

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 8 月底績效

基金與指標	新制基金	舊制基金	台灣 10 年期 公債殖利率	台灣加權 股價指數	MSCI 全球 股票指數	Bloomberg 全球債券指數
收益率/報酬率	14.08%	16.71%	1.49%	24.19%	15.97%	1.86%

註 1：股、債指數係依據勞動部 111 年 4 月 29 日勞動福 4 字第 1110145465 號函核定之勞動基金投資政策書所載參考指標，且均為原幣別報酬率。

註 2：收益率係評價後收益數÷日平均餘額。

(二) 近一年(112 年)績效

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

(三) 近三年(110~112 年)平均績效

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

(四) 近五年(108~112 年)平均績效

基金與指標	新制基金	舊制基金	台灣 10 年期 公債殖利率	台灣加權 股價指數	MSCI 全球 股票指數	Bloomberg 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 8 月底止基金規模與收益			
基金運用規模			4 兆 4,305 億 4,568 萬元
113 年截至 8 月底止 運用收益數及收益率	自行運用	國內固定收益	86 億 6,972 萬元 1.59%
		國內權益證券 及國外投資	1,680 億 76 萬元 18.73%
	委託經營		4,195 億 6,294 萬元 16.66%
	合 計		5,962 億 3,342 萬元 14.08%

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 8 月之保證收益率為 1.7108%。

2. 舊制勞工退休基金

113 年 8 月底止基金規模與收益			
基金運用規模			10,446 億 4,177 萬元
113 年截至 8 月底止 運用收益數及收益率	自行運用	國內固定收益	29 億 4,690 萬元 1.53%
		國內權益證券 及國外投資	683 億 7,590 萬元 31.02%
	委託經營		756 億 6,771 萬元 14.55%
	合 計		1,469 億 9,051 萬元 16.71%

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 8 月 31 日

單位：新臺幣元

項 目	餘 額	占基金運用比率(%)
自行運用	1,805,651,228,132	40.75
轉存金融機構	533,729,406,073	12.05
短期票券	84,322,841,982	1.90
公債、公司債、金融債券及特別股	232,748,267,587	5.25
股票及受益憑證投資(含期貨)	231,745,110,563	5.23
國外投資	723,105,601,927	16.32
固定收益	612,198,944,620	13.82
權益證券	56,625,008,772	1.28
另類投資	54,281,648,535	1.22
委託經營	2,624,894,454,093	59.25
國內委託經營	615,812,280,209	13.90
國外委託經營	2,009,082,173,884	45.35
固定收益	526,533,225,601	11.89
權益證券	1,037,661,909,788	23.42
另類投資	444,887,038,495	10.04
合 計	4,430,545,682,225	100.00

2. 舊制勞工退休基金

113 年 8 月 31 日

單位：新臺幣元

項 目	餘 額	占基金運用比率(%)
自行運用	507,005,360,933	48.53
轉存金融機構	153,708,464,126	14.71
短期票券	60,944,969,664	5.84
公債、金融債券、公司債及證券化商品	76,803,807,967	7.35
股票及受益憑證投資(含期貨)	118,987,851,358	11.39
國外投資	96,560,267,818	9.24
固定收益	52,608,092,758	5.04
權益證券	35,315,274,251	3.38
另類投資	8,636,900,809	0.82
委託經營	537,636,413,304	51.47
國內委託經營	116,884,927,167	11.19
國外委託經營	420,751,486,137	40.28
固定收益	101,673,980,959	9.73
權益證券	213,590,340,077	20.45
另類投資	105,487,165,101	10.10
合 計	1,044,641,774,237	100.00

(三) 基金自營投資與委外投資比率

1. 新制勞工退休基金

113 年 8 月 31 日

單位：新臺幣元

項 目	金 額	占基金運用比率(%)
自 行 運 用	1,805,651,228,132	40.75
委 託 經 營	2,624,894,454,093	59.25

2. 舊制勞工退休基金

113 年 8 月 31 日

單位：新臺幣元

項 目	金 額	占基金運用比率(%)
自 行 運 用	507,005,360,933	48.53
委 託 經 營	537,636,413,304	51.47

(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 8 月 31 日

單位：新臺幣元

項 目	金 額	占基金運用比率(%)
國 內 投 資	1,698,357,906,414	38.33
國 外 投 資	2,732,187,775,811	61.67

2. 舊制勞工退休基金

113 年 8 月 31 日

單位：新臺幣元

項 目	金 額	占基金運用比率(%)
國 內 投 資	527,330,020,282	50.48
國 外 投 資	517,311,753,955	49.52

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 8 月底

項 目	收益率(%)
國內權益證券	48.27

2. 舊制勞工退休基金

113 年截至 8 月底

項 目	收益率(%)
國內權益證券	45.44

(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 8 月 31 日 單位：新臺幣元

項 目	金 額	比 率 (%)
國內權益證券	231,745,110,563	5.23

2. 舊制勞工退休基金

113 年 8 月 31 日 單位：新臺幣元

項 目	金 額	比 率 (%)
國內權益證券	118,987,851,358	11.39

四、基金國內委外投資概況表

(一)基金國內委外投資績效、績效指標及排名表

1. 新制勞工退休基金

96 年第一次委託經營(續約 5)

單位：新臺幣元

投信 名稱	委託金額	目前淨資產	113 年截至 8 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (111.9.27~113.8.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	目標報酬率 (%)
野村	28,072,603,831	41,025,498,812	18.33	46.14	—	12.06

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

97 年第一次委託經營(續約 5)

單位：新臺幣元

投信 名稱	委託金額	目前淨資產	113 年截至 8 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (112.1.30~113.8.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	目標報酬率 (%)
野村	6,829,066,771	9,758,203,311	20.05	42.89	—	9.94

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

98 年第一次委託經營(續約 5)

單位：新臺幣元

投信 名稱	委託金額	目前淨資產	113 年截至 8 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (113.7.16~113.8.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	目標報酬率 (%)
野村	25,455,695,879	23,878,984,648	-6.19	-6.19	2	0.78
保德信	7,430,070,832	7,166,218,252	-3.55	-3.55	1	
合計	32,885,766,711	31,045,202,900	-5.60	-5.60	—	

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。

99 年第二次委託經營(續約 3)

單位：新臺幣元

投信 名稱	委託金額	目前淨資產	113 年截至 8 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (111.12.5~113.8.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	目標報酬率 (%)
國泰	10,445,113,310	13,329,972,718	16.01	27.62	—	10.90

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

100 年第一次委託經營(續約 3)(相對報酬)

單位：新臺幣元

投信 名稱	委託金額	目前淨資產	113 年截至 8 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (112.7.15~113.8.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
復華	29,101,525,086	36,184,559,810	18.73	24.34	—	24.98

註：本批次為相對報酬型，以臺灣就業 99 指數為指定指標。

101 年第二次委託經營(續約 3)

單位：新臺幣元

投信 名稱	委託金額	目前淨資產	113 年截至 8 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (113.7.20~113.8.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	目標報酬率 (%)
野村	15,198,354,580	15,065,395,968	-0.87	-0.87	1	0.72
統一	20,913,151,881	20,627,591,529	-1.37	-1.37	2	
合計	36,111,506,461	35,692,987,497	-1.16	-1.16	—	

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

102 年第二次委託經營(續約 2) (相對報酬) 單位：新臺幣元

投信 名稱	委託金額	目前淨資產	113 年截至 8 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (111.1.24~113.8.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
統一	14,437,134,744	20,581,936,453	28.16	42.56	1	38.09
復華	18,009,802,076	23,881,426,975	27.54	31.34	2	
合計	32,446,936,820	44,463,363,428	27.81	36.18	—	

註：本批次為相對報酬型，以臺灣加權股價報酬指數為指定指標。

103 年第一次委託經營(續約 2) 單位：新臺幣元

投信 名稱	委託金額	目前淨資產	113 年截至 8 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (111.10.11~113.8.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	目標報酬率 (%)
台新	15,841,461,125	22,039,949,334	12.65	39.13	—	11.82

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

103 年第二次委託經營(續約) (相對報酬)

單位：新臺幣元

投信 名稱	委託金額	目前淨資產	113 年截至 8 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (110.12.1~113.8.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
國泰	14,836,482,661	21,326,593,968	20.49	45.44	4	49.47
統一	11,353,734,691	16,785,903,701	20.35	47.84	1	
復華	10,890,868,617	15,987,696,796	20.39	46.80	2	
滙豐	10,790,827,015	15,748,549,977	20.31	45.94	3	
安聯	15,017,345,063	21,601,580,140	19.63	45.37	5	
合計	62,889,258,047	91,450,324,582	20.21	46.19	—	

註：本批次為相對報酬型，以臺灣高薪 100 報酬指數為指定指標。

104 年第一次委託經營 (續約 2)

單位：新臺幣元

投信 名稱	委託金額	目前淨資產	113 年截至 8 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (112.4.6~113.8.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	目標報酬率 (%)
復華	4,799,121,512	6,258,974,474	17.53	30.42	1	8.79
安聯	3,601,238,896	4,635,012,237	19.43	28.71	2	
合計	8,400,360,408	10,893,986,711	18.33	29.68	—	

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

106 年第一次委託經營 (續約)

單位：新臺幣元

投信 名稱	委託金額	目前淨資產	113 年截至 8 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (112.2.7~113.8.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	目標報酬率 (%)
安聯	14,088,712,403	19,894,487,867	20.85	41.21	1	9.80
國泰	6,318,453,600	8,267,270,951	16.73	30.84	2	
群益	6,382,621,945	8,030,096,087	8.32	25.81	4	
滙豐	7,096,535,878	8,941,593,421	13.13	26.00	3	
合計	33,886,323,826	45,133,448,326	16.14	33.19	—	

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

107 年第一次委託經營(續約)(相對報酬)

單位：新臺幣元

投信 名稱	委託金額	目前淨資產	113 年截至 8 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (112.10.24~113.8.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
台新	8,254,694,051	11,888,247,725	29.93	44.02	1	43.87
安聯	12,775,472,416	18,254,737,584	29.56	42.89	4	
保德信	9,403,481,285	13,508,144,802	30.19	43.65	2	
統一	12,635,490,783	18,029,091,775	29.25	42.69	5	
國泰	10,445,956,159	14,729,748,231	28.27	41.01	7	
復華	7,235,716,436	10,368,770,746	29.79	43.30	3	
群益	4,439,275,178	6,304,032,961	28.70	42.01	6	
合計	65,190,086,308	93,082,773,824	29.40	42.79	—	

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 名稱	委託金額	目前淨資產	113 年截至 8 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (113.5.24~113.8.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	目標報酬率 (%)
安聯	11,613,817,760	12,263,979,909	5.60	5.60	2	1.67
施罗德	11,400,361,947	11,745,777,793	3.03	3.03	6	
統一	11,638,402,860	12,257,287,528	5.32	5.32	4	
野村	18,601,693,072	19,417,381,205	4.39	4.39	5	
國泰	19,457,627,824	20,757,165,423	6.68	6.68	1	
復華	9,724,896,734	10,251,622,283	5.42	5.42	3	
合計	82,436,800,197	86,693,214,141	5.16	5.16	—	

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

109 年第一次委託經營

單位：新臺幣元

投信 名稱	委託金額	目前淨資產	113 年截至 8 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (110.5.13~113.8.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	目標報酬率 (%)
台新	8,000,000,000	10,600,762,803	13.87	32.51	4	19.08
安聯	8,000,000,000	10,820,505,665	20.68	35.26	2	
保德信	8,000,000,000	9,795,112,098	13.41	22.44	5	
國泰	8,000,000,000	11,796,581,736	24.56	47.46	1	
野村	8,000,000,000	10,635,723,762	19.01	32.95	3	
合計	40,000,000,000	53,648,686,064	18.38	34.12	—	

註：本批次為絕對報酬型，契約目標報酬率係以臺灣證交所公告之最近 5 年年底股票集中市場平均殖利率加計 200 個基本點為基準。

109 年第二次委託經營（相對報酬）

單位：新臺幣元

投信 名稱	委託金額	目前淨資產	113 年截至 8 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (111.5.13~113.8.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
安聯	3,000,000,000	4,991,605,162	6.98	60.50	3	71.29
保德信	3,000,000,000	5,110,287,222	7.96	65.62	1	
野村	3,000,000,000	5,144,113,022	7.84	63.06	2	
國泰	3,000,000,000	4,988,156,161	6.74	59.65	4	
富邦	3,000,000,000	4,912,639,765	6.55	56.15	5	
合計	15,000,000,000	25,146,801,332	7.22	60.99	—	

註：本批次為相對報酬型，以臺灣企業社會責任中小型報酬指數為指定指標。

110 年第一次委託經營

單位：新臺幣元

投信 名稱	委託金額	目前淨資產	113 年截至 8 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (110.12.15~113.8.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	目標報酬率 (%)
安聯	8,000,000,000	9,932,120,323	20.60	27.85	3	16.89
保德信	8,000,000,000	9,386,984,541	4.37	19.65	5	
國泰	8,000,000,000	10,244,692,150	23.08	34.38	1	
第一金	8,000,000,000	9,003,396,759	5.68	12.32	6	
野村	8,000,000,000	9,610,288,612	18.70	21.25	4	
富邦	8,000,000,000	10,065,963,071	21.87	28.28	2	
合計	48,000,000,000	58,243,445,456	15.55	23.94	—	

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

111 年第一次委託經營

單位：新臺幣元

投信 名稱	委託金額	目前淨資產	113 年截至 8 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (112.10.5~113.8.31)		
				投資 報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
安聯	2,000,000,000	2,426,646,535	18.64	21.33	3	5.61
施罗德	2,000,000,000	2,448,450,568	20.69	22.42	2	
國泰	2,000,000,000	2,673,678,404	22.61	33.68	1	
第一金	2,000,000,000	2,186,590,962	5.07	9.33	7	
野村	2,000,000,000	2,389,097,329	18.82	19.45	4	
華南 永昌	2,000,000,000	2,267,564,605	7.22	13.38	6	
滙豐	2,000,000,000	2,317,332,153	10.98	15.87	5	
合計	14,000,000,000	16,709,360,556	14.85	19.35	—	

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

2. 舊制勞工退休基金

國內 98 年第二次委託經營(續約 4)

單位：新臺幣元

投信 名稱	委託金額	目前淨資產	113 年截至 8 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (111.1.28~113.8.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	目標報酬率 (%)
富邦	12,256,867,963	15,301,264,161	21.65	24.84	2	15.79
統一	10,364,185,361	13,431,433,465	15.34	29.59	1	
合計	22,621,053,324	28,732,697,626	18.62	27.02	—	

註：本批次為絕對報酬型，契約目標報酬率係以臺灣證交所公告之最近 4 年年底股票集中市場平均殖利率加計 250 個基本點為基準。

國內 101 年第一次委託經營(相對報酬)(續約 2)

單位：新臺幣元

投信 名稱	委託金額	目前淨資產	113 年截至 8 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (109.11.2~113.8.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
滙豐	3,685,000,000	8,292,185,865	24.31	90.95	—	102.75

註：本批次為相對報酬型，以臺灣加權股價報酬指數為指定指標。

國內 101 年第二次委託經營(續約 3)

單位：新臺幣元

投信 名稱	委託金額	目前淨資產	113 年截至 8 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (113.05.04~113.8.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	目標報酬率 (%)
野村	27,357,530,009	29,807,204,172	8.95	8.95	—	2.00

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

國內 104 年第一次委託經營(續約 2)

單位：新臺幣元

投信 名稱	委託金額	目前淨資產	113 年截至 8 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (112.4.6~113.8.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	目標報酬率 (%)
復華	4,800,107,976	6,260,318,704	17.53	30.42	1	8.79
安聯	3,601,947,821	4,635,904,242	19.43	28.71	2	
合計	8,402,055,797	10,896,222,946	18.33	29.69	—	

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。

國內 106 年第一次委託經營(續約)

單位：新臺幣元

投信 名稱	委託金額	目前淨資產	113 年截至 8 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (112.2.7~113.8.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	目標報酬率 (%)
安聯	14,089,937,312	19,896,656,290	20.85	41.21	1	9.80
國泰	6,319,107,110	8,268,348,035	16.73	30.85	2	
群益	6,384,957,618	8,036,834,176	8.35	25.87	4	
滙豐	7,097,524,598	8,943,011,526	13.13	26.00	3	
合計	33,891,526,638	45,144,850,027	16.15	33.20	—	

註：本批次為絕對報酬型，112.2.7 加碼安聯 30 億元，契約目標報酬率係以臺灣證交所公告之最近 5 年年底股票集中市場平均殖利率加計 250 個基本點為基準。

國內 109 年第二次委託經營

單位：新臺幣元

投信 名稱	委託金額	目前淨資產	113 年截至 8 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (111.5.13~113.8.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
安聯	1,000,000,000	1,664,039,839	6.98	60.56	3	71.29
保德信	1,000,000,000	1,703,542,337	7.96	65.62	1	
野村	1,000,000,000	1,714,831,958	7.85	63.07	2	
國泰	1,000,000,000	1,662,881,832	6.74	59.70	4	
富邦	1,000,000,000	1,637,587,988	6.56	56.26	5	
合計	5,000,000,000	8,382,883,954	7.22	61.04	—	

註：本批次為相對報酬型，以臺灣企業社會責任中小型報酬指數為指定指標。

國內 111 年第一次委託經營

單位：新臺幣元

投信 名稱	委託金額	目前淨資產	113 年截至 8 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (112.10.5~113.8.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	目標報酬率 (%)
安聯	500,000,000	605,453,712	18.51	21.09	3	5.61
施羅德	500,000,000	612,205,513	20.71	22.44	2	
國泰	500,000,000	668,817,744	22.69	33.76	1	
第一金	500,000,000	546,612,907	5.07	9.32	7	
野村	500,000,000	597,424,478	18.87	19.48	4	
華南 永昌	500,000,000	567,048,453	7.23	13.41	6	
滙豐	500,000,000	579,351,423	10.98	15.87	5	
合計	3,500,000,000	4,176,914,230	14.85	19.34	—	

(二) 113 年 8 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 8 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (110.6.7~113.8.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
聯博	907,613,021	789,030,722	1.58	-13.07	2	-13.23
富蘭克林 坦伯頓	1,251,737,838	1,204,409,180	1.20	-9.41	1	
合計	2,159,350,859	1,993,439,902	1.36	-11.27	—	

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 8 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (111.1.6~113.8.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
PIMCO	2,158,967,886	2,024,957,817	1.42	-8.59	—	-9.97

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 8 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (111.2.6~113.8.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
貝萊德	1,734,805,538	2,200,730,848	17.45	26.86	1	21.42
JPMorgan	1,485,120,883	1,857,704,084	16.35	25.09	2	
合計	3,219,926,421	4,058,434,932	16.94	26.04	—	

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 8 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (111.11.17~113.8.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
景順	656,507,639	786,857,185	10.06	19.85	—	21.15

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 8 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (111.12.4~113.8.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
貝萊德	1,141,092,316	1,533,429,569	15.93	36.02	2	35.56
道富	1,513,655,177	2,043,092,627	16.40	36.68	1	
合計	2,654,747,493	3,576,522,196	16.19	36.39	—	

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 8 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (110.7.1~113.8.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
道富	934,565,605	1,187,372,110	13.66	27.05	1	25.23
貝萊德	939,726,931	1,189,709,136	13.28	26.60	2	
合計	1,874,292,536	2,377,081,246	13.47	26.83	—	

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 8 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (111.3.6~113.8.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
Cohen & Steers	2,485,932,432	2,483,850,441	8.99	-1.63	1	-4.47
景順	1,567,127,452	1,501,496,801	5.37	-4.98	2	
合計	4,053,059,884	3,985,347,242	7.60	-2.90	—	

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 8 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (111. 7. 31~113. 8. 31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
Pictet	618, 843, 493	712, 668, 026	2. 76	15. 70	—	16. 34

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 8 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (112. 4. 18~113. 8. 31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
道富	1, 163, 392, 347	1, 372, 992, 846	14. 83	18. 37	2	17. 85
貝萊德	1, 252, 011, 599	1, 474, 703, 860	14. 85	18. 61	1	
合計	2, 415, 403, 946	2, 847, 696, 706	14. 84	18. 49	—	

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 8 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (113. 1. 22~113. 8. 31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
瑞萬通博	1, 716, 000, 834	1, 892, 180, 615	10. 27	10. 27	3	13. 67
MFS	1, 114, 480, 846	1, 292, 242, 349	15. 95	15. 95	1	
威靈頓	1, 427, 914, 919	1, 618, 614, 932	13. 36	13. 36	2	
合計	4, 258, 396, 599	4, 803, 037, 896	12. 79	12. 79	—	

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 8 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (113.4.25~113.8.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
RBC	1,086,559,371	1,166,224,338	7.33	7.33	1	6.64
貝萊德	670,392,768	713,693,882	6.46	6.46	3	
盧米斯	891,561,542	950,055,730	6.56	6.56	2	
合計	2,648,513,681	2,829,973,950	6.85	6.85	—	

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 8 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (109.8.11~113.8.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
北美信託	1,796,617,127	2,902,964,019	22.02	72.84	2	70.71
LGIM	1,795,083,447	2,897,205,329	21.98	72.45	3	
Geode	1,775,075,832	2,875,420,165	21.95	73.00	1	
合計	5,366,776,406	8,675,589,513	21.98	72.76	—	

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 8 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (109.9.25~113.8.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
Magellan	1,287,520,518	1,721,484,712	8.84	31.36	2	41.33
RREEF	926,848,763	1,314,813,302	12.62	41.86	1	
合計	2,214,369,281	3,036,298,014	10.49	35.63	—	

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 8 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (109.11.13~113.8.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
Brandywine	821,176,083	724,984,617	-1.66	-13.43	2	-12.73
盧米斯	471,104,127	444,284,587	1.28	-8.96	1	
合計	1,292,280,210	1,169,269,204	-0.56	-11.92	—	

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 8 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (110.7.20~113.8.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標/目標報酬率(%)
Allianz	678,698,278	725,663,481	8.41	5.58	3	10.83/26.43
JPMorgan	1,645,715,430	1,753,368,487	9.86	6.54	2	
DWS	1,025,711,371	1,136,324,265	6.71	10.75	1	
柏瑞	765,326,657	746,406,050	5.16	-2.47	4	
合計	4,115,451,736	4,361,762,283	7.94	5.58	—	

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 8 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (110.8.24~113.8.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
貝萊德	949,175,052	1,047,224,808	11.81	10.33	—	9.39

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 8 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (111.6.22~113.8.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
貝萊德	601,552,002	812,777,792	12.64	37.39	4	37.25
DWS	648,715,051	904,748,714	13.58	39.78	2	
道富	749,045,562	1,018,228,376	13.66	39.86	1	
北美信託	702,047,560	954,466,143	13.18	37.96	3	
合計	2,701,360,175	3,690,221,025	13.29	38.80	—	

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 8 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (111.7.25~113.8.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標/目標 報酬率(%)
American Century	427,360,620	475,192,342	4.23	11.19	3	10.31/15.58
富達	965,211,657	1,138,500,206	5.59	17.95	1	
TCW	1,039,618,153	1,165,047,012	4.68	12.04	2	
合計	2,432,190,430	2,778,739,560	4.97	14.30	—	

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 8 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (113.1.23~113.8.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標/目標 報酬率(%)
景順	786,698,949	887,423,613	12.80	12.80	3	3.16/6.20
威靈頓	787,219,463	885,802,367	12.52	12.52	4	
CPR	778,885,217	897,642,135	15.25	15.25	1	
道富	706,462,703	811,651,609	14.89	14.89	2	
合計	3,059,266,332	3,482,519,724	13.84	13.84	—	

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 8 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (108.12.18~113.8.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
Amundi	350,000,000	452,908,406	9.24	15.49	4	20.96
DWS	300,000,000	382,082,491	10.38	13.38	5	
Nomura	400,000,000	559,467,334	7.85	29.19	3	
荷寶	300,000,000	469,885,041	11.17	37.56	1	
道富	300,000,000	456,633,931	10.39	32.63	2	
合計	1,650,000,000	2,320,977,203	9.68	24.75	—	

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 8 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (110.1.13~113.8.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
DWS	600,000,000	607,215,119	3.71	-4.93	4	-4.04
Insight	700,000,000	729,359,422	4.23	-3.00	1	
JPMorgan	400,000,000	390,987,032	4.28	-4.16	2	
PIMCO	480,000,000	478,749,975	4.11	-4.28	3	
Western	400,000,000	385,040,893	3.88	-5.28	5	
合計	2,580,000,000	2,591,352,441	4.04	-4.33	—	

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 8 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (110.9.8~113.8.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
CBRE	350,000,000	385,084,558	9.69	10.62	3	13.53
Clearbridge	450,000,000	494,858,966	8.04	12.34	1	
Magellan	350,000,000	378,711,561	8.90	6.57	4	
RREEF	350,000,000	388,798,277	13.74	11.46	2	
合計	1,500,000,000	1,647,453,362	9.92	10.22	—	

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 8 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (110.10.15~113.8.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標/目標 報酬率(%)
富達	400,000,000	401,004,283	11.33	-0.16	5	10.82/25.23
JPMorgan	400,000,000	418,944,720	9.82	4.55	4	
Ninety One	400,000,000	422,757,715	4.25	5.13	3	
Schroders	400,000,000	431,688,584	9.62	7.48	1	
T. Rowe Price	400,000,000	428,488,454	9.71	5.86	2	
合計	2,000,000,000	2,102,883,756	8.87	4.58	—	

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 8 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (112.4.28~113.8.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
滙豐	200,000,000	261,491,307	19.05	34.16	2	32.15
LGIM	200,000,000	258,562,999	17.23	32.16	4	
摩根士丹利	200,000,000	254,734,646	17.12	29.44	5	
Schroders	200,000,000	258,581,766	17.48	33.69	3	
威靈頓	200,000,000	264,488,262	19.75	36.08	1	
合計	1,000,000,000	1,297,858,980	18.13	33.10	—	

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 8 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (112.7.19~113.8.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標/目標 報酬率(%)
盧米斯	400,000,000	436,336,121	5.74	10.49	1	5.94/8.75
Ninety One	400,000,000	434,109,394	5.22	8.95	3	
PIMCO	400,000,000	431,458,557	4.03	8.06	4	
PGIM	400,000,000	427,049,511	5.08	9.11	2	
T. Rowe Price	400,000,000	403,924,197	1.67	1.69	6	
威靈頓	400,000,000	417,220,530	3.67	5.87	5	
合計	2,400,000,000	2,550,098,310	4.25	7.38	—	

註：本批次為絕對報酬型，契約目標報酬率係以 US 3-Month T-Bill(指標報酬率)加計 250 個基本點為基準。

112-1 全球被動股票型

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	113 年截至 8 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (113.6.27~113.8.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
Amundi	100,000,000	103,933,070	3.93	3.93	3	4.00
LGIM	100,000,000	103,956,329	3.96	3.96	2	
道富	100,000,000	103,966,251	3.97	3.97	1	
北美信託	100,000,000	103,922,144	3.92	3.92	4	
合計	400,000,000	415,777,794	3.94	3.94	—	

2. 舊制勞工退休基金

96 國際平衡型(續約 4)

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	113 年截至 8 月 累積投資報酬率(%)	委任迄今 (113.6.24~113.8.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
富達	753,144,454	804,326,161	6.80	6.80	—	3.63

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 8 月 累積投資報酬率(%)	委任迄今 (111.1.6~113.8.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
PIMCO	1,003,724,736	916,978,825	1.39	-8.64	1	-9.97
盧米斯	1,018,693,762	925,859,642	1.48	-10.27	2	
合計	2,022,418,498	1,842,838,467	1.46	-9.42	—	

97-1 全球增值股票型(續約 3)

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	113 年截至 8 月 累積投資報酬率(%)	委任迄今 (111.2.6~113.8.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
貝萊德	1,156,987,544	1,468,066,599	17.44	26.89	—	21.42

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 8 月 累積投資報酬率(%)	委任迄今 (111.11.17~113.8.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
景順	231,124,998	281,427,028	9.74	19.38	—	21.15

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 8 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (111.3.6~113.8.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
貝萊德	304,997,166	390,574,193	13.24	28.06	3	26.78
道富	360,436,214	463,141,209	13.56	28.49	1	
瑞銀	308,879,836	396,667,145	13.33	28.42	2	
Nomura	360,147,608	460,572,844	13.13	27.88	4	
合計	1,334,460,824	1,710,955,391	13.32	28.21	—	

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 8 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (112.4.18~113.8.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
貝萊德	751,993,706	892,434,425	14.87	18.68	—	17.85

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 8 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (113.1.22~113.8.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
瑞萬通博	414,056,068	456,540,002	10.26	10.26	3	13.67
MFS	315,296,707	365,394,690	15.89	15.89	1	
威靈頓	704,502,354	798,574,273	13.35	13.35	2	
合計	1,433,855,129	1,620,508,965	13.02	13.02	—	

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 8 月 累積投資報酬 (%)	委任迄今 (113.5.29~113.8.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
Lazard	954,418,976	1,036,767,037	8.63	8.63	—	11.16

102-2 全球不動產有價證券型（續約 2）

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	113 年截至 8 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (113.8.27~113.8.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
信安環球	708,888,643	711,975,776	0.44	0.44	1	0.41
Macquarie	144,937,350	145,233,572	0.20	0.20	2	
合計	853,825,993	857,209,348	0.40	0.40	—	

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 8 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (110.7.20~113.8.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標/目標 報酬率(%)
Allianz	155,447,975	164,361,006	8.39	5.73	3	10.83/26.43
摩根	594,592,070	635,883,593	9.87	6.94	2	
DWS	311,387,682	345,171,240	6.73	10.85	1	
柏瑞	254,823,294	248,358,129	5.15	-2.54	4	
合計	1,316,251,021	1,393,773,968	8.05	5.89	—	

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 8 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (111.6.22~113.8.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
貝萊德	127,303,524	174,468,323	12.54	37.05	4	37.25
DWS	147,528,441	206,049,784	13.56	39.67	2	
道富	157,982,595	220,884,761	13.57	39.82	1	
北美信託	158,484,700	218,334,125	13.18	37.76	3	
合計	591,299,260	819,736,993	13.24	38.63	—	

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 8 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (111.7.25~113.8.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標/目標 報酬率(%)
American Century	319,635,794	355,199,729	4.17	11.13	3	10.31/15.58
富達	299,785,344	355,288,421	5.71	18.51	1	
TCW	328,000,470	368,771,125	4.93	12.43	2	
合計	947,421,608	1,079,259,275	4.93	13.92	—	

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 8 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (113.1.23~113.8.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標/目標 報酬率(%)
景順	116,977,839	131,947,072	12.80	12.80	2	3.16/6.20
威靈頓	107,476,614	120,928,076	12.52	12.52	3	
CPR	115,110,097	132,654,674	15.24	15.24	1	
合計	339,564,550	385,529,822	13.54	13.54	—	

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 8 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (110.9.8~113.8.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
CBRE	60,000,000	65,748,077	9.88	10.88	3	13.53
ClearBridge	60,000,000	66,385,894	9.05	13.54	1	
Magellan	30,000,000	32,155,636	8.88	7.19	4	
RREEF	60,000,000	66,486,933	13.76	12.15	2	
合計	210,000,000	230,776,540	10.34	10.91	—	

(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8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8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8月份	-1,783,914,910	75,116,896,033	76,900,810,943

(二)舊制勞工退休基金

單位：新臺幣元

	餘絀	收入	支出
113年8月份	2,822,326,848	2,970,650,946	148,324,098

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 8 月份		單位：新臺幣元
項 目	金 額	
現金收入	125,760,744,430	
現金支出	132,127,757,999	
現金增(減)數		-6,367,013,569

(二)舊制勞工退休基金

113 年 8 月份		單位：新臺幣元
項 目	金 額	
現金收入	28,753,726,810	
現金支出	28,753,736,216	
現金增(減)數		-9,406