

勞工退休基金運用情形

一、勞工退休基金整體績效

(一) 115 年截至 8 月底績效

基金與指標	新制基金	舊制基金	臺灣 10 年期 公債殖利率	臺灣加權 股價指數	MSCI 全球 股票指數	Bloomberg 全球債券指數
收益率/報酬率	29.25%	42.09%	1.61%	59.26%	14.31%	-0.30%

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(114 年)績效

基金與指標	新制基金	舊制基金	臺灣 10 年期 公債殖利率	臺灣加權 股價指數	MSCI 全球 股票指數	Bloomberg 全球債券指數
收益率/報酬率	15.60%	22.53%	1.47%	25.74%	22.34%	8.17%

(三) 近三年(112~114 年)平均績效

基金與指標	新制基金	舊制基金	臺灣 10 年期 公債殖利率	臺灣加權 股價指數	MSCI 全球 股票指數	Bloomberg 全球債券指數
收益率/報酬率	14.91%	19.00%	1.40%	27.01%	20.65%	3.98%

(四) 近五年(110~114 年)平均績效

基金與指標	新制基金	舊制基金	臺灣 10 年期 公債殖利率	臺灣加權 股價指數	MSCI 全球 股票指數	Bloomberg 全球債券指數
收益率/報酬率	10.28%	12.12%	1.17%	14.48%	11.19%	-2.15%

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

115 年 8 月底止基金規模與收益			
基金運用規模			5 兆 9,785 億 4,343 萬元
115 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	111 億 5,969 萬元 1.84%
		國內權益證券 及國外投資	4,219 億 629 萬元 37.77%
	委託經營		1 兆 1,905 億 6,078 萬元 33.81%
	合 計		1 兆 6,236 億 2,676 萬元 29.25%

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 3：115 年 8 月之保證收益率為 1.7108%。

2. 舊制勞工退休基金

115 年 8 月底止基金規模與收益			
基金運用規模			12,030 億 6,513 萬元
115 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	35 億 9,721 萬元 1.73%
		國內權益證券 及國外投資	1,704 億 4,288 萬元 97.34%
	委託經營		2,183 億 668 萬元 35.57%
	合 計		3,923 億 4,677 萬元 42.09%

註：評價後報酬率係以當期報酬率（即收益÷115 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

115 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	2,063,615,764,168	34.52
轉存金融機構	484,632,062,355	8.11
短期票券	154,840,949,506	2.59
公債、公司債、金融債券及特別股	254,658,621,638	4.26
股票及受益憑證投資(含期貨)	316,654,621,891	5.30
國外投資	852,829,508,778	14.26
固定收益	724,461,087,908	12.12
權益證券	82,763,581,167	1.38
另類投資	45,604,839,703	0.76
委託經營	3,914,927,660,923	65.48
國內委託經營	1,197,514,153,024	20.03
國外委託經營	2,717,413,507,899	45.45
固定收益	591,163,249,008	9.89
權益證券	1,563,192,121,075	26.14
另類投資	563,058,137,816	9.42
合 計	5,978,543,425,091	100.00

2. 舊制勞工退休基金

115 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	561,545,393,270	46.68
轉存金融機構	273,630,108,744	22.74
短期票券	75,730,003,405	6.30
公債、金融債券、公司債及證券化商品	84,270,515,805	7.00
股票及受益憑證投資(含期貨)	80,897,733,770	6.73
國外投資	47,017,031,546	3.91
固定收益	25,870,844,377	2.15
權益證券	21,146,187,169	1.76
另類投資	0	0.00
委託經營	641,519,733,404	53.32
國內委託經營	179,152,414,930	14.89
國外委託經營	462,367,318,474	38.43
固定收益	107,811,891,675	8.96
權益證券	242,570,109,923	20.16
另類投資	111,985,316,876	9.31
合 計	1,203,065,126,674	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

115 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	2,063,615,764,168	34.52
委託經營	3,914,927,660,923	65.48

2. 舊制勞工退休基金

115 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	561,545,393,270	46.68
委託經營	641,519,733,404	53.32

(四)基金國內投資與國外投資比率

1. 新制勞工退休基金

115 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	2,408,300,408,414	40.29
國 外 投 資	3,570,243,016,677	59.71

2. 舊制勞工退休基金

115 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	693,680,776,654	57.66
國 外 投 資	509,384,350,020	42.34

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

115 年截至 8 月底

項 目	收益率(%)
國內權益證券	130.99

2. 舊制勞工退休基金

115 年截至 8 月底

項 目	收益率(%)
國內權益證券	148.92

(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

115 年 8 月 31 日

單位：新臺幣元

項 目	金 額	比 率 (%)
國內權益證券	316,654,621,891	5.30

2. 舊制勞工退休基金

115 年 8 月 31 日

單位：新臺幣元

項 目	金 額	比 率 (%)
國內權益證券	80,897,733,770	6.73

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 6)

單位：新臺幣元

投信 名稱	委託金額	目前淨資產	115 年截至 8 月 累積投資報酬 (%)	委任迄今 (114.9.27~115.8.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	目標報酬率 (%)
野村	53,037,175,831	131,295,249,313	107.64	147.55	—	5.80

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 300 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	115 年截至 8 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (112.1.30~115.8.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	目標報酬率 (%)
野村	6,829,066,771	28,945,859,286	102.40	323.86	—	21.62

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。

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	115 年截至 8 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (113.7.16~115.8.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	目標報酬率 (%)
野村	25,455,695,879	72,345,554,361	100.98	184.20	1	12.46
玉山	7,430,070,832	14,896,602,228	58.64	100.49	2	
合計	32,885,766,711	87,242,156,589	92.22	165.29	—	

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。

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	115 年截至 8 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (111.12.5~115.8.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	目標報酬率 (%)
國泰	10,445,113,310	30,272,112,263	81.27	189.82	—	22.58

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	115 年截至 8 月 累積投資報酬 (%)	委任迄今 (112.7.15~115.8.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
復華	29,101,525,086	89,073,113,838	83.68	206.08	—	192.74

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	115 年截至 8 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (113.7.20~115.8.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	目標報酬率 (%)
野村	15,198,354,580	52,444,842,279	119.37	245.07	1	12.39
統一	20,913,151,881	46,315,207,979	67.32	121.46	2	
合計	36,111,506,461	98,760,050,258	91.44	173.49	—	

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 3) (相對報酬)

單位：新臺幣元

投信 名稱	委託金額	目前淨資產	115 年截至 8 月 累積投資報酬 (%)	委任迄今 (115.1.24~115.8.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
統一	37,517,851,631	61,515,786,308	63.96	63.96	1	46.36
復華	39,053,243,767	61,116,322,916	56.49	56.49	2	
合計	76,571,095,398	122,632,109,224	60.15	60.15	—	

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	115 年截至 8 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (111.10.11~115.8.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	目標報酬率 (%)
台新	15,841,461,125	46,531,529,917	65.21	193.73	—	23.50

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 2) (相對報酬)

單位：新臺幣元

投信 名稱	委託金額	目前淨資產	115 年截至 8 月 累積投資報酬 (%)	委任迄今 (114.12.1~115.8.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
國泰	23,658,255,796	42,974,248,851	72.15	81.65	1	75.92
統一	20,210,724,588	35,903,069,239	68.38	77.64	5	
復華	19,554,752,074	35,279,643,743	69.99	80.41	3	
滙豐	16,812,903,049	29,877,197,749	68.49	77.70	4	
安聯	24,098,049,298	43,591,301,080	71.68	80.89	2	
合計	104,334,684,805	187,625,460,662	70.32	79.83	—	

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	115 年截至 8 月 累積投資報酬 (%)	委任迄今 (112.4.6~115.8.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	目標報酬率 (%)
復華	4,799,121,512	14,884,833,807	74.69	210.16	1	20.47
安聯	3,601,238,896	8,789,605,075	51.25	144.07	2	
合計	8,400,360,408	23,674,438,882	65.18	181.83	—	

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	115 年截至 8 月 累積投資報酬 (%)	委任迄今 (112.2.7~115.8.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	目標報酬率 (%)
安聯	15,088,712,403	50,771,177,760	70.89	243.13	1	21.48
國泰	5,018,453,600	14,312,952,245	73.23	163.20	3	
群益	6,382,621,945	15,279,052,882	55.55	139.39	4	
滙豐	7,096,535,878	19,706,122,817	77.53	177.69	2	
合計	33,586,323,826	100,069,305,704	69.91	195.65	—	

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	115 年截至 8 月 累積投資報酬 (%)	委任迄今 (112.10.24~115.8.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
台新	8,254,694,051	27,620,326,545	69.63	234.60	7	235.71
安聯	12,775,472,416	44,009,858,884	74.79	244.49	4	
玉山	9,403,481,285	32,517,210,660	71.59	245.80	3	
統一	12,635,490,783	42,818,475,870	73.38	238.87	6	
國泰	10,445,956,159	36,750,872,629	75.11	251.82	2	
復華	7,235,716,436	24,682,847,745	72.56	241.13	5	
群益	4,439,275,178	15,816,536,859	75.59	256.29	1	
合計	65,190,086,308	224,216,129,192	73.26	243.94	—	

註：1.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	115 年截至 8 月 累積投資報酬 (%)	委任迄今 (113.5.24~115.8.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	目標報酬率 (%)
安聯	13,613,817,760	34,549,877,118	70.07	154.95	4	13.35
施羅德	11,400,361,947	37,022,292,862	100.28	224.75	2	
統一	13,638,402,860	33,625,784,029	72.69	147.32	6	
野村	20,601,693,072	73,879,997,576	119.16	260.56	1	
國泰	19,457,627,824	49,975,642,929	92.83	156.84	3	
復華	9,724,896,734	24,396,971,507	74.87	150.87	5	
合計	88,436,800,197	253,450,566,021	92.22	187.67	—	

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（續約）

單位：新臺幣元

投信 名稱	委託金額	目前淨資產	115 年截至 8 月 累積投資報酬 (%)	委任迄今 (115.5.31~115.8.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	目標報酬率 (%)
台新	17,743,902,371	18,727,863,428	5.55	5.55	2	1.89
安聯	25,118,214,883	25,971,349,161	3.40	3.40	4	
玉山	18,706,659,825	18,699,763,809	-0.04	-0.04	5	
國泰	23,159,171,521	24,364,459,351	5.20	5.20	3	
野村	34,803,007,809	38,933,092,424	11.87	11.87	1	
合計	119,530,956,409	126,696,528,173	5.99	5.99	—	

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 300 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	115 年截至 8 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (111.5.13~115.8.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
安聯	3,000,000,000	7,761,837,386	52.45	149.57	2	145.36
玉山	3,000,000,000	7,666,300,351	47.54	148.45	3	
野村	3,000,000,000	7,724,080,509	45.21	144.84	5	
國泰	3,000,000,000	7,902,740,243	46.55	152.94	1	
富邦	3,000,000,000	7,748,837,585	49.98	146.30	4	
合計	15,000,000,000	38,803,796,074	48.30	148.43	—	

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	115 年截至 8 月 累積投資報酬 (%)	委任迄今 (110.12.15~115.8.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	目標報酬率 (%)
安聯	8,000,000,000	24,224,834,632	70.95	211.83	4	28.57
玉山	8,000,000,000	19,219,973,338	58.39	144.98	6	
國泰	8,000,000,000	24,570,018,459	94.19	222.29	2	
第一金	8,000,000,000	19,854,566,007	88.66	147.68	5	
野村	8,000,000,000	31,434,344,914	108.59	296.61	1	
富邦	8,000,000,000	25,091,454,446	77.41	219.76	3	
合計	48,000,000,000	144,395,191,796	83.49	207.26	—	

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	115 年截至 8 月 累積投資報酬 (%)	委任迄今 (112.10.5~115.8.31)		
				投資 報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
安聯	7,000,000,000	14,133,982,001	50.63	130.46	6	17.29
施罗德	7,000,000,000	22,660,503,311	96.31	273.07	2	
國泰	7,000,000,000	17,678,683,542	77.54	200.60	3	
第一金	7,000,000,000	17,589,517,587	85.89	147.77	5	
野村	7,000,000,000	25,283,605,176	119.53	307.80	1	
華南 永昌	7,000,000,000	10,889,639,888	48.18	67.30	7	
滙豐	7,000,000,000	16,452,459,633	75.00	161.36	4	
合計	49,000,000,000	124,688,391,138	81.73	183.47	—	

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。

112 年第一次委託經營（相對報酬）

單位：新臺幣元

投信 名稱	委託金額	目前淨資產	115 年截至 8 月 累積投資報酬 (%)	委任迄今 (114.4.1~115.8.31)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標報酬率 (%)
安聯	9,000,000,000	14,732,259,184	70.33	172.68	1	132.19
兆豐 國際	9,000,000,000	13,537,552,457	57.27	138.72	6	
宏利	9,000,000,000	13,984,059,027	67.82	144.69	2	
施羅德	9,000,000,000	13,949,037,170	66.08	139.04	4	
野村	9,000,000,000	13,898,271,601	65.28	139.03	5	
摩根	9,000,000,000	13,943,010,448	64.83	142.51	3	
合計	54,000,000,000	84,044,189,887	65.29	146.10	—	

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。

113 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	115 年截至 8 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (114.11.14~115.8.31)		
				投資 報酬率(%)	排名	目標報酬率 (%)
安聯	9,000,000,000	14,022,640,413	60.30	67.49	5	4.97
貝萊德	9,000,000,000	14,558,557,114	69.78	76.04	4	
施羅德	9,000,000,000	16,409,783,221	84.40	96.50	1	
野村	9,000,000,000	15,802,586,707	84.39	93.08	2	
摩根	9,000,000,000	14,767,488,219	71.12	77.74	3	
合計	45,000,000,000	75,561,055,674	74.05	82.17	—	

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 300 個基本點為基準。

114 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	115 年截至 8 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (115.6.9~115.8.31)		
				投資 報酬率(%)	排名	目標報酬率 (%)
元大	5,000,000,000	5,191,420,651	0.33	0.33	2	1.43
安聯	5,000,000,000	5,277,089,640	-3.96	-3.96	5	
施罗德	5,000,000,000	5,793,806,236	-1.50	-1.50	4	
野村	5,000,000,000	5,706,018,434	-0.66	-0.66	3	
摩根	5,000,000,000	5,596,824,881	1.44	1.44	1	
合計	25,000,000,000	27,565,159,842	-0.63	-0.63	—	

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 300 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 5)

單位：新臺幣元

投信 名稱	委託金額	目前淨資產	115 年截至 8 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (114.1.28~115.8.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	目標報酬率 (%)
富邦	15,603,507,854	38,523,549,736	80.99	146.89	1	10.00
統一	13,492,877,440	31,506,916,668	74.10	133.51	2	
合計	29,096,385,294	70,030,466,404	77.82	140.68	—	

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 300 個基本點為基準。

國內 101 年第一次委託經營(相對報酬)(續約 3)

單位：新臺幣元

投信 名稱	委託金額	目前淨資產	115 年截至 8 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (113.11.2~115.8.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
滙豐	6,530,798,735	14,445,581,832	64.77	121.19	—	111.89

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	115 年截至 8 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (113.05.04~115.8.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	目標報酬率 (%)
野村	27,357,530,009	101,691,766,200	117.10	271.71	—	13.68

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。

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	115 年截至 8 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (112.4.6~115.8.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	目標報酬率 (%)
復華	4,800,107,976	14,886,892,642	74.67	210.14	1	20.47
安聯	2,601,947,821	7,757,776,290	50.52	142.90	2	
合計	7,402,055,797	22,644,668,932	64.80	181.17	—	

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	115 年截至 8 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (112.2.7~115.8.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	目標報酬率 (%)
安聯	15,089,937,312	50,775,773,672	70.89	243.13	1	21.48
國泰	3,019,107,110	12,207,646,533	73.07	162.96	3	
群益	4,384,957,618	13,267,835,617	55.49	139.37	4	
滙豐	5,597,524,598	18,069,233,307	77.11	177.04	2	
合計	28,091,526,638	94,320,489,129	69.56	195.07	—	

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 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	115 年截至 8 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (112.10.5~115.8.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	目標報酬率 (%)
安聯	3,000,000,000	6,032,526,706	52.04	134.23	6	17.29
施羅德	3,000,000,000	9,541,399,095	96.43	274.99	2	
國泰	3,000,000,000	7,530,376,964	77.82	206.24	3	
第一金	3,000,000,000	7,703,418,466	85.90	148.98	5	
野村	3,000,000,000	10,620,801,400	119.13	305.63	1	
華南 永昌	3,000,000,000	4,736,028,698	48.19	71.41	7	
滙豐	3,000,000,000	6,965,496,135	75.03	163.26	4	
合計	21,000,000,000	53,130,047,464	81.79	185.77	—	

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。

(二) 115 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：

投信名稱	收回日期	收回委託金額	經理人	收回理由
109-2 安聯	115.8.11	10 億元	張○○等	衡酌資產配置之需，依委託經營投資契約第 25 條規定，收回全數委託資產。
109-2 玉山		10 億元	連○○等	
109-2 野村		10 億元	賴○○等	
109-2 國泰		10 億元	唐○○等	
109-2 富邦		10 億元	溫○○等	

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 4）

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	115 年截至 8 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (115.6.7~115.8.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
聯博	900,495,639	901,079,345	0.06	0.06	2	-0.05
坦伯頓	1,338,657,958	1,340,532,856	0.14	0.14	1	
合計	2,239,153,597	2,241,612,201	0.11	0.11	—	

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	115 年截至 8 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (111.1.6~115.8.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
PIMCO	2,558,967,886	2,526,946,832	-1.77	-4.44	—	-7.09

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	115 年截至 8 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (111.2.6~115.8.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
貝萊德	2,034,805,538	3,696,336,168	19.78	92.49	1	72.02
JPMorgan	1,585,120,883	2,716,470,918	13.67	73.53	2	
合計	3,619,926,421	6,412,807,086	17.03	83.72	—	

98-1 亞太（日本除外）股票型（續約 3） 單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	115 年截至 8 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (111.11.17~115.8.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
景順	656,507,639	1,336,860,928	21.06	103.63	—	94.19

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	115 年截至 8 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (111.12.4~115.8.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
貝萊德	1,321,092,316	2,414,233,497	14.79	93.51	2	92.05
道富	1,783,655,177	3,256,489,722	14.45	94.54	1	
合計	3,104,747,493	5,670,723,219	14.60	94.09	—	

100-1 全球基本面指數股票型（續約 3） 單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	115 年截至 8 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (115.7.1~115.8.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
道富	1,683,240,295	1,752,353,167	4.11	4.11	1	4.18
貝萊德	1,687,228,552	1,751,287,343	3.80	3.80	2	
合計	3,370,468,847	3,503,640,510	3.95	3.95	—	

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	115 年截至 8 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (111.3.6~115.8.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
Cohen & Steers	2,555,932,432	2,848,023,524	8.05	9.46	1	6.39
景順	1,417,127,452	1,507,978,389	9.61	4.97	2	
合計	3,973,059,884	4,356,001,913	8.61	7.74	—	

101-1 全球新興市場債券型（續約 2）

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	115 年截至 8 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (111. 7. 31~115. 8. 31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
Pictet	618, 843, 493	775, 171, 961	-0. 95	25. 84	—	28. 36

101-1 全球低波動指數股票型（續約 2）

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	115 年截至 8 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (112. 4. 18~115. 8. 31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
道富	1, 263, 392, 347	1, 712, 693, 938	8. 15	38. 23	2	37. 11
貝萊德	1, 352, 011, 599	1, 830, 792, 196	8. 11	38. 44	1	
合計	2, 615, 403, 946	3, 543, 486, 134	8. 13	38. 34	—	

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	115 年截至 8 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (113. 1. 22~115. 8. 31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
瑞萬通博	1, 796, 000, 834	2, 067, 584, 920	0. 70	15. 73	3	53. 36
MFS	1, 164, 480, 846	1, 797, 726, 702	19. 11	55. 09	1	
威靈頓	1, 507, 914, 919	2, 310, 037, 806	15. 38	54. 07	2	
合計	4, 468, 396, 599	6, 175, 349, 428	10. 97	38. 93	—	

102-1 全球信用債券型（續約 2）

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	115 年截至 8 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (113.4.25~115.8.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
RBC	1,186,559,371	1,359,557,078	-0.76	15.20	1	14.40
貝萊德	670,392,768	764,677,694	-0.56	14.06	3	
盧米斯	941,561,542	1,071,245,991	-0.44	14.12	2	
合計	2,798,513,681	3,195,480,763	-0.60	14.55	—	

104-1 全球高品質被動股票型（續約 2）

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	115 年截至 8 月 累積投資報酬 (%)	委任迄今 (114.8.11~115.8.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
北美信託	3,222,313,413	3,997,930,675	12.91	24.13	1	24.86
L&G	3,208,355,339	3,955,468,695	12.29	23.35	3	
Geode	3,189,006,741	3,946,610,359	12.67	23.81	2	
合計	9,619,675,493	11,900,009,729	12.62	23.76	—	

104-2 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	115 年截至 8 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (114.9.25~115.8.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
Magellan	1,159,305,130	1,293,678,966	7.50	11.59	1	10.37
RREEF	1,668,471,152	1,797,336,875	6.76	7.72	2	
合計	2,827,776,282	3,091,015,841	7.07	9.31	—	

104-1 全球主權信用增值債券型（續約 2）

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	115 年截至 8 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (114.11.13~115.8.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率(%)
盧米斯	819,799,803	815,896,860	-1.43	-0.48	—	-0.72

105-1 全球多元資產型（續約 2）

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	115 年截至 8 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (115.7.20~115.8.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標/目標 報酬率(%)
Allianz	1,187,189,098	1,231,663,818	3.75	3.75	1	0.43/1.02
JPMorgan	1,826,834,228	1,878,093,691	2.81	2.81	2	
DWS	1,511,379,825	1,545,955,332	2.29	2.29	3	
合計	4,525,403,151	4,655,712,841	2.88	2.88	—	

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 2）

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	115 年截至 8 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (115.8.24~115.8.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
貝萊德	1,707,512,798	1,715,405,818	0.46	0.46	—	0.45

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	115 年截至 8 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (111.6.22~115.8.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
貝萊德	641,552,002	1,220,326,622	23.19	98.36	4	97.65
DWS	848,715,051	1,567,126,369	22.72	102.11	1	
道富	849,045,562	1,587,306,347	22.78	101.98	2	
北美信託	762,047,560	1,452,471,596	22.76	99.81	3	
合計	3,101,360,175	5,827,230,934	22.85	100.64	—	

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	115 年截至 8 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (111.7.25~115.8.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標/目標 報酬率(%)
American Century	427,360,620	525,529,138	2.29	22.97	3	19.30/29.57
富達	905,211,657	1,168,816,199	2.10	27.77	1	
TCW	1,039,618,153	1,292,125,290	2.22	24.27	2	
合計	2,372,190,430	2,986,470,627	2.19	25.52	—	

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	115 年截至 8 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (113.1.23~115.8.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標/目標 報酬率(%)
景順	1,006,698,949	1,535,900,143	15.27	61.40	1	11.56/24.60
威靈頓	867,219,463	1,159,978,150	6.61	36.91	4	
CPR	938,885,217	1,354,927,450	16.02	49.94	2	
道富	806,462,703	1,156,758,978	9.66	48.91	3	
合計	3,619,266,332	5,207,564,721	12.18	49.58	—	

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。

108-1 全球新興市場動態多元因子指數增值股票型（續約）

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	115 年截至 8 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (113.12.18~115.8.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
Nomura	559,865,985	795,687,952	11.62	42.82	1	46.25
荷寶	506,416,368	706,823,715	10.71	40.71	3	
道富	441,937,598	625,971,021	9.92	41.64	2	
合計	1,508,219,951	2,128,482,688	10.81	41.78	—	

109-1 全球美元公司增值債券型（續約）

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	115 年截至 8 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (115.1.13~115.8.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
Insight	1,059,063,706	1,053,509,055	-0.48	-0.48	2	-0.30
JPMorgan	558,802,476	556,587,232	-0.34	-0.34	1	
PIMCO	674,765,647	670,818,582	-0.55	-0.55	3	
合計	2,292,631,829	2,280,914,869	-0.47	-0.47	—	

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	115 年截至 8 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (110.9.8~115.8.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
CBRE	430,000,000	569,783,360	7.90	36.53	3	37.36
Clearbridge	700,000,000	943,529,926	10.96	50.23	1	
Magellan	350,000,000	475,922,222	5.42	33.93	4	
RREEF	430,000,000	574,043,538	10.08	37.16	2	
合計	1,910,000,000	2,563,279,046	8.88	39.96	—	

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	115 年截至 8 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (110.10.15~115.8.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標/目標 報酬率(%)
富達	400,000,000	526,718,108	13.75	31.14	2	19.85/44.26
JPMorgan	400,000,000	498,259,486	5.38	24.34	5	
Ninety One	400,000,000	502,875,307	5.31	25.05	4	
Schroders	400,000,000	547,910,625	9.58	36.41	1	
T. Rowe Price	400,000,000	522,845,162	9.89	29.17	3	
合計	2,000,000,000	2,598,608,688	8.77	29.23	—	

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	115 年截至 8 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (112.4.28~115.8.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
滙豐	400,000,000	632,835,390	14.55	86.42	2	78.86
L&G	400,000,000	612,888,370	11.83	78.51	3	
摩根士丹利	400,000,000	618,383,558	12.26	78.26	4	
Schroders	400,000,000	598,887,884	11.61	75.43	5	
威靈頓	400,000,000	633,942,676	13.06	87.12	1	
合計	2,000,000,000	3,096,937,878	12.67	81.15	—	

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	115 年截至 8 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (112.7.19~115.8.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標/目標 報酬率(%)
盧米斯	600,000,000	690,022,244	1.27	21.38	2	14.58/22.39
Ninety One	500,000,000	588,217,306	1.82	20.24	4	
PIMCO	500,000,000	593,879,746	1.24	21.03	3	
PGIM	600,000,000	691,679,256	3.12	21.85	1	
T. Rowe Price	500,000,000	559,691,663	2.94	12.98	6	
威靈頓	500,000,000	575,697,957	3.46	17.92	5	
合計	3,200,000,000	3,699,188,172	2.28	19.24	—	

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	115 年截至 8 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (113.6.27~115.8.31)		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率(%)
Amundi	400,000,000	547,034,019	14.43	42.66	4	47.34
L&G	400,000,000	558,820,911	14.41	47.16	3	
道富	400,000,000	560,034,283	14.36	47.72	1	
北美信託	400,000,000	560,172,567	14.39	47.54	2	
合計	1,600,000,000	2,226,061,780	14.40	46.27	—	

113-1 全球永續不動產有價證券型

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	115 年截至 8 月 累積投資報酬 (%)	委任迄今 (114.6.18~115.8.31)		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率(%)
貝萊德	400,000,000	436,321,425	9.42	11.83	4	11.95
Center Square	400,000,000	444,170,635	11.67	13.63	1	
富達	400,000,000	439,713,582	9.84	12.62	2	
RREEF	400,000,000	438,001,203	9.95	12.08	3	
合計	1,600,000,000	1,758,206,845	10.22	12.54	—	

114-1 全球氣候轉型被動股票型

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	115 年截至 8 月 累積投資報酬 (%)	委任迄今 (114.11.25~115.8.31)		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率(%)
貝萊德	400,000,000	434,986,770	10.60	14.23	1	13.49
HSBC	400,000,000	433,477,784	10.12	13.39	4	
道富	400,000,000	433,496,207	10.07	13.53	3	
UBS	400,000,000	433,761,910	10.14	13.61	2	
合計	1,600,000,000	1,735,722,671	10.23	13.69	—	

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	115 年截至 8 月 累積投資報酬率 (%)	委任迄今 (113.6.24~115.8.31)		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率(%)
富達	753,144,454	1,020,316,019	10.91	35.47	—	29.54

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	115 年截至 8 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (111.1.6~115.8.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
PIMCO	1,003,724,736	960,798,772	-1.74	-4.28	1	-7.09
盧米斯	1,018,693,762	955,998,485	-1.03	-7.35	2	
合計	2,022,418,498	1,916,797,257	-1.38	-5.78	—	

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	115 年截至 8 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (111.2.6~115.8.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
貝萊德	456,987,544	1,542,326,350	19.39	91.62	—	72.02

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	115 年截至 8 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (111.11.17~115.8.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
景順	181,124,998	398,401,997	21.03	102.31	—	94.19

100-1 全球基本面指數股票型(續約 3)

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	115 年截至 8 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (115. 7. 1~115. 8. 31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
貝萊德	303, 753, 501	315, 278, 070	3. 79	3. 79	4	4. 18
道富	456, 179, 013	474, 304, 460	3. 97	3. 97	3	
瑞銀	361, 201, 485	375, 878, 543	4. 06	4. 06	1	
Nomura	405, 779, 245	422, 143, 521	4. 03	4. 03	2	
合計	1, 526, 913, 244	1, 587, 604, 594	3. 97	3. 97	—	

101-1 全球低波動指數股票型(續約 2)

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	115 年截至 8 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (112. 4. 18~115. 8. 31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
貝萊德	751, 993, 706	1, 041, 237, 914	8. 06	38. 46	—	37. 11

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	115 年截至 8 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (113. 1. 22~115. 8. 31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
瑞萬通博	414, 056, 068	478, 897, 741	0. 70	15. 66	3	53. 36
MFS	315, 296, 707	488, 403, 338	19. 04	54. 90	1	
威靈頓	704, 502, 354	1, 085, 299, 191	15. 37	54. 05	2	
合計	1, 433, 855, 129	2, 052, 600, 270	12. 37	43. 15	—	

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	115 年截至 8 月 累積投資報酬 (%)	委任迄今 (113.5.29~115.8.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
Lazard	954,418,976	1,365,207,396	3.73	43.04	—	37.42

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	115 年截至 8 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (113.8.27~115.8.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
信安環球	708,888,643	779,570,218	9.40	9.97	2	11.69
Nomura	144,937,350	170,113,864	10.74	17.37	1	
合計	853,825,993	949,684,082	9.64	11.23	—	

105-1 全球多元資產型 (續約 2)

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	115 年截至 8 月 累積投資報酬 (%)	委任迄今 (115.7.20~115.8.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標/目標 報酬率(%)
Allianz	275,923,278	286,025,127	3.66	3.66	1	0.43/1.02
摩根	440,558,255	452,543,643	2.72	2.72	2	
DWS	443,166,315	452,972,950	2.21	2.21	3	
合計	1,159,647,848	1,191,541,720	2.75	2.75	—	

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	115 年截至 8 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (111.6.22~115.8.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
貝萊德	127,303,524	251,704,839	23.07	97.72	4	97.65
DWS	147,528,441	297,801,427	22.66	101.86	1	
道富	157,982,595	318,477,456	22.63	101.59	2	
北美信託	158,484,700	316,304,363	22.77	99.58	3	
合計	591,299,260	1,184,288,085	22.77	100.29	—	

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	115 年截至 8 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (111.7.25~115.8.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標/目標 報酬率(%)
American Century	319,635,794	392,940,001	2.30	22.93	3	19.30/29.57
富達	279,785,344	363,148,480	2.11	28.30	1	
TCW	328,000,470	410,447,072	2.32	25.14	2	
合計	927,421,608	1,166,535,553	2.25	25.43	—	

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	115 年截至 8 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (113.1.23~115.8.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標/目標 報酬率(%)
景順	116,977,839	188,920,404	15.39	61.50	1	11.56/24.60
威靈頓	107,476,614	147,100,860	6.59	36.87	3	
CPR	115,110,097	172,703,210	16.09	50.03	2	
合計	339,564,550	508,724,474	12.93	49.82	—	

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	115 年截至 8 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (110.9.8~115.8.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
CBRE	60,000,000	81,154,165	7.90	36.86	3	37.36
ClearBridge	60,000,000	88,847,965	10.90	51.95	1	
Magellan	60,000,000	72,127,590	5.40	34.84	4	
RREEF	60,000,000	81,811,979	10.06	38.00	2	
合計	240,000,000	323,941,699	8.67	40.03	—	

(二)115 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)

115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)

115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
115年8月份	275,662,232,496	371,146,649,779	95,484,417,283

(二)舊制勞工退休基金

單位：新臺幣元

	餘絀	收入	支出
115年8月份	65,892,016,740	66,088,643,084	196,626,344

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

115 年 8 月份		單位：新臺幣元
項 目	金 額	
現金收入	148,977,860,649	
現金支出	139,013,364,816	
現金增(減)數		9,964,495,833

(二)舊制勞工退休基金

115 年 8 月份		單位：新臺幣元
項 目	金 額	
現金收入	114,662,653,072	
現金支出	114,662,827,808	
現金增(減)數		-174,736