

# 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(105年8月)績效

| 基金別  | 收益率   | 台灣 10 年期<br>公債殖利率 | 台灣<br>加權股價指數 | MSCI<br>全球股票指數 | Barclays<br>全球債券指數 |
|------|-------|-------------------|--------------|----------------|--------------------|
| 新制基金 | 3.49% | 0.81%             | 8.76%        | 5.95%          | 9.25%              |
| 舊制基金 | 3.47% |                   |              |                |                    |

註：股債指數係依據勞動部 103 年 12 月 15 日勞動福 4 字第 1030136646 號函核定之勞動基金投資政策書所載參考指標。

### (二) 近一年(104年)績效

| 基金別  | 收益率    | 台灣 10 年期<br>公債殖利率 | 台灣<br>加權股價指數 | MSCI<br>全球股票指數 | Barclays<br>全球債券指數 |
|------|--------|-------------------|--------------|----------------|--------------------|
| 新制基金 | -0.09% | 1.38%             | -10.41%      | -2.36%         | -3.15%             |
| 舊制基金 | -0.58% |                   |              |                |                    |

### (三) 近三年(102~104年)績效

| 基金別  | 收益率   | 台灣 10 年期<br>公債殖利率 | 台灣<br>加權股價指數 | MSCI<br>全球股票指數 | Barclays<br>全球債券指數 |
|------|-------|-------------------|--------------|----------------|--------------------|
| 新制基金 | 3.64% | 1.48%             | 2.69%        | 7.69%          | -1.74%             |
| 舊制基金 | 4.35% |                   |              |                |                    |

### (四) 近五年(100~104年)績效

| 基金別  | 收益率   | 台灣 10 年期<br>公債殖利率 | 台灣<br>加權股價指數 | MSCI<br>全球股票指數 | Barclays<br>全球債券指數 |
|------|-------|-------------------|--------------|----------------|--------------------|
| 新制基金 | 2.85% | 1.41%             | -1.46%       | 6.09%          | 0.90%              |
| 舊制基金 | 2.88% |                   |              |                |                    |

## 二、基金運用概況表

### (一) 基金規模與投資績效

#### 1. 新制勞工退休基金

| 至 105 年 8 月底止基金規模與收益          |      |                         |
|-------------------------------|------|-------------------------|
| 基金運用規模                        |      | 1 兆 6,220 億 7,671 萬元    |
| 105 年截至 8 月底止<br>運用總損益及評價後報酬率 | 自行運用 | 118 億 1,253 萬元<br>1.57% |
|                               | 委託經營 | 429 億 6,051 萬元<br>5.26% |
|                               | 合 計  | 547 億 7,304 萬元<br>3.49% |

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÷105 年之日平均餘額）列示。

註 3：105 年 8 月之保證收益率為 1.0541%。

#### 2. 舊制勞工退休基金

| 至 105 年 8 月底止基金規模與收益          |      |                         |
|-------------------------------|------|-------------------------|
| 基金運用規模                        |      | 7,983 億 8,405 萬元        |
| 105 年截至 8 月底止<br>運用總損益及評價後報酬率 | 自行運用 | 117 億 1,663 萬元<br>3.07% |
|                               | 委託經營 | 121 億 7,327 萬元<br>3.96% |
|                               | 合 計  | 238 億 8,990 萬元<br>3.47% |

註：評價後報酬率係以當期報酬率（即收益÷105 年之日平均餘額）列示。

## (二) 資產配置

### 1. 新制勞工退休基金

截至 105 年 8 月底

單位：新台幣元

| 項 目             | 餘 額                      | 占基金運用比例(%)    |
|-----------------|--------------------------|---------------|
| <b>自行運用</b>     | <b>792,013,564,596</b>   | <b>48.83</b>  |
| 轉存金融機構          | 343,052,513,136          | 21.15         |
| 短期票券            | 56,056,323,961           | 3.46          |
| 公債、公司債、金融債券及特別股 | 161,125,474,769          | 9.93          |
| 貨幣型基金           | 2,516,446,952            | 0.16          |
| 股票及受益憑證投資(含期貨)  | 53,351,921,576           | 3.29          |
| 國外投資            | 175,910,884,202          | 10.84         |
| 固定收益            | 135,508,167,282          | 8.35          |
| 權益證券            | 25,074,855,542           | 1.55          |
| 另類投資            | 15,327,861,378           | 0.94          |
| <b>委託經營</b>     | <b>830,063,140,782</b>   | <b>51.17</b>  |
| 國內委託經營          | 225,280,036,514          | 13.89         |
| 國外委託經營          | 604,783,104,268          | 37.28         |
| 固定收益            | 171,442,510,199          | 10.57         |
| 權益證券            | 300,975,364,135          | 18.55         |
| 另類投資            | 132,365,229,934          | 8.16          |
| <b>合 計</b>      | <b>1,622,076,705,378</b> | <b>100.00</b> |

## 2. 舊制勞工退休基金

截至 105 年 8 月底

單位：新台幣元

| 項 目               | 餘 額                    | 占基金運用比例(%)    |
|-------------------|------------------------|---------------|
| <b>自行運用</b>       | <b>475,803,230,694</b> | <b>59.60</b>  |
| 轉存金融機構            | 170,463,467,841        | 21.35         |
| 短期票券              | 35,052,759,297         | 4.39          |
| 公債、金融債券、公司債及證券化商品 | 97,601,240,243         | 12.22         |
| 貨幣型基金             | 8,589,983,674          | 1.08          |
| 股票及受益憑證投資(含期貨)    | 57,718,270,665         | 7.24          |
| 國外投資              | 106,377,508,974        | 13.32         |
| 固定收益              | 70,375,421,027         | 8.81          |
| 權益證券              | 28,416,244,493         | 3.56          |
| 另類投資              | 7,585,843,454          | 0.95          |
| <b>委託經營</b>       | <b>322,580,817,327</b> | <b>40.40</b>  |
| 國內委託經營            | 94,245,727,375         | 11.81         |
| 國外委託經營            | 228,335,089,952        | 28.59         |
| 固定收益              | 65,888,924,638         | 8.25          |
| 權益證券              | 132,091,774,636        | 16.54         |
| 另類投資              | 30,354,390,678         | 3.80          |
| <b>合 計</b>        | <b>798,384,048,021</b> | <b>100.00</b> |

### (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 105 年 8 月底

單位：新台幣元

| 項 目  | 金 額             | 占基金運用比例(%) |
|------|-----------------|------------|
| 自行運用 | 792,013,564,596 | 48.83      |
| 委託經營 | 830,063,140,782 | 51.17      |

#### 2. 舊制勞工退休基金

截至 105 年 8 月底

單位：新台幣元

| 項 目  | 金 額             | 占基金運用比例(%) |
|------|-----------------|------------|
| 自行運用 | 475,803,230,694 | 59.60      |
| 委託經營 | 322,580,817,327 | 40.40      |

## (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 105 年 8 月底

單位：新台幣元

| 項 目  | 金 額             | 占基金運用比例 (%) |
|------|-----------------|-------------|
| 國內投資 | 841,382,716,908 | 51.87       |
| 國外投資 | 780,693,988,470 | 48.13       |

### 2. 舊制勞工退休基金

截至 105 年 8 月底

單位：新台幣元

| 項 目  | 金 額             | 占基金運用比例 (%) |
|------|-----------------|-------------|
| 國內投資 | 463,671,449,094 | 58.09       |
| 國外投資 | 334,712,598,927 | 41.91       |

## 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 105 年 8 月底

| 項 目    | 收益率 (%) |
|--------|---------|
| 國內權益證券 | 14.33   |

#### 2. 舊制勞工退休基金

截至 105 年 8 月底

| 項 目    | 收益率 (%) |
|--------|---------|
| 國內權益證券 | 16.96   |

## (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 105 年 8 月底 單位：新台幣元

| 項 目    | 金 額            | 比 例 (%) |
|--------|----------------|---------|
| 國內權益證券 | 53,351,921,576 | 3.29    |

### 2. 舊制勞工退休基金

截至 105 年 8 月底 單位：新台幣元

| 項 目    | 金 額            | 比 例 (%) |
|--------|----------------|---------|
| 國內權益證券 | 57,718,270,665 | 7.24    |

註：不含貨幣型基金

## 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 2)

單位：新台幣元

| 投信<br>名稱 | 委託金額          | 目前淨資產         | 105 年截至 8 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(102.9.27~105.8.31) |            |              |
|----------|---------------|---------------|--------------------------|-----------------------------|------------|--------------|
|          |               |               |                          | 投資<br>報酬率(%)                | 委託經<br>營排名 | 大盤<br>報酬率(%) |
| 野村       | 7,804,845,205 | 9,908,954,931 | 8.72                     | 26.96                       | —          | 10.80        |

### 97 年第一次委託經營 (續約 2)

單位：新台幣元

| 投信名稱 | 委託金額          | 目前淨資產         | 105 年截至 8 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(103.1.20~105.8.31) |            |              |
|------|---------------|---------------|--------------------------|-----------------------------|------------|--------------|
|      |               |               |                          | 投資<br>報酬率(%)                | 委託經<br>營排名 | 大盤<br>報酬率(%) |
| 野村   | 5,783,138,827 | 7,160,001,690 | 8.84                     | 23.81                       | —          | 5.50         |

### 98 年第一次委託經營 (續約 2)

單位：新台幣元

| 投信名稱 | 委託金額           | 目前淨資產          | 105 年截至 8 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(104.7.14~105.8.31) |            |              |
|------|----------------|----------------|--------------------------|-----------------------------|------------|--------------|
|      |                |                |                          | 投資<br>報酬率(%)                | 委託經<br>營排名 | 大盤<br>報酬率(%) |
| 野村   | 10,576,888,916 | 10,762,259,491 | 8.65                     | 1.75                        | 2          | 0.39         |
| 保德信  | 4,365,128,502  | 4,605,371,488  | 10.26                    | 5.50                        | 1          |              |
| 合計   | 14,942,017,418 | 15,367,630,979 | 9.12                     | 2.85                        | —          |              |

### 99 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         | 105 年截至 8 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(103.12.1~105.8.31) |            |              |
|------|---------------|---------------|--------------------------|-----------------------------|------------|--------------|
|      |               |               |                          | 投資<br>報酬率(%)                | 委託經<br>營排名 | 大盤<br>報酬率(%) |
| 國泰   | 6,366,621,977 | 6,883,853,335 | 4.68                     | 8.12                        | —          | -1.29        |

### 100 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          | 105 年截至 8 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(104.7.15~105.8.31) |            |                 |
|------|----------------|----------------|--------------------------|-----------------------------|------------|-----------------|
|      |                |                |                          | 投資<br>報酬率(%)                | 委託經<br>營排名 | 大盤/指標<br>報酬率(%) |
| 復華   | 14,358,076,699 | 14,995,183,737 | 10.02                    | 4.44                        | 1          | 0.30/<br>5.06   |
| 滙豐中華 | 15,278,501,877 | 15,956,411,135 | 9.50                     | 4.44                        | 1          |                 |
| 合計   | 29,636,578,576 | 30,951,594,872 | 9.75                     | 4.44                        | —          |                 |

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；以就業 99 指數為指定指標。

## 100 年第二次委託經營(續約)

單位：新台幣元

| 投信<br>名稱 | 委託金額           | 目前淨資產          | 105 年截至 8 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(104.8.10~105.8.31) |            |              |
|----------|----------------|----------------|--------------------------|-----------------------------|------------|--------------|
|          |                |                |                          | 投資<br>報酬率(%)                | 委託經<br>營排名 | 大盤<br>報酬率(%) |
| 復華       | 17,101,520,990 | 17,983,467,096 | 6.99                     | 5.16                        | —          | 7.42         |

## 101 年第一次委託經營(續約) (相對報酬)

單位：新台幣元

| 投信<br>名稱 | 委託金額           | 目前淨資產          | 105 年截至 8 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(105.4.18~105.8.31) |            |                 |
|----------|----------------|----------------|--------------------------|-----------------------------|------------|-----------------|
|          |                |                |                          | 投資<br>報酬率(%)                | 委託經<br>營排名 | 大盤/指標<br>報酬率(%) |
| 國泰       | 5,387,135,656  | 5,858,638,525  | 8.75                     | 8.75                        | 2          | 4.23/<br>8.19   |
| 滙豐中華     | 10,927,481,593 | 11,920,868,573 | 9.09                     | 9.09                        | 1          |                 |
| 合計       | 16,314,617,249 | 17,779,507,098 | 8.98                     | 8.98                        | —          |                 |

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。

## 101 年第二次委託經營(續約)

單位：新台幣元

| 投信<br>名稱 | 委託金額           | 目前淨資產          | 105 年截至 8 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(105.7.18~105.8.31) |            |              |
|----------|----------------|----------------|--------------------------|-----------------------------|------------|--------------|
|          |                |                |                          | 投資<br>報酬率(%)                | 委託經<br>營排名 | 大盤<br>報酬率(%) |
| 野村       | 6,850,998,495  | 6,946,094,693  | 1.39                     | 1.39                        | 2          | 1.33         |
| 統一       | 7,019,680,328  | 7,186,333,443  | 2.37                     | 2.37                        | 1          |              |
| 合計       | 13,870,678,823 | 14,132,428,136 | 1.89                     | 1.89                        | —          |              |



## 102 年第一次委託經營第一期

單位：新台幣元

| 投信<br>名稱 | 委託金額           | 目前淨資產          | 105 年截至 8 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(102.6.7~105.8.31) |            |              |
|----------|----------------|----------------|--------------------------|----------------------------|------------|--------------|
|          |                |                |                          | 投資<br>報酬率(%)               | 委託經<br>營排名 | 大盤<br>報酬率(%) |
| 國泰       | 2,500,000,000  | 2,981,562,727  | 6.27                     | 19.26                      | 2          | 12.01        |
| 統一       | 2,500,000,000  | 2,896,556,156  | 2.34                     | 15.86                      | 3          |              |
| 復華       | 2,500,000,000  | 3,088,293,810  | 7.38                     | 23.53                      | 1          |              |
| 安聯       | 2,500,000,000  | 2,893,851,749  | 5.87                     | 15.75                      | 4          |              |
| 合計       | 10,000,000,000 | 11,860,264,442 | 5.47                     | 18.60                      | —          |              |

## 102 年第一次委託經營第二期

單位：新台幣元

| 投信<br>名稱 | 委託金額           | 目前淨資產          | 105 年截至 8 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(102.11.22~105.8.31) |            |              |
|----------|----------------|----------------|--------------------------|------------------------------|------------|--------------|
|          |                |                |                          | 投資<br>報酬率(%)                 | 委託經<br>營排名 | 大盤<br>報酬率(%) |
| 國泰       | 2,500,000,000  | 2,750,190,043  | 6.08                     | 10.01                        | 3          | 11.97        |
| 統一       | 2,500,000,000  | 2,702,897,293  | 2.18                     | 8.12                         | 5          |              |
| 復華       | 2,500,000,000  | 3,017,412,685  | 7.33                     | 20.70                        | 1          |              |
| 安聯       | 2,500,000,000  | 2,833,554,317  | 6.38                     | 13.34                        | 2          |              |
| 摩根       | 2,500,000,000  | 2,724,260,556  | 7.20                     | 8.97                         | 4          |              |
| 合計       | 12,500,000,000 | 14,028,314,894 | 5.84                     | 12.23                        | —          |              |

## 102 年第二次委託經營(相對報酬)

單位：新台幣元

| 投信<br>名稱 | 委託金額           | 目前淨資產          | 105 年截至 8 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(103.1.20~105.8.31) |            |                 |
|----------|----------------|----------------|--------------------------|-----------------------------|------------|-----------------|
|          |                |                |                          | 投資<br>報酬率(%)                | 委託經<br>營排名 | 大盤/指標<br>報酬率(%) |
| 保德信      | 5,000,000,000  | 5,484,431,460  | 11.62                    | 14.88                       | 5          | 5.50/<br>17.32  |
| 統一       | 5,000,000,000  | 5,547,063,955  | 9.74                     | 16.05                       | 3          |                 |
| 富邦       | 5,000,000,000  | 5,311,444,651  | 7.21                     | 10.48                       | 6          |                 |
| 復華       | 5,000,000,000  | 5,808,216,891  | 13.61                    | 23.41                       | 1          |                 |
| 群益       | 5,000,000,000  | 5,408,562,771  | 8.47                     | 15.42                       | 4          |                 |
| 滙豐中華     | 5,000,000,000  | 5,657,630,930  | 13.53                    | 18.62                       | 2          |                 |
| 合計       | 30,000,000,000 | 33,217,350,658 | 10.71                    | 16.48                       | —          |                 |

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。

## 103 年第一次委託經營第一期

單位：新台幣元

| 投信<br>名稱 | 委託金額           | 目前淨資產          | 105 年截至 8 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(103.8.11~105.8.31) |            |              |
|----------|----------------|----------------|--------------------------|-----------------------------|------------|--------------|
|          |                |                |                          | 投資<br>報酬率(%)                | 委託經<br>營排名 | 大盤<br>報酬率(%) |
| 國泰       | 7,000,000,000  | 7,494,370,799  | 8.77                     | 7.06                        | 1          | -0.19        |
| 統一       | 7,000,000,000  | 6,715,023,148  | 3.50                     | -4.07                       | 3          |              |
| 復華       | 7,000,000,000  | 6,936,446,949  | 6.76                     | -0.91                       | 2          |              |
| 合計       | 21,000,000,000 | 21,145,840,896 | 6.39                     | 0.69                        | —          |              |

## 103 年第一次委託經營第二期

單位：新台幣元

| 投信<br>名稱 | 委託金額           | 目前淨資產          | 105 年截至 8 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(103.10.8~105.8.31) |            |              |
|----------|----------------|----------------|--------------------------|-----------------------------|------------|--------------|
|          |                |                |                          | 投資<br>報酬率(%)                | 委託經<br>營排名 | 大盤<br>報酬率(%) |
| 台新       | 7,000,000,000  | 7,445,867,695  | 8.85                     | 6.37                        | 1          | 0.31         |
| 保德信      | 7,000,000,000  | 7,257,561,242  | 7.12                     | 3.68                        | 2          |              |
| 群益       | 7,000,000,000  | 6,984,291,593  | 7.13                     | -0.22                       | 3          |              |
| 合計       | 21,000,000,000 | 21,687,720,530 | 7.71                     | 3.27                        | —          |              |

## 104 年第一次委託經營第一期

單位：新台幣元

| 投信名稱 | 委託金額           | 目前淨資產          | 105 年截至 8 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(104.3.31~105.8.31) |            |              |
|------|----------------|----------------|--------------------------|-----------------------------|------------|--------------|
|      |                |                |                          | 投資<br>報酬率(%)                | 委託經<br>營排名 | 大盤<br>報酬率(%) |
| 永豐   | 2,500,000,000  | 2,520,551,150  | 6.09                     | 0.82                        | 4          | -4.76        |
| 國泰   | 2,500,000,000  | 2,531,809,698  | 4.99                     | 1.27                        | 3          |              |
| 統一   | 2,500,000,000  | 2,536,387,194  | 7.00                     | 1.46                        | 2          |              |
| 復華   | 2,500,000,000  | 2,411,840,163  | 7.05                     | -3.53                       | 6          |              |
| 滙豐中華 | 2,500,000,000  | 2,551,257,741  | 7.88                     | 2.05                        | 1          |              |
| 安聯   | 2,500,000,000  | 2,502,370,997  | 6.86                     | 0.09                        | 5          |              |
| 合計   | 15,000,000,000 | 15,054,216,943 | 6.63                     | 0.36                        | —          |              |

## 2. 舊制勞工退休基金

## 國內 98 年第二次委託經營(續 2)

單位：新台幣元

| 投信名稱 | 委託金額          | 目前淨資產          | 105 年截至 8 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(105.1.26~105.8.31) |            |              |
|------|---------------|----------------|--------------------------|-----------------------------|------------|--------------|
|      |               |                |                          | 投資<br>報酬率(%)                | 委託經<br>營排名 | 大盤<br>報酬率(%) |
| 富邦   | 4,927,262,338 | 5,204,697,448  | 5.63                     | 5.63                        | 2          | 14.88        |
| 統一   | 5,071,927,246 | 5,426,752,341  | 7.00                     | 7.00                        | 1          |              |
| 合計   | 9,999,189,584 | 10,631,449,789 | 6.32                     | 6.32                        | —          |              |

## 國內 100 年第一次委託經營(續)

單位：新台幣元

| 投信名稱 | 委託金額           | 目前淨資產          | 105 年截至 8 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(104.3.17~105.8.31) |            |              |
|------|----------------|----------------|--------------------------|-----------------------------|------------|--------------|
|      |                |                |                          | 投資<br>報酬率(%)                | 委託經<br>營排名 | 大盤<br>報酬率(%) |
| 群益   | 6,094,525,480  | 5,672,922,763  | 5.54                     | -6.92                       | 3          | -4.67        |
| 復華   | 6,134,978,456  | 6,146,905,369  | 6.49                     | 0.19                        | 1          |              |
| 統一   | 6,511,946,664  | 6,241,002,547  | 4.15                     | -4.16                       | 2          |              |
| 合計   | 18,741,450,600 | 18,060,830,679 | 5.38                     | -3.63                       | —          |              |

### 國內 101 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         | 105 年截至 8 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(101.10.30~105.8.31) |            |                 |
|------|---------------|---------------|--------------------------|------------------------------|------------|-----------------|
|      |               |               |                          | 投資<br>報酬率(%)                 | 委託經<br>營排名 | 大盤/指標<br>報酬率(%) |
| 匯豐中華 | 2,163,012,619 | 2,756,825,041 | 12.99                    | 45.03                        | —          | 27.88/46.39     |

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)

單位：新台幣元

| 投信名稱 | 委託金額           | 目前淨資產          | 105 年截至 8 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(105.5.3~105.8.31) |            |              |
|------|----------------|----------------|--------------------------|----------------------------|------------|--------------|
|      |                |                |                          | 投資<br>報酬率(%)               | 委託經<br>營排名 | 大盤<br>報酬率(%) |
| 野村   | 16,650,814,154 | 17,768,221,547 | 6.71                     | 6.71                       | —          | 8.25         |

### 國內 102 年第一次委託經營第一期

單位：新台幣元

| 投信名稱 | 委託金額           | 目前淨資產          | 105 年截至 8 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(102.6.7~105.8.31) |            |              |
|------|----------------|----------------|--------------------------|----------------------------|------------|--------------|
|      |                |                |                          | 投資<br>報酬率(%)               | 委託經<br>營排名 | 大盤<br>報酬率(%) |
| 安聯   | 2,500,000,000  | 2,894,146,084  | 5.88                     | 15.77                      | 4          | 12.01        |
| 復華   | 5,000,000,000  | 5,661,297,148  | 6.65                     | 22.71                      | 1          |              |
| 國泰   | 2,500,000,000  | 2,981,858,143  | 6.27                     | 19.27                      | 2          |              |
| 統一   | 2,500,000,000  | 2,896,896,367  | 2.35                     | 15.88                      | 3          |              |
| 合計   | 12,500,000,000 | 14,434,197,742 | 5.23                     | 18.35                      | —          |              |

## 國內 102 年第一次委託經營第二期

單位：新台幣元

| 投信名稱 | 委託金額           | 目前淨資產          | 105 年截至 8 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(102.11.22~105.8.31) |            |              |
|------|----------------|----------------|--------------------------|------------------------------|------------|--------------|
|      |                |                |                          | 投資<br>報酬率(%)                 | 委託經<br>營排名 | 大盤<br>報酬率(%) |
| 安聯   | 2,500,000,000  | 2,833,827,619  | 6.39                     | 13.35                        | 2          | 11.97        |
| 復華   | 5,000,000,000  | 5,590,229,291  | 6.62                     | 19.90                        | 1          |              |
| 國泰   | 2,500,000,000  | 2,750,422,621  | 6.08                     | 10.02                        | 3          |              |
| 摩根   | 2,500,000,000  | 2,724,553,794  | 7.20                     | 8.98                         | 4          |              |
| 統一   | 2,500,000,000  | 2,703,189,032  | 2.18                     | 8.13                         | 5          |              |
| 合計   | 15,000,000,000 | 16,602,222,357 | 5.55                     | 11.93                        | —          |              |

## 國內 102 年第一次委託經營 A 帳戶

單位：新台幣元

| 投信名稱 | 委託金額          | 目前淨資產         | 105 年截至 8 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(104.3.16~105.8.31) |            |              |
|------|---------------|---------------|--------------------------|-----------------------------|------------|--------------|
|      |               |               |                          | 投資<br>報酬率(%)                | 委託經<br>營排名 | 大盤<br>報酬率(%) |
| 統一   | 5,118,273,278 | 4,877,429,483 | 3.57                     | -4.71                       | -          | -5.33        |

## 國內 104 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          | 105 年截至 8 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(104.3.31~105.8.31) |            |              |
|------|----------------|----------------|--------------------------|-----------------------------|------------|--------------|
|      |                |                |                          | 投資<br>報酬率(%)                | 委託經<br>營排名 | 大盤<br>報酬率(%) |
| 永豐   | 2,500,000,000  | 2,520,639,620  | 6.09                     | 0.83                        | 4          | -4.76        |
| 國泰   | 2,500,000,000  | 2,531,901,104  | 4.99                     | 1.28                        | 3          |              |
| 統一   | 2,500,000,000  | 2,536,490,070  | 7.00                     | 1.46                        | 2          |              |
| 復華   | 2,500,000,000  | 2,411,898,334  | 7.05                     | -3.52                       | 6          |              |
| 匯豐中華 | 2,500,000,000  | 2,551,386,009  | 7.88                     | 2.06                        | 1          |              |
| 安聯   | 2,500,000,000  | 2,502,472,051  | 6.86                     | 0.10                        | 5          |              |
| 合計   | 15,000,000,000 | 15,054,787,188 | 6.64                     | 0.37                        | —          |              |

## (二) 105 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 全球債券型 (續約 2)

單位：美元

| 投信名稱 | 委託金額          | 目前淨資產         | 105 年截至 8 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(105.6.6~105.8.31) |    |              |
|------|---------------|---------------|--------------------------|----------------------------|----|--------------|
|      |               |               |                          | 投資<br>報酬率(%)               | 排名 | 指標<br>報酬率(%) |
| 聯博   | 793,101,125   | 810,299,481   | 2.17                     | 2.17                       | 1  | 1.50         |
| 坦伯頓  | 744,405,663   | 758,596,131   | 1.91                     | 1.91                       | 2  |              |
| 合計   | 1,537,506,788 | 1,568,895,612 | 2.04                     | 2.04                       | —  |              |

### 97-2 全球增值債券型 (續約)

單位：美元

| 投信名稱 | 委託金額          | 目前淨資產         | 105年截至8月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(102.1.7~105.8.31) |    |              |
|------|---------------|---------------|-----------------------|----------------------------|----|--------------|
|      |               |               |                       | 投資<br>報酬率(%)               | 排名 | 指標<br>報酬率(%) |
| 太平洋  | 615,416,988   | 657,089,878   | 9.55                  | 6.77                       | 1  | 4.85         |
| 高盛   | 479,694,715   | 492,523,229   | 9.07                  | 2.67                       | 2  |              |
| 合計   | 1,095,111,703 | 1,149,613,107 | 9.34                  | 4.98                       | —  |              |

### 97-2 全球增值股票型 (續約)

單位：美元

| 投信名稱 | 委託金額          | 目前淨資產         | 105年截至8月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(102.2.5~105.8.31) |    |              |
|------|---------------|---------------|-----------------------|----------------------------|----|--------------|
|      |               |               |                       | 投資<br>報酬率(%)               | 排名 | 指標<br>報酬率(%) |
| 貝萊德  | 584,277,868   | 712,918,576   | 3.58                  | 32.71                      | 1  | 26.88        |
| 摩根   | 587,857,352   | 755,386,459   | 5.18                  | 28.50                      | 2  |              |
| 合計   | 1,172,135,220 | 1,468,305,035 | 4.40                  | 30.02                      | —  |              |

### 98-1 亞太 (日本除外) 股票型 (續約)

單位：美元

| 投信名稱 | 委託金額        | 目前淨資產       | 105年截至8月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(102.11.18~105.8.31) |    |              |
|------|-------------|-------------|-----------------------|------------------------------|----|--------------|
|      |             |             |                       | 投資<br>報酬率(%)                 | 排名 | 指標<br>報酬率(%) |
| 景順   | 571,501,358 | 605,561,301 | 13.63                 | 8.09                         | —  | 2.29         |

### 98-1 全球被動股票型 (續約)

單位：美元

| 投信名稱 | 委託金額        | 目前淨資產       | 105年截至8月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(102.12.2~105.8.31) |    |              |
|------|-------------|-------------|-----------------------|-----------------------------|----|--------------|
|      |             |             |                       | 投資<br>報酬率(%)                | 排名 | 指標<br>報酬率(%) |
| 貝萊德  | 299,329,552 | 330,780,242 | 6.19                  | 10.51                       | 1  | 9.61         |
| 道富   | 449,680,272 | 487,975,851 | 6.02                  | 10.43                       | 2  |              |
| 合計   | 749,009,824 | 818,756,093 | 6.09                  | 10.46                       | —  |              |

### 99-1 全球新興市場股票型 (續約)

單位：美元

| 投信名稱  | 委託金額          | 目前淨資產         | 105年截至8月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(103.8.25~105.8.31) |    |              |
|-------|---------------|---------------|-----------------------|-----------------------------|----|--------------|
|       |               |               |                       | 投資<br>報酬率(%)                | 排名 | 指標<br>報酬率(%) |
| 摩根士丹利 | 403,049,882   | 354,224,927   | 12.57                 | -12.11                      | 2  | -12.87       |
| 瑞萬通博  | 716,993,858   | 694,858,051   | 13.68                 | -3.09                       | 1  |              |
| 合計    | 1,120,043,740 | 1,049,082,978 | 13.30                 | -6.34                       | —  |              |

### 100-1 全球基本面指數被動股票型 (續約)

單位：美元

| 投信名稱 | 委託金額          | 目前淨資產         | 105年截至8月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(105.7.1~105.8.31) |    |              |
|------|---------------|---------------|-----------------------|----------------------------|----|--------------|
|      |               |               |                       | 投資<br>報酬率(%)               | 排名 | 指標<br>報酬率(%) |
| 道富   | 562,180,574   | 592,697,173   | 5.43                  | 5.43                       | 2  | 5.63         |
| 貝萊德  | 566,301,910   | 597,810,742   | 5.56                  | 5.56                       | 1  |              |
| 合計   | 1,128,482,484 | 1,190,507,915 | 5.50                  | 5.50                       | —  |              |

### 100-1 全球不動產股票型

單位：美元

| 投信名稱           | 委託金額          | 目前淨資產         | 105年截至8月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(101.3.6~105.8.31) |    |              |
|----------------|---------------|---------------|-----------------------|----------------------------|----|--------------|
|                |               |               |                       | 投資<br>報酬率(%)               | 排名 | 指標<br>報酬率(%) |
| Cohen & Steers | 750,000,000   | 983,693,198   | 9.57                  | 56.26                      | 1  | 45.51        |
| 景順             | 800,000,000   | 1,024,192,229 | 9.80                  | 49.56                      | 2  |              |
| 合計             | 1,550,000,000 | 2,007,885,427 | 9.69                  | 52.55                      | —  |              |



### 101-1 全球新興市場債券型

單位：美元

| 投信名稱    | 委託金額          | 目前淨資產         | 105年截至8月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(101.7.31~105.8.31) |    |              |
|---------|---------------|---------------|-----------------------|-----------------------------|----|--------------|
|         |               |               |                       | 投資<br>報酬率(%)                | 排名 | 指標<br>報酬率(%) |
| Ashmore | 300,000,000   | 288,868,511   | 10.05                 | -0.55                       | 2  | 1.05         |
| Bluebay | 300,000,000   | 278,496,921   | 9.00                  | -5.15                       | 3  |              |
| 實港      | 300,000,000   | 276,301,161   | 9.62                  | -6.16                       | 4  |              |
| Pictet  | 300,000,000   | 293,059,254   | 10.04                 | -0.41                       | 1  |              |
| 合計      | 1,200,000,000 | 1,136,725,847 | 9.69                  | -3.07                       | —  |              |

### 101-1 全球低波動指數被動股票型

單位：美元

| 投信名稱 | 委託金額          | 目前淨資產         | 105年截至8月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(102.4.18~105.8.31) |    |              |
|------|---------------|---------------|-----------------------|-----------------------------|----|--------------|
|      |               |               |                       | 投資<br>報酬率(%)                | 排名 | 指標<br>報酬率(%) |
| 道富   | 500,000,000   | 591,707,083   | 10.22                 | 18.07                       | 1  | 17.04        |
| 貝萊德  | 500,000,000   | 588,426,302   | 10.06                 | 17.39                       | 2  |              |
| 合計   | 1,000,000,000 | 1,180,133,385 | 10.14                 | 17.73                       | —  |              |

### 102-1 全球高股利增值股票型

單位：美元

| 投信名稱 | 委託金額          | 目前淨資產         | 105年截至8月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(103.1.22~105.8.31) |    |              |
|------|---------------|---------------|-----------------------|-----------------------------|----|--------------|
|      |               |               |                       | 投資<br>報酬率(%)                | 排名 | 指標<br>報酬率(%) |
| 瑞萬通博 | 500,000,000   | 594,273,051   | 7.52                  | 22.26                       | 1  | 5.53         |
| MFS  | 500,000,000   | 510,950,243   | 6.20                  | 5.71                        | 3  |              |
| 威靈頓  | 500,000,000   | 530,612,265   | 8.15                  | 10.32                       | 2  |              |
| 合計   | 1,500,000,000 | 1,635,835,559 | 7.31                  | 12.79                       | —  |              |

### 102-1 全球信用債券型

單位：美元

| 投信名稱    | 委託金額          | 目前淨資產         | 105年截至8月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(103.4.25~105.8.31) |    |              |
|---------|---------------|---------------|-----------------------|-----------------------------|----|--------------|
|         |               |               |                       | 投資<br>報酬率(%)                | 排名 | 指標<br>報酬率(%) |
| Bluebay | 400,000,000   | 408,652,454   | 9.27                  | 2.41                        | 3  | 4.06         |
| 貝萊德     | 400,000,000   | 416,991,850   | 8.88                  | 4.44                        | 2  |              |
| 盧米斯     | 400,000,000   | 418,961,955   | 9.56                  | 4.96                        | 1  |              |
| 合計      | 1,200,000,000 | 1,244,606,258 | 9.23                  | 3.94                        | —  |              |

### 104-1 全球高品質被動股票型

單位：美元

| 投信名稱  | 委託金額          | 目前淨資產         | 105年截至8月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(104.8.11~105.8.31) |    |                 |
|-------|---------------|---------------|-----------------------|-----------------------------|----|-----------------|
|       |               |               |                       | 投資<br>報酬率(%)                | 排名 | 大盤/指標<br>報酬率(%) |
| 北美信託  | 500,000,000   | 536,430,002   | 6.75                  | 4.71                        | 1  | 4.60            |
| LGIM  | 500,000,000   | 536,626,855   | 6.84                  | 4.56                        | 3  |                 |
| Geode | 500,000,000   | 536,342,293   | 6.77                  | 4.59                        | 2  |                 |
| 合計    | 1,500,000,000 | 1,609,399,150 | 6.79                  | 4.62                        | —  |                 |

### 104-2 全球基礎建設股票型

單位：美元

| 投信名稱           | 委託金額          | 目前淨資產         | 105年截至8月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(104.9.25~105.8.31) |    |              |
|----------------|---------------|---------------|-----------------------|-----------------------------|----|--------------|
|                |               |               |                       | 投資<br>報酬率(%)                | 排名 | 指標<br>報酬率(%) |
| Cohen & Steers | 350,000,000   | 375,319,428   | 12.73                 | 7.09                        | 4  | 11.93        |
| 麥格理            | 350,000,000   | 385,877,761   | 15.66                 | 12.16                       | 3  |              |
| Magellan       | 350,000,000   | 368,715,296   | 8.53                  | 13.17                       | 2  |              |
| RREEF          | 350,000,000   | 381,750,186   | 15.46                 | 13.23                       | 1  |              |
| 合計             | 1,400,000,000 | 1,511,662,671 | 13.09                 | 11.48                       | —  |              |

### 104-1 全球主權信用增值債券型

單位：美元

| 投信名稱       | 委託金額        | 目前淨資產       | 105年截至8月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(104.11.13~105.8.31) |    |              |
|------------|-------------|-------------|-----------------------|------------------------------|----|--------------|
|            |             |             |                       | 投資<br>報酬率(%)                 | 排名 | 指標<br>報酬率(%) |
| NNIP       | 100,000,000 | 108,306,893 | 9.34                  | 8.31                         | 3  | 9.57         |
| Brandywine | 100,000,000 | 112,203,816 | 13.09                 | 12.20                        | 1  |              |
| 盧米斯        | 100,000,000 | 109,246,706 | 10.07                 | 9.25                         | 2  |              |
| 合計         | 300,000,000 | 329,757,415 | 10.83                 | 9.92                         | —  |              |

### 105-1 全球多元資產型

單位：美元

| 投信名稱 | 委託金額        | 目前淨資產       | 105年截至8月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(105.7.20~105.8.31) |    |              |
|------|-------------|-------------|-----------------------|-----------------------------|----|--------------|
|      |             |             |                       | 投資<br>報酬率(%)                | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| 安聯   | 225,000,000 | 226,367,431 | 0.61                  | 0.61                        | 2  | 0.09         |
| 摩根   | 225,000,000 | 227,230,563 | 0.99                  | 0.99                        | 1  |              |
| 德意志  | 225,000,000 | 226,217,171 | 0.54                  | 0.54                        | 3  |              |
| 柏瑞   | 225,000,000 | 224,628,476 | -0.17                 | -0.17                       | 4  |              |
| 合計   | 900,000,000 | 904,443,641 | 0.49                  | 0.49                        | —  |              |

### 105-1 亞太混合指數增值股票型

單位：美元

| 投信名稱 | 委託金額        | 目前淨資產       | 105年截至8月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(105.8.24~105.8.31) |    |              |
|------|-------------|-------------|-----------------------|-----------------------------|----|--------------|
|      |             |             |                       | 投資<br>報酬率(%)                | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| 貝萊德  | 150,000,000 | 148,567,206 | -0.96                 | -0.96                       | 1  | -1.02        |
| 北美信託 | 150,000,000 | 147,907,710 | -1.39                 | -1.39                       | 3  |              |
| 領航   | 150,000,000 | 148,244,462 | -1.17                 | -1.17                       | 2  |              |
| 合計   | 450,000,000 | 444,719,377 | -1.17                 | -1.17                       | —  |              |

## 2. 舊制勞工退休基金

### 96年續約2國外委託經營(平衡型)

單位：美元

| 投信名稱 | 委託金額        | 目前淨資產       | 105年截至8月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(104.6.22~105.8.31) |    |              |
|------|-------------|-------------|-----------------------|-----------------------------|----|--------------|
|      |             |             |                       | 投資<br>報酬率(%)                | 排名 | 指標<br>報酬率(%) |
| 富達國際 | 783,555,210 | 809,952,648 | 7.50                  | 4.58                        | -  | 3.02         |

### 97年續約國外委託經營(全球增值債券型)

單位：美元

| 投信名稱 | 委託金額          | 目前淨資產         | 105年截至8月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(102.1.6~105.8.31) |    |              |
|------|---------------|---------------|-----------------------|----------------------------|----|--------------|
|      |               |               |                       | 投資<br>報酬率(%)               | 排名 | 指標<br>報酬率(%) |
| 太平洋  | 931,384,466   | 979,892,000   | 9.81                  | 6.38                       | 1  | 4.85         |
| 盧米斯  | 712,476,555   | 741,273,522   | 9.33                  | 4.04                       | 2  |              |
| 合計   | 1,643,861,021 | 1,721,165,522 | 9.59                  | 5.24                       | -  |              |

### 97年續約國外委託經營(全球增值股票型)

單位：美元

| 投信名稱 | 委託金額        | 目前淨資產       | 105年截至8月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(102.2.5~105.8.31) |    |              |
|------|-------------|-------------|-----------------------|----------------------------|----|--------------|
|      |             |             |                       | 投資<br>報酬率(%)               | 排名 | 指標<br>報酬率(%) |
| 貝萊德  | 584,953,368 | 713,308,278 | 3.53                  | 32.74                      | -  | 26.88        |

### 98年續約國外委託經營(亞太股票型)

單位：美元

| 投信名稱 | 委託金額        | 目前淨資產       | 105年截至8月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(102.11.17~105.8.31) |    |              |
|------|-------------|-------------|-----------------------|------------------------------|----|--------------|
|      |             |             |                       | 投資<br>報酬率(%)                 | 排名 | 指標<br>報酬率(%) |
| 景順   | 362,187,756 | 385,426,014 | 13.65                 | 8.59                         | -  | 2.29         |

### 100 年國外委託經營(全球基本面指數股票型)

單位：美元

| 投信名稱 | 委託金額          | 目前淨資產         | 105 年截至 8 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(101.3.6~105.8.31) |    |              |
|------|---------------|---------------|--------------------------|----------------------------|----|--------------|
|      |               |               |                          | 投資<br>報酬率(%)               | 排名 | 指標<br>報酬率(%) |
| 貝萊德  | 300,000,000   | 365,286,395   | 6.80                     | 36.08                      | 4  | 35.34        |
| 道富   | 300,000,000   | 368,126,004   | 6.75                     | 37.40                      | 1  |              |
| 瑞銀   | 300,000,000   | 366,595,743   | 7.13                     | 36.80                      | 3  |              |
| 野村   | 300,000,000   | 367,347,591   | 7.12                     | 37.12                      | 2  |              |
| 合計   | 1,200,000,000 | 1,467,355,733 | 6.95                     | 36.85                      | —  |              |

### 101 年國外委託經營(全球低波動指數股票型)

單位：美元

| 投信名稱 | 委託金額        | 目前淨資產       | 105 年截至 8 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(102.6.13~105.8.31) |    |              |
|------|-------------|-------------|--------------------------|-----------------------------|----|--------------|
|      |             |             |                          | 投資<br>報酬率(%)                | 排名 | 指標<br>報酬率(%) |
| 貝萊德  | 500,000,000 | 571,909,336 | 10.12                    | 21.98                       | —  | 21.27        |

### 102 年國外委託經營(全球高股利增值股票型)

單位：美元

| 投信名稱 | 委託金額        | 目前淨資產       | 105 年截至 8 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(103.1.22~105.8.31) |    |              |
|------|-------------|-------------|--------------------------|-----------------------------|----|--------------|
|      |             |             |                          | 投資<br>報酬率(%)                | 排名 | 指標<br>報酬率(%) |
| 瑞萬通博 | 150,000,000 | 182,155,951 | 7.51                     | 22.32                       | 1  | 5.53         |
| MFS  | 200,000,000 | 208,456,783 | 5.85                     | 5.53                        | 3  |              |
| 威靈頓  | 400,000,000 | 422,845,419 | 7.95                     | 10.24                       | 2  |              |
| 合計   | 750,000,000 | 813,458,153 | 7.08                     | 12.65                       | —  |              |

### 102 年國外委託經營(全球基礎建設有價證券型)

單位：美元

| 投信名稱           | 委託金額        | 目前淨資產       | 105 年截至 8 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(103.5.29~105.8.31) |    |              |
|----------------|-------------|-------------|--------------------------|-----------------------------|----|--------------|
|                |             |             |                          | 投資<br>報酬率(%)                | 排名 | 指標<br>報酬率(%) |
| Lazard         | 300,000,000 | 321,469,794 | 10.90                    | 10.69                       | 1  | 0.94         |
| Cohen & Steers | 100,000,000 | 96,586,539  | 12.86                    | -2.48                       | 2  |              |
| 合計             | 400,000,000 | 418,056,333 | 11.48                    | 3.96                        | —  |              |

### 102 年國外委託經營(全球不動產有價證券型)

單位：美元

| 投信名稱 | 委託金額        | 目前淨資產       | 105 年截至 8 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(103.8.27~105.8.31) |    |              |
|------|-------------|-------------|--------------------------|-----------------------------|----|--------------|
|      |             |             |                          | 投資<br>報酬率(%)                | 排名 | 指標<br>報酬率(%) |
| PGI  | 150,000,000 | 167,609,674 | 8.29                     | 12.43                       | 1  | 11.78        |
| AMP  | 100,000,000 | 107,406,616 | 4.26                     | 6.94                        | 2  |              |
| 合計   | 250,000,000 | 275,016,290 | 6.68                     | 10.11                       | —  |              |

### 105 年國外委託經營(全球多元資產型)

單位：美元

| 投信名稱 | 委託金額        | 目前淨資產       | 105 年截至 8 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(105.7.20~105.8.31) |    |              |
|------|-------------|-------------|--------------------------|-----------------------------|----|--------------|
|      |             |             |                          | 投資<br>報酬率(%)                | 排名 | 指標<br>報酬率(%) |
| 安聯   | 75,000,000  | 75,471,072  | 0.63                     | 0.63                        | 2  | 0.09         |
| 摩根   | 75,000,000  | 75,727,772  | 0.97                     | 0.97                        | 1  |              |
| 德意志  | 75,000,000  | 75,416,896  | 0.56                     | 0.56                        | 3  |              |
| 柏瑞   | 75,000,000  | 74,883,539  | -0.16                    | -0.16                       | 4  |              |
| 合計   | 300,000,000 | 301,499,279 | 0.50                     | 0.50                        | —  |              |

## (二)105年8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)

105年8月31日

#### 1. 避險：

| 種類     | 避險比例  |
|--------|-------|
| 權益證券避險 | 0%    |
| 匯率避險   | 6.49% |

#### 2. 投資：無

### (二)舊制勞工退休基金自營部位

(依交易目的)

105年8月31日

#### 1. 避險：

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

#### 2. 投資：無

## 七、勞工退休基金財務收支表

### (一)新制勞工退休基金

單位：新台幣元

|        | 餘絀          | 營業收入           | 營業支出           |
|--------|-------------|----------------|----------------|
| 105年8月 | 168,142,875 | 11,146,541,507 | 10,978,398,632 |

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          | 營業收入          | 營業支出          |
|--------|-------------|---------------|---------------|
| 105年8月 | 187,378,138 | 2,226,738,902 | 2,039,360,764 |

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

105年8月份

單位：新台幣元

| 項 目     | 金 額             |
|---------|-----------------|
| 基金收入    | 272,563,724,149 |
| 基金支出    | 264,094,501,324 |
| 現金增(減)數 | 8,469,222,825   |

註：本表採現金基礎。

### (二)舊制勞工退休基金

105年8月份

單位：新台幣元

| 項 目     | 金 額            |
|---------|----------------|
| 基金收入    | 45,772,698,805 |
| 基金支出    | 45,772,479,560 |
| 現金增(減)數 | 219,245        |

註：本表採現金基礎。