

## 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 5 月底績效

| 基金與指標   | 新制基金  | 舊制基金   | 台灣 10 年期<br>公債殖利率 | 台灣加權<br>股價指數 | MSCI 全球<br>股票指數 | Barclays<br>全球債券指數 |
|---------|-------|--------|-------------------|--------------|-----------------|--------------------|
| 收益率/報酬率 | 9.97% | 11.56% | 1.40%             | 18.09%       | 8.88%           | -3.30%             |

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<br>公債殖利率 | 台灣加權<br>股價指數 | MSCI 全球<br>股票指數 | Barclays<br>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<br>公債殖利率 | 台灣加權<br>股價指數 | MSCI 全球<br>股票指數 | Barclays<br>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<br>公債殖利率 | 台灣加權<br>股價指數 | MSCI 全球<br>股票指數 | Barclays<br>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 5 月底止基金規模與收益         |      |                 |                            |
|----------------------------|------|-----------------|----------------------------|
| 基金運用規模                     |      |                 | 4 兆 3,265 億 6,043 萬元       |
| 113 年截至 5 月底止<br>運用收益數及收益率 | 自行運用 | 國內固定收益          | 49 億 5,154 萬元<br>1.49%     |
|                            |      | 國內權益證券<br>及國外投資 | 1,176 億 4,477 萬元<br>13.47% |
|                            | 委託經營 |                 | 2,893 億 3,066 萬元<br>11.77% |
|                            | 合 計  |                 | 4,119 億 2,697 萬元<br>9.97%  |

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：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 5 月之保證收益率為 1.7108%。

#### 2. 舊制勞工退休基金

| 113 年 5 月底止基金規模與收益         |      |                 |                            |
|----------------------------|------|-----------------|----------------------------|
| 基金運用規模                     |      |                 | 10,479 億 7,045 萬元          |
| 113 年截至 5 月底止<br>運用收益數及收益率 | 自行運用 | 國內固定收益          | 17 億 8,713 萬元<br>1.50%     |
|                            |      | 國內權益證券<br>及國外投資 | 460 億 44 萬元<br>20.95%      |
|                            | 委託經營 |                 | 525 億 3,913 萬元<br>10.18%   |
|                            | 合 計  |                 | 1,003 億 2,670 萬元<br>11.56% |

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 5 月 31 日

單位：新臺幣元

| 項 目             | 餘 額                      | 占基金運用比率(%)    |
|-----------------|--------------------------|---------------|
| <b>自行運用</b>     | <b>1,755,331,018,922</b> | <b>40.57</b>  |
| 轉存金融機構          | 512,771,970,036          | 11.85         |
| 短期票券            | 93,642,125,731           | 2.17          |
| 公債、公司債、金融債券及特別股 | 235,871,380,436          | 5.45          |
| 股票及受益憑證投資(含期貨)  | 228,209,292,113          | 5.27          |
| 國外投資            | 684,836,250,606          | 15.83         |
| 固定收益            | 567,539,249,416          | 13.12         |
| 權益證券            | 58,307,570,882           | 1.35          |
| 另類投資            | 58,989,430,308           | 1.36          |
| <b>委託經營</b>     | <b>2,571,229,407,817</b> | <b>59.43</b>  |
| 國內委託經營          | 564,252,192,232          | 13.04         |
| 國外委託經營          | 2,006,977,215,585        | 46.39         |
| 固定收益            | 527,834,585,347          | 12.20         |
| 權益證券            | 1,031,833,272,426        | 23.85         |
| 另類投資            | 447,309,357,812          | 10.34         |
| <b>合 計</b>      | <b>4,326,560,426,739</b> | <b>100.00</b> |

## 2. 舊制勞工退休基金

113 年 5 月 31 日

單位：新臺幣元

| 項 目               | 餘 額                      | 占基金運用比率(%)    |
|-------------------|--------------------------|---------------|
| <b>自行運用</b>       | <b>513,713,838,776</b>   | <b>49.02</b>  |
| 轉存金融機構            | 154,146,202,437          | 14.71         |
| 短期票券              | 62,651,357,900           | 5.98          |
| 公債、金融債券、公司債及證券化商品 | 74,254,712,041           | 7.08          |
| 股票及受益憑證投資(含期貨)    | 116,010,874,472          | 11.07         |
| 國外投資              | 106,650,691,926          | 10.18         |
| 固定收益              | 60,796,312,617           | 5.80          |
| 權益證券              | 36,602,675,735           | 3.49          |
| 另類投資              | 9,251,703,574            | 0.89          |
| <b>委託經營</b>       | <b>534,256,614,963</b>   | <b>50.98</b>  |
| 國內委託經營            | 112,618,653,434          | 10.75         |
| 國外委託經營            | 421,637,961,529          | 40.23         |
| 固定收益              | 105,239,219,788          | 10.04         |
| 權益證券              | 212,928,150,974          | 20.32         |
| 另類投資              | 103,470,590,767          | 9.87          |
| <b>合 計</b>        | <b>1,047,970,453,739</b> | <b>100.00</b> |

### (三) 基金自營投資與委外投資比率

#### 1. 新制勞工退休基金

113 年 5 月 31 日

單位：新臺幣元

| 項 目     | 金 額               | 占基金運用比率(%) |
|---------|-------------------|------------|
| 自 行 運 用 | 1,755,331,018,922 | 40.57      |
| 委 託 經 營 | 2,571,229,407,817 | 59.43      |

#### 2. 舊制勞工退休基金

113 年 5 月 31 日

單位：新臺幣元

| 項 目     | 金 額             | 占基金運用比率(%) |
|---------|-----------------|------------|
| 自 行 運 用 | 513,713,838,776 | 49.02      |
| 委 託 經 營 | 534,256,614,963 | 50.98      |

#### (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 5 月 31 日

單位：新臺幣元

| 項 目     | 金 額               | 占基金運用比率(%) |
|---------|-------------------|------------|
| 國 內 投 資 | 1,634,746,960,548 | 37.78      |
| 國 外 投 資 | 2,691,813,466,191 | 62.22      |

##### 2. 舊制勞工退休基金

113 年 5 月 31 日

單位：新臺幣元

| 項 目     | 金 額             | 占基金運用比率(%) |
|---------|-----------------|------------|
| 國 內 投 資 | 519,681,800,284 | 49.59      |
| 國 外 投 資 | 528,288,653,455 | 50.41      |

#### 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 5 月底

| 項 目    | 收益率(%) |
|--------|--------|
| 國內權益證券 | 30.50  |

##### 2. 舊制勞工退休基金

113 年截至 5 月底

| 項 目    | 收益率(%) |
|--------|--------|
| 國內權益證券 | 28.72  |

## (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 5 月 31 日

單位：新臺幣元

| 項 目    | 金 額             | 比 率 (%) |
|--------|-----------------|---------|
| 國內權益證券 | 228,209,292,113 | 5.27    |

### 2. 舊制勞工退休基金

113 年 5 月 31 日

單位：新臺幣元

| 項 目    | 金 額             | 比 率 (%) |
|--------|-----------------|---------|
| 國內權益證券 | 116,010,874,472 | 11.07   |

## 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 5)

單位：新臺幣元

| 投信<br>名稱 | 委託金額           | 目前淨資產          | 113 年截至 5 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(111.9.27~113.5.31) |    |              |
|----------|----------------|----------------|--------------------------|-----------------------------|----|--------------|
|          |                |                |                          | 投資報酬率<br>(%)                | 排名 | 目標報酬率<br>(%) |
| 野村       | 28,072,603,831 | 39,738,623,225 | 14.62                    | 41.56                       | —  | 10.52        |

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<br>名稱 | 委託金額          | 目前淨資產         | 113 年截至 5 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(112.1.30~113.5.31) |    |              |
|----------|---------------|---------------|--------------------------|-----------------------------|----|--------------|
|          |               |               |                          | 投資報酬率<br>(%)                | 排名 | 目標報酬率<br>(%) |
| 野村       | 6,829,066,771 | 9,413,643,376 | 15.81                    | 37.85                       | —  | 8.41         |

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。

### 98 年第一次委託經營(續約 4)

單位：新臺幣元

| 投信<br>名稱 | 委託金額           | 目前淨資產          | 113 年截至 5 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(110.7.16~113.5.31) |    |              |
|----------|----------------|----------------|--------------------------|-----------------------------|----|--------------|
|          |                |                |                          | 投資報酬率<br>(%)                | 排名 | 目標報酬率<br>(%) |
| 野村       | 19,093,323,980 | 22,813,305,907 | 13.60                    | 19.48                       | 1  | 16.23        |
| 保德信      | 6,277,574,114  | 7,380,759,283  | 7.42                     | 17.57                       | 2  |              |
| 合計       | 25,370,898,094 | 30,194,065,190 | 12.02                    | 19.01                       | —  |              |

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<br>名稱 | 委託金額           | 目前淨資產          | 113 年截至 5 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(111.12.5~113.5.31) |    |              |
|----------|----------------|----------------|--------------------------|-----------------------------|----|--------------|
|          |                |                |                          | 投資報酬率<br>(%)                | 排名 | 目標報酬率<br>(%) |
| 國泰       | 10,445,113,310 | 12,293,367,951 | 6.99                     | 17.69                       | —  | 9.36         |

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<br>名稱 | 委託金額           | 目前淨資產          | 113 年截至 5 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(112.7.15~113.5.31) |    |              |
|----------|----------------|----------------|--------------------------|-----------------------------|----|--------------|
|          |                |                |                          | 投資報酬率<br>(%)                | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| 復華       | 29,101,525,086 | 34,382,222,193 | 12.82                    | 18.15                       | —  | 18.61        |

註：本批次為相對報酬型，以臺灣就業 99 指數為指定指標。

### 101 年第二次委託經營(續約 2)

單位：新臺幣元

| 投信<br>名稱 | 委託金額           | 目前淨資產          | 113 年截至 5 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(109.7.20~113.5.31) |    |              |
|----------|----------------|----------------|--------------------------|-----------------------------|----|--------------|
|          |                |                |                          | 投資報酬率<br>(%)                | 排名 | 目標報酬率<br>(%) |
| 野村       | 9,057,257,704  | 14,344,044,690 | 15.30                    | 58.37                       | 2  | 22.20        |
| 統一       | 12,294,643,442 | 19,827,213,985 | 13.19                    | 61.27                       | 1  |              |
| 合計       | 21,351,901,146 | 34,171,258,675 | 14.07                    | 60.04                       | —  |              |

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<br>名稱 | 委託金額           | 目前淨資產          | 113 年截至 5 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(111.1.24~113.5.31) |    |              |
|----------|----------------|----------------|--------------------------|-----------------------------|----|--------------|
|          |                |                |                          | 投資報酬率<br>(%)                | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| 統一       | 14,437,134,744 | 19,139,648,593 | 19.18                    | 32.57                       | 1  | 28.98        |
| 復華       | 18,009,802,076 | 22,324,212,894 | 19.22                    | 22.77                       | 2  |              |
| 合計       | 32,446,936,820 | 41,463,861,487 | 19.19                    | 26.99                       | —  |              |

註：本批次為相對報酬型，以臺灣加權股價報酬指數為指定指標。

### 103 年第一次委託經營(續約 2) 單位：新臺幣元

| 投信<br>名稱 | 委託金額           | 目前淨資產          | 113 年截至 5 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(111.10.11~113.5.31) |    |              |
|----------|----------------|----------------|--------------------------|------------------------------|----|--------------|
|          |                |                |                          | 投資報酬率<br>(%)                 | 排名 | 目標報酬率<br>(%) |
| 台新       | 15,841,461,125 | 21,730,705,386 | 11.07                    | 37.18                        | —  | 10.29        |

註：本批次為絕對報酬型，契約目標報酬率係以臺灣證交所公告之最近 5 年年底股票集中市場平均殖利率加計 250 個基本點為基準。

### 103 年第二次委託經營(續約) (相對報酬)

單位：新臺幣元

| 投信<br>名稱 | 委託金額           | 目前淨資產          | 113 年截至 5 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(110.12.1~113.5.31) |    |              |
|----------|----------------|----------------|--------------------------|-----------------------------|----|--------------|
|          |                |                |                          | 投資報酬率<br>(%)                | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| 國泰       | 14,836,482,661 | 20,466,054,063 | 15.63                    | 39.57                       | 5  | 44.07        |
| 統一       | 11,353,734,691 | 16,104,829,615 | 15.46                    | 41.85                       | 1  |              |
| 復華       | 10,890,868,617 | 15,380,337,733 | 15.81                    | 41.22                       | 2  |              |
| 滙豐       | 10,790,827,015 | 15,134,695,779 | 15.62                    | 40.26                       | 3  |              |
| 安聯       | 15,017,345,063 | 20,829,572,962 | 15.35                    | 40.17                       | 4  |              |
| 合計       | 62,889,258,047 | 87,915,490,152 | 15.56                    | 40.54                       | —  |              |

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<br>名稱 | 委託金額          | 目前淨資產          | 113 年截至 5 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(112.4.6~113.5.31) |    |              |
|----------|---------------|----------------|--------------------------|----------------------------|----|--------------|
|          |               |                |                          | 投資報酬率<br>(%)               | 排名 | 目標報酬率<br>(%) |
| 復華       | 4,799,121,512 | 5,904,365,514  | 10.87                    | 23.03                      | 1  | 7.26         |
| 安聯       | 3,601,238,896 | 4,237,910,325  | 9.20                     | 17.68                      | 2  |              |
| 合計       | 8,400,360,408 | 10,142,275,839 | 10.17                    | 20.74                      | —  |              |

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<br>名稱 | 委託金額           | 目前淨資產          | 113 年截至 5 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(112.2.7~113.5.31) |    |              |
|----------|----------------|----------------|--------------------------|----------------------------|----|--------------|
|          |                |                |                          | 投資報酬率<br>(%)               | 排名 | 目標報酬率<br>(%) |
| 安聯       | 14,088,712,403 | 18,815,229,447 | 14.30                    | 33.55                      | 1  | 8.27         |
| 國泰       | 6,318,453,600  | 7,605,171,011  | 7.38                     | 20.36                      | 3  |              |
| 群益       | 6,382,621,945  | 7,970,342,568  | 7.51                     | 24.88                      | 2  |              |
| 滙豐       | 7,096,535,878  | 8,510,276,580  | 7.68                     | 19.92                      | 4  |              |
| 合計       | 33,886,323,826 | 42,901,019,606 | 10.40                    | 26.60                      | —  |              |

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<br>名稱 | 委託金額           | 目前淨資產          | 113 年截至 5 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(112.10.24~113.5.31) |    |              |
|----------|----------------|----------------|--------------------------|------------------------------|----|--------------|
|          |                |                |                          | 投資報酬率<br>(%)                 | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| 台新       | 8,254,694,051  | 11,000,395,586 | 20.22                    | 33.26                        | 2  | 33.31        |
| 安聯       | 12,775,472,416 | 16,922,919,342 | 20.11                    | 32.46                        | 5  |              |
| 保德信      | 9,403,481,285  | 12,540,657,673 | 20.87                    | 33.36                        | 1  |              |
| 統一       | 12,635,490,783 | 16,710,438,076 | 19.79                    | 32.25                        | 6  |              |
| 國泰       | 10,445,956,159 | 13,668,214,401 | 19.02                    | 30.85                        | 7  |              |
| 復華       | 7,235,716,436  | 9,622,342,251  | 20.45                    | 32.98                        | 3  |              |
| 群益       | 4,439,275,178  | 5,885,334,884  | 20.16                    | 32.57                        | 4  |              |
| 合計       | 65,190,086,308 | 86,350,302,213 | 20.04                    | 32.46                        | —  |              |

註：本批次為相對報酬型，以臺灣永續報酬指數為指定指標。

## 107 年第二次委託經營（續約）

單位：新臺幣元

| 投信<br>名稱 | 委託金額           | 目前淨資產          | 113 年截至 5 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(113.5.24~113.5.31) |    |              |
|----------|----------------|----------------|--------------------------|-----------------------------|----|--------------|
|          |                |                |                          | 投資報酬率<br>(%)                | 排名 | 目標報酬率<br>(%) |
| 安聯       | 11,613,817,760 | 11,592,848,611 | -0.18                    | -0.18                       | 3  | 0.13         |
| 施罗德      | 11,400,361,947 | 11,407,671,558 | 0.06                     | 0.06                        | 1  |              |
| 統一       | 11,638,402,860 | 11,629,498,262 | -0.08                    | -0.08                       | 2  |              |
| 野村       | 18,601,693,072 | 18,469,895,854 | -0.71                    | -0.71                       | 5  |              |
| 國泰       | 19,457,627,824 | 19,090,098,672 | -1.89                    | -1.89                       | 6  |              |
| 復華       | 9,724,896,734  | 9,658,876,017  | -0.68                    | -0.68                       | 4  |              |
| 合計       | 82,436,800,197 | 81,848,888,974 | -0.71                    | -0.71                       | —  |              |

註：本批次為絕對報酬型，契約目標報酬率係以臺灣證交所公告之最近 5 年年底股票集中市場平均殖利率加計 250 個基本點為基準。

## 109 年第一次委託經營

單位：新臺幣元

| 投信<br>名稱 | 委託金額           | 目前淨資產          | 113 年截至 5 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(110.5.13~113.5.31) |    |              |
|----------|----------------|----------------|--------------------------|-----------------------------|----|--------------|
|          |                |                |                          | 投資報酬率<br>(%)                | 排名 | 目標報酬率<br>(%) |
| 台新       | 8,000,000,000  | 10,373,696,745 | 11.44                    | 29.67                       | 2  | 17.66        |
| 安聯       | 8,000,000,000  | 10,220,314,652 | 13.99                    | 27.75                       | 4  |              |
| 保德信      | 8,000,000,000  | 9,614,013,443  | 11.31                    | 20.18                       | 5  |              |
| 國泰       | 8,000,000,000  | 11,063,061,565 | 16.82                    | 38.29                       | 1  |              |
| 野村       | 8,000,000,000  | 10,276,625,488 | 14.99                    | 28.46                       | 3  |              |
| 合計       | 40,000,000,000 | 51,547,711,893 | 13.74                    | 28.87                       | —  |              |

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 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<br>名稱 | 委託金額           | 目前淨資產          | 113 年截至 5 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(111.5.13~113.5.31) |    |              |
|----------|----------------|----------------|--------------------------|-----------------------------|----|--------------|
|          |                |                |                          | 投資報酬率<br>(%)                | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| 安聯       | 3,000,000,000  | 5,098,642,715  | 9.27                     | 63.94                       | 3  | 75.42        |
| 保德信      | 3,000,000,000  | 5,153,923,609  | 8.88                     | 67.03                       | 1  |              |
| 野村       | 3,000,000,000  | 5,261,395,861  | 10.30                    | 66.77                       | 2  |              |
| 國泰       | 3,000,000,000  | 5,050,180,603  | 8.06                     | 61.64                       | 4  |              |
| 富邦       | 3,000,000,000  | 5,044,446,987  | 9.41                     | 60.34                       | 5  |              |
| 合計       | 15,000,000,000 | 25,608,589,775 | 9.19                     | 63.95                       | —  |              |

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<br>名稱 | 委託金額           | 目前淨資產          | 113 年截至 5 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(110.12.15~113.5.31) |    |              |
|----------|----------------|----------------|--------------------------|------------------------------|----|--------------|
|          |                |                |                          | 投資報酬率<br>(%)                 | 排名 | 目標報酬率<br>(%) |
| 安聯       | 6,000,000,000  | 7,447,123,974  | 14.21                    | 21.07                        | 4  | 15.36        |
| 保德信      | 6,000,000,000  | 7,612,739,382  | 7.46                     | 23.19                        | 2  |              |
| 國泰       | 6,000,000,000  | 7,561,237,198  | 13.49                    | 23.91                        | 1  |              |
| 第一金      | 6,000,000,000  | 6,864,444,189  | 4.02                     | 10.55                        | 6  |              |
| 野村       | 6,000,000,000  | 7,331,604,516  | 15.01                    | 17.49                        | 5  |              |
| 富邦       | 6,000,000,000  | 7,645,868,885  | 16.51                    | 22.64                        | 3  |              |
| 合計       | 36,000,000,000 | 44,463,018,144 | 11.70                    | 19.81                        | —  |              |

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<br>名稱 | 委託金額           | 目前淨資產          | 113 年截至 5 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(112.10.5~113.5.31) |    |              |
|----------|----------------|----------------|--------------------------|-----------------------------|----|--------------|
|          |                |                |                          | 投資<br>報酬率<br>(%)            | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| 安聯       | 2,000,000,000  | 2,222,264,270  | 8.65                     | 11.11                       | 6  | 4.08         |
| 施罗德      | 2,000,000,000  | 2,375,415,855  | 17.09                    | 18.77                       | 2  |              |
| 國泰       | 2,000,000,000  | 2,504,825,744  | 14.87                    | 25.24                       | 1  |              |
| 第一金      | 2,000,000,000  | 2,162,789,773  | 3.93                     | 8.14                        | 7  |              |
| 野村       | 2,000,000,000  | 2,287,278,483  | 13.76                    | 14.36                       | 3  |              |
| 華南<br>永昌 | 2,000,000,000  | 2,279,829,812  | 7.80                     | 13.99                       | 4  |              |
| 滙豐       | 2,000,000,000  | 2,224,865,090  | 6.55                     | 11.24                       | 5  |              |
| 合計       | 14,000,000,000 | 16,057,269,027 | 10.36                    | 14.69                       | —  |              |

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<br>名稱 | 委託金額           | 目前淨資產          | 113 年截至 5 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(111.1.28~113.5.31) |    |              |
|----------|----------------|----------------|--------------------------|-----------------------------|----|--------------|
|          |                |                |                          | 投資報酬率<br>(%)                | 排名 | 目標報酬率<br>(%) |
| 富邦       | 12,256,867,963 | 14,567,111,800 | 15.81                    | 18.85                       | 2  | 14.26        |
| 統一       | 10,364,185,361 | 12,792,999,350 | 9.86                     | 23.43                       | 1  |              |
| 合計       | 22,621,053,324 | 27,360,111,150 | 12.95                    | 20.95                       | —  |              |

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<br>名稱 | 委託金額          | 目前淨資產         | 113 年截至 5 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(109.11.2~113.5.31) |    |              |
|----------|---------------|---------------|--------------------------|-----------------------------|----|--------------|
|          |               |               |                          | 投資報酬率<br>(%)                | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| 匯豐       | 3,685,000,000 | 7,747,780,996 | 16.15                    | 78.41                       | —  | 89.37        |

註：本批次為相對報酬型，以臺灣加權股價報酬指數為指定指標。

### 國內 101 年第二次委託經營(續約 3)

單位：新臺幣元

| 投信<br>名稱 | 委託金額           | 目前淨資產          | 113 年截至 5 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(113.05.04~113.5.31) |    |              |
|----------|----------------|----------------|--------------------------|------------------------------|----|--------------|
|          |                |                |                          | 投資報酬率<br>(%)                 | 排名 | 目標報酬率<br>(%) |
| 野村       | 27,357,530,009 | 28,448,921,957 | 3.99                     | 3.99                         | —  | 0.47         |

註：本批次為絕對報酬型，契約目標報酬率係以臺灣證交所公告之最近 5 年年底股票集中市場平均殖利率加計 250 個基本點為基準。

### 國內 104 年第一次委託經營(續約 2)

單位：新臺幣元

| 投信<br>名稱 | 委託金額          | 目前淨資產          | 113 年截至 5 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(112.4.6~113.5.31) |    |              |
|----------|---------------|----------------|--------------------------|----------------------------|----|--------------|
|          |               |                |                          | 投資報酬率<br>(%)               | 排名 | 目標報酬率<br>(%) |
| 復華       | 4,800,107,976 | 5,905,566,249  | 10.87                    | 23.03                      | 1  | 7.26         |
| 安聯       | 3,601,947,821 | 4,238,759,827  | 9.20                     | 17.68                      | 2  |              |
| 合計       | 8,402,055,797 | 10,144,326,076 | 10.16                    | 20.74                      | —  |              |

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<br>名稱 | 委託金額           | 目前淨資產          | 113 年截至 5 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(112.2.7~113.5.31) |    |              |
|----------|----------------|----------------|--------------------------|----------------------------|----|--------------|
|          |                |                |                          | 投資報酬率<br>(%)               | 排名 | 目標報酬率<br>(%) |
| 安聯       | 14,089,937,312 | 18,817,184,688 | 14.30                    | 33.55                      | 1  | 8.27         |
| 國泰       | 6,319,107,110  | 7,606,191,782  | 7.39                     | 20.37                      | 3  |              |
| 群益       | 6,384,957,618  | 7,976,957,575  | 7.54                     | 24.93                      | 2  |              |
| 滙豐       | 7,097,524,598  | 8,511,637,859  | 7.68                     | 19.92                      | 4  |              |
| 合計       | 33,891,526,638 | 42,911,971,904 | 10.40                    | 26.62                      | —  |              |

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。

### 國內 109 年第二次委託經營

單位：新臺幣元

| 投信<br>名稱 | 委託金額          | 目前淨資產         | 113 年截至 5 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(111.5.13~113.5.31) |    |              |
|----------|---------------|---------------|--------------------------|-----------------------------|----|--------------|
|          |               |               |                          | 投資報酬率<br>(%)                | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| 安聯       | 1,000,000,000 | 1,699,699,453 | 9.27                     | 64.00                       | 3  | 75.42        |
| 保德信      | 1,000,000,000 | 1,718,068,541 | 8.88                     | 67.03                       | 1  |              |
| 野村       | 1,000,000,000 | 1,753,905,320 | 10.30                    | 66.79                       | 2  |              |
| 國泰       | 1,000,000,000 | 1,683,536,908 | 8.07                     | 61.68                       | 4  |              |
| 富邦       | 1,000,000,000 | 1,681,497,129 | 9.42                     | 60.45                       | 5  |              |
| 合計       | 5,000,000,000 | 8,536,707,351 | 9.19                     | 64.00                       | —  |              |

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<br>名稱 | 委託金額          | 目前淨資產         | 113 年截至 5 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(112.10.5~113.5.31) |    |              |
|----------|---------------|---------------|--------------------------|-----------------------------|----|--------------|
|          |               |               |                          | 投資報酬率<br>(%)                | 排名 | 目標報酬率<br>(%) |
| 安聯       | 500,000,000   | 555,198,852   | 8.67                     | 11.04                       | 6  | 4.08         |
| 施羅德      | 500,000,000   | 593,877,039   | 17.10                    | 18.78                       | 2  |              |
| 國泰       | 500,000,000   | 626,347,538   | 14.90                    | 25.27                       | 1  |              |
| 第一金      | 500,000,000   | 540,710,427   | 3.93                     | 8.14                        | 7  |              |
| 野村       | 500,000,000   | 571,935,810   | 13.80                    | 14.39                       | 3  |              |
| 華南<br>永昌 | 500,000,000   | 570,159,546   | 7.82                     | 14.03                       | 4  |              |
| 滙豐       | 500,000,000   | 556,222,144   | 6.55                     | 11.24                       | 5  |              |
| 合計       | 3,500,000,000 | 4,014,451,356 | 10.38                    | 14.70                       | —  |              |

### (二) 113 年 5 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 5 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(110.6.7~113.5.31) |    |              |
|-------------|---------------|---------------|--------------------------|----------------------------|----|--------------|
|             |               |               |                          | 投資報酬率<br>(%)               | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| 聯博          | 907,613,021   | 748,947,374   | -3.58                    | -17.48                     | 2  | -17.74       |
| 富蘭克林<br>坦伯頓 | 1,251,737,838 | 1,143,693,077 | -3.90                    | -13.98                     | 1  |              |
| 合計          | 2,159,350,859 | 1,892,640,451 | -3.77                    | -15.76                     | —  |              |

##### 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 5 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(111.1.6~113.5.31) |    |              |
|-------|---------------|---------------|--------------------------|----------------------------|----|--------------|
|       |               |               |                          | 投資報酬率<br>(%)               | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| PIMCO | 2,158,967,886 | 1,932,736,471 | -3.20                    | -12.76                     | —  | -14.65       |

##### 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 5 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(111.2.6~113.5.31) |    |              |
|------|---------------|---------------|--------------------------|----------------------------|----|--------------|
|      |               |               |                          | 投資報酬率<br>(%)               | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| 貝萊德  | 1,734,805,538 | 2,081,330,229 | 11.08                    | 19.97                      | 1  | 13.99        |
| 摩根   | 1,485,120,883 | 1,750,536,968 | 9.64                     | 17.87                      | 2  |              |
| 合計   | 3,219,926,421 | 3,831,867,197 | 10.41                    | 19.00                      | —  |              |

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 5 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(111.11.17~113.5.31) |    |              |
|------|-------------|-------------|--------------------------|------------------------------|----|--------------|
|      |             |             |                          | 投資報酬率<br>(%)                 | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| 景順   | 656,507,639 | 755,619,980 | 5.69                     | 15.10                        | —  | 13.79        |

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 5 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(111.12.4~113.5.31) |    |              |
|------|---------------|---------------|--------------------------|-----------------------------|----|--------------|
|      |               |               |                          | 投資報酬率<br>(%)                | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| 貝萊德  | 1,141,092,316 | 1,440,663,181 | 8.91                     | 27.79                       | 2  | 27.27        |
| 道富   | 1,513,655,177 | 1,917,534,339 | 9.24                     | 28.28                       | 1  |              |
| 合計   | 2,654,747,493 | 3,358,197,520 | 9.10                     | 28.07                       | —  |              |

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 5 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(110.7.1~113.5.31) |    |              |
|------|---------------|---------------|--------------------------|----------------------------|----|--------------|
|      |               |               |                          | 投資報酬率<br>(%)               | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| 道富   | 934,565,605   | 1,133,148,418 | 8.47                     | 21.25                      | 1  | 19.50        |
| 貝萊德  | 939,726,931   | 1,135,337,004 | 8.10                     | 20.82                      | 2  |              |
| 合計   | 1,874,292,536 | 2,268,485,422 | 8.29                     | 21.03                      | —  |              |

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 5 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(111.3.6~113.5.31) |    |              |
|----------------|---------------|---------------|--------------------------|----------------------------|----|--------------|
|                |               |               |                          | 投資報酬率<br>(%)               | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| Cohen & Steers | 2,485,932,432 | 2,222,153,394 | -2.50                    | -12.00                     | 1  | -14.85       |
| 景順             | 1,567,127,452 | 1,360,710,515 | -4.51                    | -13.89                     | 2  |              |
| 合計             | 4,053,059,884 | 3,582,863,909 | -3.27                    | -12.71                     | —  |              |

# 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 5 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(111. 7. 31~113. 5. 31) |    |              |
|--------|---------------|---------------|--------------------------|---------------------------------|----|--------------|
|        |               |               |                          | 投資報酬率<br>(%)                    | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| Pictet | 618, 843, 493 | 682, 047, 574 | -1. 65                   | 10. 73                          | —  | 11. 46       |

# 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 5 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(112. 4. 18~113. 5. 31) |    |              |
|------|------------------|------------------|--------------------------|---------------------------------|----|--------------|
|      |                  |                  |                          | 投資報酬率<br>(%)                    | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| 道富   | 1, 163, 392, 347 | 1, 243, 915, 503 | 4. 04                    | 7. 25                           | 2  | 6. 67        |
| 貝萊德  | 1, 252, 011, 599 | 1, 335, 463, 279 | 4. 01                    | 7. 41                           | 1  |              |
| 合計   | 2, 415, 403, 946 | 2, 579, 378, 782 | 4. 02                    | 7. 33                           | —  |              |

# 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 5 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(113. 1. 22~113. 5. 31) |    |              |
|------|------------------|------------------|--------------------------|---------------------------------|----|--------------|
|      |                  |                  |                          | 投資報酬率<br>(%)                    | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| 瑞萬通博 | 1, 716, 000, 834 | 1, 766, 985, 990 | 2. 97                    | 2. 97                           | 3  | 6. 42        |
| MFS  | 1, 114, 480, 846 | 1, 234, 523, 380 | 10. 77                   | 10. 77                          | 1  |              |
| 威靈頓  | 1, 427, 914, 919 | 1, 533, 942, 811 | 7. 43                    | 7. 43                           | 2  |              |
| 合計   | 4, 258, 396, 599 | 4, 535, 452, 181 | 6. 51                    | 6. 51                           | —  |              |

### 102-1 全球信用主動債券型（續約 2）

單位：美元

| 受託機構 | 委託金額          | 目前淨資產         | 113 年截至 5 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(108.4.25~113.5.31) |    |              |
|------|---------------|---------------|--------------------------|-----------------------------|----|--------------|
|      |               |               |                          | 投資報酬率<br>(%)                | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| RBC  | 1,086,559,371 | 1,109,983,530 | 2.16                     | 2.16                        | 1  | 1.83         |
| 貝萊德  | 670,392,768   | 682,261,835   | 1.77                     | 1.77                        | 3  |              |
| 盧米斯  | 891,561,542   | 908,095,700   | 1.85                     | 1.85                        | 2  |              |
| 合計   | 2,648,513,681 | 2,700,341,065 | 1.96                     | 1.96                        | —  |              |

### 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 5 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(109.8.11~113.5.31) |    |              |
|-------|---------------|---------------|--------------------------|-----------------------------|----|--------------|
|       |               |               |                          | 投資報酬率<br>(%)                | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| 北美信託  | 1,796,617,127 | 2,719,103,813 | 14.29                    | 61.89                       | 2  | 59.90        |
| LGIM  | 1,795,083,447 | 2,714,300,813 | 14.28                    | 61.56                       | 3  |              |
| Geode | 1,775,075,832 | 2,694,791,309 | 14.29                    | 62.13                       | 1  |              |
| 合計    | 5,366,776,406 | 8,128,195,935 | 14.29                    | 61.86                       | —  |              |

### 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 5 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(109.9.25~113.5.31) |    |              |
|----------|---------------|---------------|--------------------------|-----------------------------|----|--------------|
|          |               |               |                          | 投資報酬率<br>(%)                | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| Magellan | 1,287,520,518 | 1,590,761,102 | 0.58                     | 21.38                       | 2  | 29.17        |
| RREEF    | 926,848,763   | 1,198,812,833 | 2.68                     | 29.34                       | 1  |              |
| 合計       | 2,214,369,281 | 2,789,573,935 | 1.51                     | 24.61                       | —  |              |

### 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 5 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(109.11.13~113.5.31) |    |              |
|------------|---------------|---------------|--------------------------|------------------------------|----|--------------|
|            |               |               |                          | 投資報酬率<br>(%)                 | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| Brandywine | 821,176,083   | 686,093,894   | -6.93                    | -18.08                       | 2  | -17.57       |
| 盧米斯        | 471,104,127   | 420,232,075   | -4.20                    | -13.89                       | 1  |              |
| 合計         | 1,292,280,210 | 1,106,325,969 | -5.91                    | -16.66                       | —  |              |

### 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 5 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(110.7.20~113.5.31) |    |                 |
|---------|---------------|---------------|--------------------------|-----------------------------|----|-----------------|
|         |               |               |                          | 投資報酬率<br>(%)                | 排名 | 指標/目標<br>報酬率(%) |
| Allianz | 678,698,278   | 699,760,065   | 4.54                     | 1.81                        | 2  | 9.42/23.76      |
| 摩根      | 1,645,715,430 | 1,668,218,841 | 4.52                     | 1.37                        | 3  |                 |
| DWS     | 1,025,711,371 | 1,087,765,525 | 2.15                     | 6.01                        | 1  |                 |
| 柏瑞      | 765,326,657   | 722,662,153   | 1.82                     | -5.57                       | 4  |                 |
| 合計      | 4,115,451,736 | 4,178,406,584 | 3.40                     | 1.14                        | —  |                 |

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 5 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(110.8.24~113.5.31) |    |              |
|------|-------------|-------------|--------------------------|-----------------------------|----|--------------|
|      |             |             |                          | 投資報酬率<br>(%)                | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| 貝萊德  | 949,175,052 | 976,652,175 | 4.27                     | 2.89                        | —  | 2.63         |

## 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 5 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(111.6.22~113.5.31) |    |              |
|------|---------------|---------------|--------------------------|-----------------------------|----|--------------|
|      |               |               |                          | 投資報酬率<br>(%)                | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| 貝萊德  | 601,552,002   | 763,598,734   | 5.82                     | 29.08                       | 4  | 28.72        |
| DWS  | 648,715,051   | 849,017,629   | 6.58                     | 31.17                       | 2  |              |
| 道富   | 749,045,562   | 955,245,787   | 6.63                     | 31.21                       | 1  |              |
| 北美信託 | 702,047,560   | 896,155,164   | 6.27                     | 29.53                       | 3  |              |
| 合計   | 2,701,360,175 | 3,464,017,314 | 6.34                     | 30.29                       | —  |              |

## 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 5 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(111.7.25~113.5.31) |    |                 |
|------------------|---------------|---------------|--------------------------|-----------------------------|----|-----------------|
|                  |               |               |                          | 投資報酬率<br>(%)                | 排名 | 指標/目標<br>報酬率(%) |
| American Century | 427,360,620   | 458,293,756   | 0.53                     | 7.24                        | 3  | 8.91/13.55      |
| 富達               | 965,211,657   | 1,106,686,113 | 2.64                     | 14.66                       | 1  |                 |
| TCW              | 1,039,618,153 | 1,122,374,231 | 0.84                     | 7.94                        | 2  |                 |
| 合計               | 2,432,190,430 | 2,687,354,100 | 1.52                     | 10.54                       | —  |                 |

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 5 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(113.1.23~113.5.31) |    |                 |
|------|---------------|---------------|--------------------------|-----------------------------|----|-----------------|
|      |               |               |                          | 投資報酬率<br>(%)                | 排名 | 指標/目標<br>報酬率(%) |
| 景順   | 786,698,949   | 859,230,715   | 9.22                     | 9.22                        | 2  | 1.85/3.63       |
| 威靈頓  | 787,219,463   | 834,958,784   | 6.06                     | 6.06                        | 4  |                 |
| CPR  | 778,885,217   | 851,094,213   | 9.27                     | 9.27                        | 1  |                 |
| 道富   | 706,462,703   | 761,461,963   | 7.79                     | 7.79                        | 3  |                 |
| 合計   | 3,059,266,332 | 3,306,745,675 | 8.09                     | 8.09                        | —  |                 |

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 5 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(108.12.18~113.5.31) |    |              |
|--------|---------------|---------------|--------------------------|------------------------------|----|--------------|
|        |               |               |                          | 投資報酬率<br>(%)                 | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| Amundi | 400,000,000   | 480,668,030   | 4.39                     | 10.37                        | 4  | 13.79        |
| DWS    | 400,000,000   | 451,933,421   | 3.28                     | 6.08                         | 5  |              |
| Nomura | 400,000,000   | 532,448,531   | 2.65                     | 22.95                        | 3  |              |
| 荷寶     | 300,000,000   | 450,464,683   | 6.58                     | 31.87                        | 1  |              |
| 道富     | 300,000,000   | 433,567,557   | 4.81                     | 25.93                        | 2  |              |
| 合計     | 1,800,000,000 | 2,349,082,222 | 4.26                     | 18.59                        | —  |              |

## 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 5 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(110.1.13~113.5.31) |    |              |
|---------|---------------|---------------|--------------------------|-----------------------------|----|--------------|
|         |               |               |                          | 投資報酬率<br>(%)                | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| DWS     | 600,000,000   | 580,633,754   | -0.83                    | -9.09                       | 4  | -8.20        |
| INSIGHT | 700,000,000   | 697,665,334   | -0.30                    | -7.22                       | 1  |              |
| 摩根      | 400,000,000   | 373,301,504   | -0.44                    | -8.50                       | 2  |              |
| PIMCO   | 480,000,000   | 457,233,773   | -0.57                    | -8.58                       | 3  |              |
| WESTERN | 400,000,000   | 367,366,609   | -0.89                    | -9.63                       | 5  |              |
| 合計      | 2,580,000,000 | 2,476,200,974 | -0.58                    | -8.59                       | —  |              |

## 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 5 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(110.9.8~113.5.31) |    |              |
|-------------|---------------|---------------|--------------------------|----------------------------|----|--------------|
|             |               |               |                          | 投資報酬率<br>(%)               | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| CBRE        | 350,000,000   | 364,171,039   | 3.73                     | 4.61                       | 2  | 5.52         |
| Clearbridge | 450,000,000   | 467,770,329   | 2.12                     | 6.19                       | 1  |              |
| Magellan    | 350,000,000   | 351,129,003   | 0.96                     | -1.19                      | 4  |              |
| RREEF       | 350,000,000   | 361,301,881   | 5.70                     | 3.57                       | 3  |              |
| 合計          | 1,500,000,000 | 1,544,372,252 | 3.05                     | 3.32                       | —  |              |

## 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 5 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(110.10.15~113.5.31) |    |                 |
|---------------|---------------|---------------|--------------------------|------------------------------|----|-----------------|
|               |               |               |                          | 投資報酬率<br>(%)                 | 排名 | 指標/目標<br>報酬率(%) |
| 富達            | 400,000,000   | 380,419,166   | 5.61                     | -5.28                        | 5  | 9.41/22.56      |
| 摩根            | 400,000,000   | 398,897,552   | 4.57                     | -0.45                        | 4  |                 |
| Ninety One    | 400,000,000   | 410,875,887   | 1.32                     | 2.18                         | 2  |                 |
| Schroders     | 400,000,000   | 411,401,222   | 4.47                     | 2.43                         | 1  |                 |
| T. Rowe Price | 400,000,000   | 410,948,377   | 5.22                     | 1.53                         | 3  |                 |
| 合計            | 2,000,000,000 | 2,012,542,204 | 4.19                     | 0.08                         | —  |                 |

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 5 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(112.4.28~113.5.31) |    |              |
|-----------|---------------|---------------|--------------------------|-----------------------------|----|--------------|
|           |               |               |                          | 投資報酬率<br>(%)                | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| 匯豐        | 200,000,000   | 239,393,877   | 8.99                     | 22.82                       | 3  | 22.41        |
| LGIM      | 200,000,000   | 239,013,913   | 8.37                     | 22.16                       | 4  |              |
| 摩根士坦利     | 200,000,000   | 235,256,665   | 8.16                     | 19.54                       | 5  |              |
| Schroders | 200,000,000   | 243,240,369   | 10.51                    | 25.76                       | 2  |              |
| 威靈頓       | 200,000,000   | 246,209,827   | 11.47                    | 26.68                       | 1  |              |
| 合計        | 1,000,000,000 | 1,203,114,651 | 9.50                     | 23.39                       | —  |              |

## 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 5 月<br>累積投資報酬率(%) | 委任迄今<br>(112.7.19~113.5.31) |    |                 |
|---------------|---------------|---------------|---------------------------|-----------------------------|----|-----------------|
|               |               |               |                           | 投資報酬率<br>(%)                | 排名 | 指標/目標<br>報酬率(%) |
| 盧米斯           | 400,000,000   | 420,284,237   | 1.85                      | 6.43                        | 2  | 4.60/6.78       |
| Ninety One    | 400,000,000   | 422,380,082   | 2.38                      | 6.00                        | 3  |                 |
| PIMCO         | 400,000,000   | 422,706,776   | 1.92                      | 5.86                        | 4  |                 |
| PGIM          | 400,000,000   | 420,864,692   | 3.55                      | 7.53                        | 1  |                 |
| T. Rowe Price | 400,000,000   | 405,291,780   | 2.01                      | 2.03                        | 6  |                 |
| 威靈頓           | 400,000,000   | 412,431,186   | 2.48                      | 4.65                        | 5  |                 |
| 合計            | 2,400,000,000 | 2,503,958,753 | 2.36                      | 5.43                        | —  |                 |

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 5 月<br>累積投資報酬率(%) | 委任迄今<br>(108.6.24~113.5.31) |    |              |
|------|-------------|-------------|---------------------------|-----------------------------|----|--------------|
|      |             |             |                           | 投資報酬率<br>(%)                | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| 富達   | 686,579,222 | 947,271,071 | 3.06                      | 31.12                       | —  | 34.07        |

### 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 5 月<br>累積投資報酬率(%) | 委任迄今<br>(111.1.6~113.5.31) |    |              |
|-------|---------------|---------------|---------------------------|----------------------------|----|--------------|
|       |               |               |                           | 投資報酬率<br>(%)               | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| PIMCO | 1,003,724,736 | 875,240,785   | -3.22                     | -12.80                     | 1  | -14.65       |
| 盧米斯   | 1,018,693,762 | 876,102,407   | -3.97                     | -15.10                     | 2  |              |
| 合計    | 2,022,418,498 | 1,751,343,192 | -3.58                     | -13.92                     | —  |              |

### 97-1 全球增值股票型(續約 3)

單位：美元

| 受託<br>機構 | 委託金額          | 目前淨資產         | 113 年截至 5 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(111.2.6~113.5.31) |    |              |
|----------|---------------|---------------|--------------------------|----------------------------|----|--------------|
|          |               |               |                          | 投資報酬率<br>(%)               | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| 貝萊德      | 1,156,987,544 | 1,388,522,325 | 11.08                    | 20.01                      | —  | 13.99        |

### 98-1 亞太(日本除外)主動股票型(續約 3)

單位：美元

| 受託<br>機構 | 委託金額        | 目前淨資產       | 113 年截至 5 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(111.11.17~113.5.31) |    |              |
|----------|-------------|-------------|--------------------------|------------------------------|----|--------------|
|          |             |             |                          | 投資報酬率<br>(%)                 | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| 景順       | 231,124,998 | 270,292,342 | 5.40                     | 14.66                        | —  | 13.79        |

### 100-1 全球基本面指數被動股票型(續約 2)

單位：美元

| 受託<br>機構 | 委託金額          | 目前淨資產         | 113 年截至 5 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(111.3.6~113.5.31) |    |              |
|----------|---------------|---------------|--------------------------|----------------------------|----|--------------|
|          |               |               |                          | 投資報酬率<br>(%)               | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| 貝萊德      | 304,997,166   | 372,898,569   | 8.11                     | 22.26                      | 3  | 20.98        |
| 道富       | 360,436,214   | 442,504,448   | 8.50                     | 22.77                      | 1  |              |
| 瑞銀       | 308,879,836   | 378,573,304   | 8.16                     | 22.56                      | 2  |              |
| Nomura   | 360,147,608   | 439,713,946   | 8.01                     | 22.09                      | 4  |              |
| 合計       | 1,334,460,824 | 1,633,690,267 | 8.20                     | 22.42                      | —  |              |

### 101-1 全球低波動指數被動股票型(續約 2)

單位：美元

| 受託<br>機構 | 委託金額        | 目前淨資產       | 113 年截至 5 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(112.4.18~113.5.31) |    |              |
|----------|-------------|-------------|--------------------------|-----------------------------|----|--------------|
|          |             |             |                          | 投資報酬率<br>(%)                | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| 貝萊德      | 751,993,706 | 808,295,073 | 4.04                     | 7.49                        | —  | 6.67         |

## 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 5 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(113.1.22~113.5.31) |    |              |
|------|---------------|---------------|--------------------------|-----------------------------|----|--------------|
|      |               |               |                          | 投資報酬率<br>(%)                | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| 瑞萬通博 | 414,056,068   | 426,376,507   | 2.98                     | 2.98                        | 3  | 6.42         |
| MFS  | 315,296,707   | 349,243,612   | 10.77                    | 10.77                       | 1  |              |
| 威靈頓  | 704,502,354   | 756,801,070   | 7.42                     | 7.42                        | 2  |              |
| 合計   | 1,433,855,129 | 1,532,421,189 | 6.87                     | 6.87                        | —  |              |

## 102-2 全球基礎建設有價證券型(續約 2)

單位：美元

| 受託機構   | 委託金額        | 目前淨資產       | 113 年截至 5 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(108.5.29~113.5.31) |    |              |
|--------|-------------|-------------|--------------------------|-----------------------------|----|--------------|
|        |             |             |                          | 投資報酬率<br>(%)                | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| Lazard | 954,418,976 | 960,404,443 | 0.63                     | 0.63                        | —  | 1.60         |

## 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 5 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(108.8.27~113.5.31) |    |              |
|-----------|-------------|-------------|--------------------------|-----------------------------|----|--------------|
|           |             |             |                          | 投資報酬率<br>(%)                | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| 信安環球      | 610,886,182 | 634,682,213 | -2.73                    | 0.50                        | 2  | -4.92        |
| Macquarie | 126,937,100 | 130,072,940 | -3.30                    | 2.47                        | 1  |              |
| 合計        | 737,823,282 | 764,755,153 | -2.83                    | 0.90                        | —  |              |

## 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 5 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(110.7.20~113.5.31) |    |                 |
|---------|---------------|---------------|--------------------------|-----------------------------|----|-----------------|
|         |               |               |                          | 投資報酬率<br>(%)                | 排名 | 指標/目標<br>報酬率(%) |
| Allianz | 155,447,975   | 158,523,351   | 4.54                     | 1.98                        | 2  | 9.42/23.76      |
| 摩根      | 594,592,070   | 605,306,397   | 4.59                     | 1.80                        | 3  |                 |
| DWS     | 311,387,682   | 330,319,196   | 2.14                     | 6.08                        | 1  |                 |
| 柏瑞      | 254,823,294   | 240,469,908   | 1.81                     | -5.63                       | 4  |                 |
| 合計      | 1,316,251,021 | 1,334,618,852 | 3.46                     | 1.40                        | —  |                 |

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 5 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(111.6.22~113.5.31) |    |              |
|------|-------------|-------------|--------------------------|-----------------------------|----|--------------|
|      |             |             |                          | 投資報酬率<br>(%)                | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| 貝萊德  | 127,303,524 | 163,987,297 | 5.78                     | 28.82                       | 4  | 28.72        |
| DWS  | 147,528,441 | 193,390,926 | 6.58                     | 31.09                       | 2  |              |
| 道富   | 157,982,595 | 207,277,903 | 6.57                     | 31.20                       | 1  |              |
| 北美信託 | 158,484,700 | 205,028,958 | 6.28                     | 29.37                       | 3  |              |
| 合計   | 591,299,260 | 769,685,084 | 6.33                     | 30.17                       | —  |              |

## 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 5 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(111.7.25~113.5.31) |    |                 |
|------------------|-------------|---------------|--------------------------|-----------------------------|----|-----------------|
|                  |             |               |                          | 投資報酬率<br>(%)                | 排名 | 指標/目標<br>報酬率(%) |
| American Century | 319,635,794 | 342,609,133   | 0.47                     | 7.19                        | 3  | 8.91/13.55      |
| 富達               | 299,785,344 | 345,485,657   | 2.79                     | 15.24                       | 1  |                 |
| TCW              | 328,000,470 | 354,794,198   | 0.96                     | 8.17                        | 2  |                 |
| 合計               | 947,421,608 | 1,042,888,988 | 1.40                     | 10.08                       | —  |                 |

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 5 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(113.1.23~113.5.31) |    |                 |
|------|-------------|-------------|--------------------------|-----------------------------|----|-----------------|
|      |             |             |                          | 投資報酬率<br>(%)                | 排名 | 指標/目標<br>報酬率(%) |
| 景順   | 116,977,839 | 127,764,591 | 9.22                     | 9.22                        | 2  | 1.85/3.63       |
| 威靈頓  | 107,476,614 | 113,993,637 | 6.06                     | 6.06                        | 3  |                 |
| CPR  | 115,110,097 | 125,782,549 | 9.27                     | 9.27                        | 1  |                 |
| 合計   | 339,564,550 | 367,540,777 | 8.24                     | 8.24                        | —  |                 |

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 5 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(110.9.8~113.5.31) |    |              |
|-------------|-------------|-------------|--------------------------|----------------------------|----|--------------|
|             |             |             |                          | 投資報酬率<br>(%)               | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| CBRE        | 60,000,000  | 62,178,481  | 3.91                     | 4.86                       | 2  | 5.52         |
| ClearBridge | 60,000,000  | 62,754,240  | 3.09                     | 7.33                       | 1  |              |
| Magellan    | 30,000,000  | 29,810,993  | 0.94                     | -0.63                      | 4  |              |
| RREEF       | 60,000,000  | 61,795,439  | 5.73                     | 4.24                       | 3  |              |
| 合計          | 210,000,000 | 216,539,153 | 3.54                     | 4.07                       | —  |              |

### (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5月31日

#### 1. 避險：

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

#### 2. 投資：無

### (二)舊制勞工退休基金自營部位

(依交易目的)

113年5月31日

#### 1. 避險：

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

#### 2. 投資：無

## 七、勞工退休基金財務收支表

### (一)新制勞工退休基金

單位：新臺幣元

|         | 餘絀              | 收入              | 支出             |
|---------|-----------------|-----------------|----------------|
| 113年5月份 | 103,057,337,728 | 116,874,382,466 | 13,817,044,738 |

### (二)舊制勞工退休基金

單位：新臺幣元

|         | 餘絀             | 收入             | 支出          |
|---------|----------------|----------------|-------------|
| 113年5月份 | 24,743,073,706 | 24,898,766,279 | 155,692,573 |

## 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 5 月份 |                 | 單位：新臺幣元        |
|------------|-----------------|----------------|
| 項 目        | 金 額             |                |
| 現金收入       | 166,591,286,354 |                |
| 現金支出       | 170,973,814,861 |                |
| 現金增(減)數    |                 | -4,382,528,507 |

### (二)舊制勞工退休基金

| 113 年 5 月份 |                | 單位：新臺幣元  |
|------------|----------------|----------|
| 項 目        | 金 額            |          |
| 現金收入       | 27,883,018,701 |          |
| 現金支出       | 27,883,581,683 |          |
| 現金增(減)數    |                | -562,982 |