| 北美信託 | 150,000,000 | 178,753,218 | 21.63 | 25.94 | 3 | |
| 合計 | 600,000,000 | 714,889,046 | 21.57 | 25.97 | — | |

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11月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (106.7.25~108.11.30) | | |
|------------------|---------------|---------------|------------------------|------------------------------|----|-----------------|
| | | | | 投資 報酬率(%) | 排名 | 指標/目標 報酬率(%) |
| American Century | 300,000,000 | 313,025,738 | 4.78 | 4.84 | 4 | 4.36/10.25 |
| 富達 | 300,000,000 | 331,736,776 | 14.32 | 10.30 | 1 | |
| 富蘭克林 坦伯頓 | 300,000,000 | 311,400,829 | 3.69 | 5.36 | 3 | |
| TCW | 300,000,000 | 322,323,622 | 6.49 | 9.19 | 2 | |
| 合計 | 1,200,000,000 | 1,278,486,965 | 7.26 | 7.45 | — | |

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11月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (108.1.23~108.11.30) | | |
|------|-------------|-------------|------------------------|------------------------------|----|-----------------|
| | | | | 投資 報酬率(%) | 排名 | 指標/目標 報酬率(%) |
| 野村 | 80,000,000 | 78,786,081 | -2.85 | -2.85 | 5 | 1.99/6.27 |
| 景順 | 80,000,000 | 83,221,743 | 7.36 | 7.36 | 3 | |
| 威靈頓 | 80,000,000 | 85,566,642 | 13.39 | 13.39 | 1 | |
| CPR | 80,000,000 | 82,654,015 | 5.70 | 5.70 | 4 | |
| 道富 | 80,000,000 | 85,302,735 | 12.63 | 12.63 | 2 | |
| 合計 | 400,000,000 | 415,531,216 | 7.24 | 7.24 | — | |

註：本批次為絕對報酬型。

(二)108年11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11月30日

1. 避險：

| 種類 | 避險比例 |
|--------|-------|
| 權益證券避險 | 0% |
| 匯率避險 | 5.67% |

2. 投資：無

(二)舊制勞工退休基金自營部位

(依交易目的)

108年11月30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11月 | 15,793,194,795 | 24,366,558,294 | 8,573,363,499 |

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11月 | 6,268,266,681 | 6,291,898,084 | 23,631,403 |

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11月份 | | 單位：新台幣元 |
|----------|-----------------|---------------|
| 項 目 | 金 額 | |
| 基金收入 | 151,227,429,184 | |
| 基金支出 | 142,303,871,115 | |
| 現金增(減)數 | | 8,923,558,069 |

註：本表採現金基礎。

(二)舊制勞工退休基金

| 108年11月份 | | 單位：新台幣元 |
|----------|----------------|---------|
| 項 目 | 金 額 | |
| 基金收入 | 25,048,573,585 | |
| 基金支出 | 25,048,017,383 | |
| 現金增(減)數 | | 556,202 |

註：本表採現金基礎。