

## 勞工退休基金運用情形

### 一、勞工退休基金整體績效

#### (一) 112 年截至 9 月底績效

| 基金與指標   | 新制基金  | 舊制基金   | 台灣 10 年期<br>公債殖利率 | 台灣加權<br>股價指數 | MSCI 全球<br>股票指數 | Barclays<br>全球債券指數 |
|---------|-------|--------|-------------------|--------------|-----------------|--------------------|
| 收益率/報酬率 | 8.91% | 10.14% | 1.19%             | 15.67%       | 10.06%          | -2.21%             |

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(111 年)績效

| 基金與指標   | 新制基金   | 舊制基金   | 台灣 10 年期<br>公債殖利率 | 台灣加權<br>股價指數 | MSCI 全球<br>股票指數 | Barclays<br>全球債券指數 |
|---------|--------|--------|-------------------|--------------|-----------------|--------------------|
| 收益率/報酬率 | -6.67% | -8.30% | 1.23%             | -22.40%      | -18.36%         | -16.25%            |

#### (三) 近三年(109~111 年)平均績效

| 基金與指標   | 新制基金  | 舊制基金  | 台灣 10 年期<br>公債殖利率 | 台灣加權<br>股價指數 | MSCI 全球<br>股票指數 | Barclays<br>全球債券指數 |
|---------|-------|-------|-------------------|--------------|-----------------|--------------------|
| 收益率/報酬率 | 2.62% | 3.70% | 0.70%             | 5.63%        | 4.00%           | -4.48%             |

#### (四) 近五年(107~111 年)平均績效

| 基金與指標   | 新制基金  | 舊制基金  | 台灣 10 年期<br>公債殖利率 | 台灣加權<br>股價指數 | MSCI 全球<br>股票指數 | Barclays<br>全球債券指數 |
|---------|-------|-------|-------------------|--------------|-----------------|--------------------|
| 收益率/報酬率 | 3.45% | 4.54% | 0.75%             | 5.84%        | 5.23%           | -1.66%             |

## 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

| 112 年 9 月底止基金規模與收益         |      |                 |                            |
|----------------------------|------|-----------------|----------------------------|
| 基金運用規模                     |      |                 | 3 兆 9,719 億 4,739 萬元       |
| 112 年截至 9 月底止<br>運用收益數及收益率 | 自行運用 | 國內固定收益          | 95 億 1,317 萬元<br>1.51%     |
|                            |      | 國內權益證券<br>及國外投資 | 874 億 5,588 萬元<br>12.64%   |
|                            | 委託經營 |                 | 2,354 億 2,472 萬元<br>10.71% |
|                            | 合 計  |                 | 3,323 億 9,377 萬元<br>8.91%  |

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 3：112 年 9 月之保證收益率為 1.5866%。

#### 2. 舊制勞工退休基金

| 112 年 9 月底止基金規模與收益         |      |                 |                          |
|----------------------------|------|-----------------|--------------------------|
| 基金運用規模                     |      |                 | 10,122 億 4,951 萬元        |
| 112 年截至 9 月底止<br>運用收益數及收益率 | 自行運用 | 國內固定收益          | 28 億 5,675 萬元<br>1.41%   |
|                            |      | 國內權益證券<br>及國外投資 | 388 億 6,884 萬元<br>16.68% |
|                            | 委託經營 |                 | 448 億 4,752 萬元<br>8.66%  |
|                            | 合 計  |                 | 865 億 7,311 萬元<br>10.14% |

註：評價後報酬率係以當期報酬率（即收益÷112 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

112 年 9 月 30 日

單位：新臺幣元

| 項 目             | 餘 額                      | 占基金運用比率(%)    |
|-----------------|--------------------------|---------------|
| <b>自行運用</b>     | <b>1,603,907,883,473</b> | <b>40.38</b>  |
| 轉存金融機構          | 497,631,226,263          | 12.53         |
| 短期票券            | 102,767,078,250          | 2.59          |
| 公債、公司債、金融債券及特別股 | 219,312,768,227          | 5.52          |
| 股票及受益憑證投資(含期貨)  | 251,929,272,757          | 6.34          |
| 國外投資            | 532,267,537,976          | 13.40         |
| 固定收益            | 405,690,147,419          | 10.22         |
| 權益證券            | 65,696,109,232           | 1.65          |
| 另類投資            | 60,881,281,325           | 1.53          |
| <b>委託經營</b>     | <b>2,368,039,504,175</b> | <b>59.62</b>  |
| 國內委託經營          | 518,676,554,457          | 13.06         |
| 國外委託經營          | 1,849,362,949,718        | 46.56         |
| 固定收益            | 456,567,901,198          | 11.50         |
| 權益證券            | 952,645,731,152          | 23.98         |
| 另類投資            | 440,149,317,368          | 11.08         |
| <b>合 計</b>      | <b>3,971,947,387,648</b> | <b>100.00</b> |

## 2. 舊制勞工退休基金

112 年 9 月 30 日

單位：新臺幣元

| 項 目               | 餘 額                      | 占基金運用比率(%)    |
|-------------------|--------------------------|---------------|
| <b>自行運用</b>       | <b>504,745,972,459</b>   | <b>49.86</b>  |
| 轉存金融機構            | 159,998,570,885          | 15.81         |
| 短期票券              | 56,788,076,901           | 5.61          |
| 公債、金融債券、公司債及證券化商品 | 69,900,805,563           | 6.90          |
| 股票及受益憑證投資(含期貨)    | 117,753,406,858          | 11.63         |
| 國外投資              | 100,305,112,252          | 9.91          |
| 固定收益              | 50,488,925,655           | 4.99          |
| 權益證券              | 39,703,635,494           | 3.92          |
| 另類投資              | 10,112,551,103           | 1.00          |
| <b>委託經營</b>       | <b>507,503,536,383</b>   | <b>50.14</b>  |
| 國內委託經營            | 101,510,144,467          | 10.03         |
| 國外委託經營            | 405,993,391,916          | 40.11         |
| 固定收益              | 105,917,025,709          | 10.46         |
| 權益證券              | 202,762,366,968          | 20.03         |
| 另類投資              | 97,313,999,239           | 9.62          |
| <b>合 計</b>        | <b>1,012,249,508,842</b> | <b>100.00</b> |

### (三)基金自營投資與委外投資比率

#### 1. 新制勞工退休基金

112 年 9 月 30 日

單位：新臺幣元

| 項 目     | 金 額               | 占基金運用比率(%) |
|---------|-------------------|------------|
| 自 行 運 用 | 1,603,907,883,473 | 40.38      |
| 委 託 經 營 | 2,368,039,504,175 | 59.62      |

#### 2. 舊制勞工退休基金

112 年 9 月 30 日

單位：新臺幣元

| 項 目     | 金 額             | 占基金運用比率(%) |
|---------|-----------------|------------|
| 自 行 運 用 | 504,745,972,459 | 49.86      |
| 委 託 經 營 | 507,503,536,383 | 50.14      |

#### (四)基金國內投資與國外投資比率

##### 1. 新制勞工退休基金

112 年 9 月 30 日

單位：新臺幣元

| 項 目     | 金 額               | 占基金運用比率(%) |
|---------|-------------------|------------|
| 國 內 投 資 | 1,590,316,899,954 | 40.04      |
| 國 外 投 資 | 2,381,630,487,694 | 59.96      |

##### 2. 舊制勞工退休基金

112 年 9 月 30 日

單位：新臺幣元

| 項 目     | 金 額             | 占基金運用比率(%) |
|---------|-----------------|------------|
| 國 內 投 資 | 505,951,004,674 | 49.98      |
| 國 外 投 資 | 506,298,504,168 | 50.02      |

#### 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

112 年截至 9 月底

| 項 目    | 收益率(%) |
|--------|--------|
| 國內權益證券 | 19.78  |

##### 2. 舊制勞工退休基金

112 年截至 9 月底

| 項 目    | 收益率(%) |
|--------|--------|
| 國內權益證券 | 22.33  |

## (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

112 年 9 月 30 日

單位：新臺幣元

| 項 目    | 金 額             | 比 率 (%) |
|--------|-----------------|---------|
| 國內權益證券 | 251,929,272,757 | 6.34    |

### 2. 舊制勞工退休基金

112 年 9 月 30 日

單位：新臺幣元

| 項 目    | 金 額             | 比 率 (%) |
|--------|-----------------|---------|
| 國內權益證券 | 117,753,406,858 | 11.63   |

## 四、基金國內委外投資概況表

### (一)基金國內委外投資績效、績效指標及排名表

#### 1. 新制勞工退休基金

#### 96 年第一次委託經營(續約 5)

單位：新臺幣元

| 投信<br>名稱 | 委託金額           | 目前淨資產          | 112 年截至 9 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(111.9.27~112.9.30) |    |              |
|----------|----------------|----------------|--------------------------|-----------------------------|----|--------------|
|          |                |                |                          | 投資報酬率<br>(%)                | 排名 | 目標報酬率<br>(%) |
| 野村       | 28,072,603,831 | 33,790,134,294 | 20.43                    | 20.37                       | —  | 6.37         |

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

#### 97 年第一次委託經營(續約 5)

單位：新臺幣元

| 投信<br>名稱 | 委託金額          | 目前淨資產         | 112 年截至 9 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(112.1.30~112.9.30) |    |              |
|----------|---------------|---------------|--------------------------|-----------------------------|----|--------------|
|          |               |               |                          | 投資報酬率<br>(%)                | 排名 | 目標報酬率<br>(%) |
| 野村       | 6,829,066,771 | 7,632,620,655 | 11.77                    | 11.77                       | —  | 4.26         |

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。

## 98 年第一次委託經營(續約 4)

單位：新臺幣元

| 投信<br>名稱 | 委託金額           | 目前淨資產          | 112 年截至 9 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(110.7.16~112.9.30) |    |              |
|----------|----------------|----------------|--------------------------|-----------------------------|----|--------------|
|          |                |                |                          | 投資報酬率<br>(%)                | 排名 | 目標報酬率<br>(%) |
| 野村       | 19,093,323,980 | 19,376,765,180 | 20.24                    | 1.48                        | 2  | 12.51        |
| 保德信      | 6,277,574,114  | 6,422,884,550  | 24.00                    | 2.31                        | 1  |              |
| 合計       | 25,370,898,094 | 25,799,649,730 | 21.16                    | 1.69                        | —  |              |

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 4 年年底股票集中市場平均殖利率加計 200 個基本點為基準。

## 99 年第二次委託經營(續約 3)

單位：新臺幣元

| 投信<br>名稱 | 委託金額           | 目前淨資產          | 112 年截至 9 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(111.12.5~112.9.30) |    |              |
|----------|----------------|----------------|--------------------------|-----------------------------|----|--------------|
|          |                |                |                          | 投資報酬率<br>(%)                | 排名 | 目標報酬率<br>(%) |
| 國泰       | 10,445,113,310 | 10,570,071,952 | 1.01                     | 1.20                        | —  | 5.21         |

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

## 100 年第一次委託經營(續約 3)(相對報酬)

單位：新臺幣元

| 投信<br>名稱 | 委託金額           | 目前淨資產          | 112 年截至 9 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(112.7.15~112.9.30) |    |              |
|----------|----------------|----------------|--------------------------|-----------------------------|----|--------------|
|          |                |                |                          | 投資報酬率<br>(%)                | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| 復華       | 29,101,525,086 | 27,889,567,648 | -4.16                    | -4.16                       | —  | -2.68        |

註：本批次為相對報酬型，以臺灣就業 99 指數為指定指標。

## 101 年第一次委託經營(續約 2)(相對報酬)

單位：新臺幣元

| 投信<br>名稱 | 委託金額           | 目前淨資產          | 112 年截至 9 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(109.4.20~112.9.30) |    |              |
|----------|----------------|----------------|--------------------------|-----------------------------|----|--------------|
|          |                |                |                          | 投資報酬率<br>(%)                | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| 國泰       | 8,014,871,501  | 14,208,010,311 | 20.51                    | 77.27                       | 1  | 77.57        |
| 滙豐       | 9,927,481,593  | 17,413,829,714 | 15.94                    | 68.54                       | 2  |              |
| 合計       | 17,942,353,094 | 31,621,840,025 | 17.88                    | 72.23                       | —  |              |

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。

## 101 年第二次委託經營(續約 2)

單位：新臺幣元

| 投信<br>名稱 | 委託金額           | 目前淨資產          | 112 年截至 9 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(109.7.20~112.9.30) |    |              |
|----------|----------------|----------------|--------------------------|-----------------------------|----|--------------|
|          |                |                |                          | 投資報酬率<br>(%)                | 排名 | 目標報酬率<br>(%) |
| 野村       | 9,057,257,704  | 12,093,348,113 | 20.71                    | 33.52                       | 1  | 18.47        |
| 統一       | 12,294,643,442 | 16,337,990,329 | 17.95                    | 32.89                       | 2  |              |
| 合計       | 21,351,901,146 | 28,431,338,442 | 19.11                    | 33.16                       | —  |              |

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 4 年年底股票集中市場平均殖利率加計 200 個基本點為基準。

## 102 年第二次委託經營(續約 2) (相對報酬) 單位：新臺幣元

| 投信<br>名稱 | 委託金額           | 目前淨資產          | 112 年截至 9 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(111.1.24~112.9.30) |    |              |
|----------|----------------|----------------|--------------------------|-----------------------------|----|--------------|
|          |                |                |                          | 投資報酬率<br>(%)                | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| 統一       | 14,437,134,744 | 14,733,129,986 | 25.60                    | 2.05                        | 1  | -0.90        |
| 復華       | 19,009,802,076 | 17,893,475,866 | 20.12                    | -5.87                       | 2  |              |
| 合計       | 33,446,936,820 | 32,626,605,852 | 22.53                    | -2.45                       | —  |              |

註：本批次為相對報酬型，以臺灣加權股價報酬指數為指定指標。

## 103 年第一次委託經營(續約 2)

單位：新臺幣元

| 投信<br>名稱 | 委託金額           | 目前淨資產          | 112 年截至 9 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(111.10.11~112.9.30) |    |              |
|----------|----------------|----------------|--------------------------|------------------------------|----|--------------|
|          |                |                |                          | 投資報酬率<br>(%)                 | 排名 | 目標報酬率<br>(%) |
| 台新       | 15,841,461,125 | 18,502,713,360 | 18.24                    | 16.80                        | —  | 6.14         |

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



### 103 年第二次委託經營(續約) (相對報酬)

單位：新臺幣元

| 投信<br>名稱 | 委託金額           | 目前淨資產          | 112 年截至 9 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(110.12.1~112.9.30) |    |              |
|----------|----------------|----------------|--------------------------|-----------------------------|----|--------------|
|          |                |                |                          | 投資報酬率<br>(%)                | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| 國泰       | 14,836,482,661 | 15,954,129,448 | 22.74                    | 8.80                        | 5  | 11.61        |
| 統一       | 11,353,734,691 | 12,525,181,772 | 23.93                    | 10.32                       | 1  |              |
| 復華       | 10,890,868,617 | 11,945,820,319 | 22.62                    | 9.69                        | 2  |              |
| 滙豐       | 10,790,827,015 | 11,809,696,881 | 21.21                    | 9.44                        | 3  |              |
| 安聯       | 15,017,345,063 | 16,238,053,616 | 22.92                    | 9.27                        | 4  |              |
| 合計       | 62,889,258,047 | 68,472,882,036 | 22.71                    | 9.46                        | —  |              |

註：本批次為相對報酬型，以臺灣高薪 100 報酬指數為指定指標。

### 104 年第一次委託經營 (續約 2)

單位：新臺幣元

| 投信<br>名稱 | 委託金額          | 目前淨資產         | 112 年截至 9 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(112.4.6~112.9.30) |    |              |
|----------|---------------|---------------|--------------------------|----------------------------|----|--------------|
|          |               |               |                          | 投資報酬率<br>(%)               | 排名 | 目標報酬率<br>(%) |
| 復華       | 4,799,121,512 | 5,166,468,759 | 7.65                     | 7.65                       | 1  | 3.11         |
| 安聯       | 3,601,238,896 | 3,699,508,036 | 2.73                     | 2.73                       | 2  |              |
| 合計       | 8,400,360,408 | 8,865,976,795 | 5.54                     | 5.54                       | —  |              |

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

### 106 年第一次委託經營 (續約)

單位：新臺幣元

| 投信<br>名稱 | 委託金額           | 目前淨資產          | 112 年截至 9 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(112.2.7~112.9.30) |    |              |
|----------|----------------|----------------|--------------------------|----------------------------|----|--------------|
|          |                |                |                          | 投資報酬率<br>(%)               | 排名 | 目標報酬率<br>(%) |
| 安聯       | 14,088,712,403 | 15,887,588,983 | 12.77                    | 12.77                      | 1  | 4.12         |
| 國泰       | 6,318,453,600  | 6,516,162,021  | 3.13                     | 3.13                       | 4  |              |
| 群益       | 6,382,621,945  | 7,029,437,470  | 10.13                    | 10.13                      | 2  |              |
| 滙豐       | 7,096,535,878  | 7,442,104,113  | 4.87                     | 4.87                       | 3  |              |
| 合計       | 33,886,323,826 | 36,875,292,587 | 8.82                     | 8.82                       | —  |              |

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。

## 107 年第一次委託經營(相對報酬)

單位：新臺幣元

| 投信<br>名稱 | 委託金額           | 目前淨資產          | 112 年截至 9 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(107.10.24~112.9.30) |    |              |
|----------|----------------|----------------|--------------------------|------------------------------|----|--------------|
|          |                |                |                          | 投資報酬率<br>(%)                 | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| 台新       | 6,000,000,000  | 10,234,991,298 | 21.76                    | 101.91                       | 6  | 107.71       |
| 安聯       | 6,000,000,000  | 10,787,851,457 | 18.69                    | 112.97                       | 2  |              |
| 保德信      | 6,000,000,000  | 10,425,424,586 | 19.31                    | 102.35                       | 5  |              |
| 統一       | 4,000,000,000  | 8,663,655,487  | 19.41                    | 118.34                       | 1  |              |
| 國泰       | 6,000,000,000  | 10,465,953,134 | 19.70                    | 104.13                       | 3  |              |
| 復華       | 4,000,000,000  | 8,248,957,561  | 18.75                    | 103.53                       | 4  |              |
| 群益       | 2,500,000,000  | 6,460,486,615  | 20.15                    | 98.93                        | 7  |              |
| 合計       | 34,500,000,000 | 65,287,320,138 | 19.67                    | 105.87                       | —  |              |

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

單位：新臺幣元

| 投信<br>名稱 | 委託金額           | 目前淨資產          | 112 年截至 9 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(108.5.24~112.9.30) |    |              |
|----------|----------------|----------------|--------------------------|-----------------------------|----|--------------|
|          |                |                |                          | 投資報酬率<br>(%)                | 排名 | 目標報酬率<br>(%) |
| 安聯       | 6,000,000,000  | 9,758,326,124  | 17.64                    | 69.97                       | 2  | 26.11        |
| 施罗德      | 6,000,000,000  | 9,393,257,495  | 17.14                    | 62.04                       | 4  |              |
| 統一       | 6,000,000,000  | 9,974,179,843  | 25.23                    | 72.95                       | 1  |              |
| 野村       | 11,000,000,000 | 15,532,185,208 | 20.71                    | 68.85                       | 3  |              |
| 國泰       | 11,000,000,000 | 15,339,354,920 | 14.08                    | 60.30                       | 5  |              |
| 復華       | 6,000,000,000  | 8,443,082,375  | 19.34                    | 49.05                       | 6  |              |
| 合計       | 46,000,000,000 | 68,440,385,965 | 18.68                    | 63.29                       | —  |              |

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 200 個基本點為基準。

## 109 年第一次委託經營

單位：新臺幣元

| 投信<br>名稱 | 委託金額           | 目前淨資產          | 112 年截至 9 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(110.5.13~112.9.30) |    |              |
|----------|----------------|----------------|--------------------------|-----------------------------|----|--------------|
|          |                |                |                          | 投資報酬率<br>(%)                | 排名 | 目標報酬率<br>(%) |
| 台新       | 8,000,000,000  | 8,819,322,238  | 22.74                    | 10.24                       | 1  | 13.85        |
| 安聯       | 8,000,000,000  | 8,736,198,001  | 12.81                    | 9.20                        | 2  |              |
| 保德信      | 8,000,000,000  | 8,219,023,653  | 19.22                    | 2.74                        | 5  |              |
| 國泰       | 8,000,000,000  | 8,584,916,450  | 13.20                    | 7.31                        | 4  |              |
| 野村       | 8,000,000,000  | 8,708,591,592  | 20.02                    | 8.86                        | 3  |              |
| 合計       | 40,000,000,000 | 43,068,051,934 | 17.47                    | 7.67                        | —  |              |

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 200 個基本點為基準。

## 109 年第二次委託經營（相對報酬）

單位：新臺幣元

| 投信<br>名稱 | 委託金額           | 目前淨資產          | 112 年截至 9 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(111.5.13~112.9.30) |    |              |
|----------|----------------|----------------|--------------------------|-----------------------------|----|--------------|
|          |                |                |                          | 投資報酬率<br>(%)                | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| 安聯       | 3,000,000,000  | 4,132,996,371  | 35.75                    | 32.89                       | 3  | 41.76        |
| 保德信      | 3,000,000,000  | 4,194,763,750  | 37.33                    | 35.95                       | 1  |              |
| 野村       | 3,000,000,000  | 4,215,038,170  | 39.30                    | 33.61                       | 2  |              |
| 國泰       | 3,000,000,000  | 4,137,223,313  | 36.12                    | 32.42                       | 4  |              |
| 富邦       | 3,000,000,000  | 4,095,093,398  | 35.39                    | 30.17                       | 5  |              |
| 合計       | 15,000,000,000 | 20,775,115,002 | 36.77                    | 33.01                       | —  |              |

註：本批次為相對報酬型，以臺灣企業社會責任中小型報酬指數為指定指標。

## 110 年第一次委託經營

單位：新臺幣元

| 投信<br>名稱 | 委託金額           | 目前淨資產          | 112 年截至 9 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(110.12.15~112.9.30) |    |              |
|----------|----------------|----------------|--------------------------|------------------------------|----|--------------|
|          |                |                |                          | 投資報酬率<br>(%)                 | 排名 | 目標報酬率<br>(%) |
| 安聯       | 6,000,000,000  | 6,328,834,769  | 14.92                    | 2.89                         | 2  | 11.21        |
| 保德信      | 6,000,000,000  | 6,619,659,455  | 24.43                    | 7.12                         | 1  |              |
| 國泰       | 6,000,000,000  | 6,174,565,955  | 12.70                    | 1.19                         | 3  |              |
| 第一金      | 6,000,000,000  | 6,211,542,161  | 12.80                    | 0.03                         | 4  |              |
| 野村       | 6,000,000,000  | 6,211,716,526  | 19.91                    | -0.46                        | 6  |              |
| 富邦       | 6,000,000,000  | 6,226,577,027  | 23.35                    | -0.13                        | 5  |              |
| 合計       | 36,000,000,000 | 37,772,895,893 | 17.89                    | 1.78                         | —  |              |

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

## 2. 舊制勞工退休基金

### 國內 98 年第二次委託經營(續約 4)

單位：新臺幣元

| 投信<br>名稱 | 委託金額           | 目前淨資產          | 112 年截至 9 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(111.1.28~112.9.30) |    |              |
|----------|----------------|----------------|--------------------------|-----------------------------|----|--------------|
|          |                |                |                          | 投資報酬率<br>(%)                | 排名 | 目標報酬率<br>(%) |
| 富邦       | 12,256,867,963 | 11,821,260,945 | 23.10                    | -3.55                       | 2  | 10.20        |
| 統一       | 10,364,185,361 | 11,026,974,120 | 22.65                    | 6.39                        | 1  |              |
| 合計       | 22,621,053,324 | 22,848,235,065 | 22.88                    | 1.00                        | —  |              |

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 4 年年底股票集中市場平均殖利率加計 250 個基本點為基準。

### 國內 101 年第一次委託經營(相對報酬)(續約 2)

單位：新臺幣元

| 投信<br>名稱 | 委託金額          | 目前淨資產         | 112 年截至 9 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(109.11.2~112.9.30) |    |              |
|----------|---------------|---------------|--------------------------|-----------------------------|----|--------------|
|          |               |               |                          | 投資報酬率<br>(%)                | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| 匯豐       | 5,685,000,000 | 7,917,918,096 | 15.88                    | 39.28                       | —  | 45.50        |

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 2)

單位：新臺幣元

| 投信<br>名稱 | 委託金額           | 目前淨資產          | 112 年截至 9 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(109.05.04~112.9.30) |    |              |
|----------|----------------|----------------|--------------------------|------------------------------|----|--------------|
|          |                |                |                          | 投資報酬率<br>(%)                 | 排名 | 目標報酬率<br>(%) |
| 野村       | 19,272,822,959 | 28,494,753,662 | 20.77                    | 47.85                        | —  | 19.78        |

註：本批次為絕對報酬型，契約目標報酬率係以臺灣證交所公告之最近 4 年年底股票集中市場平均殖利率加計 200 個基本點為基準。

### 國內 104 年第一次委託經營(續約 2)

單位：新臺幣元

| 投信<br>名稱 | 委託金額          | 目前淨資產         | 112 年截至 9 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(112.4.6~112.9.30) |    |              |
|----------|---------------|---------------|--------------------------|----------------------------|----|--------------|
|          |               |               |                          | 投資報酬率<br>(%)               | 排名 | 目標報酬率<br>(%) |
| 復華       | 4,800,107,976 | 5,167,534,695 | 7.65                     | 7.65                       | 1  | 3.11         |
| 安聯       | 3,601,947,821 | 3,700,264,103 | 2.73                     | 2.73                       | 2  |              |
| 合計       | 8,402,055,797 | 8,867,798,798 | 5.54                     | 5.54                       | —  |              |

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

### 國內 106 年第一次委託經營(續約)

單位：新臺幣元

| 投信<br>名稱 | 委託金額           | 目前淨資產          | 112 年截至 9 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(112.2.7~112.9.30) |    |              |
|----------|----------------|----------------|--------------------------|----------------------------|----|--------------|
|          |                |                |                          | 投資報酬率<br>(%)               | 排名 | 目標報酬率<br>(%) |
| 安聯       | 14,089,937,312 | 15,889,099,819 | 12.77                    | 12.77                      | 1  | 4.12         |
| 國泰       | 6,319,107,110  | 6,516,959,601  | 3.13                     | 3.13                       | 4  |              |
| 群益       | 6,384,957,618  | 7,031,772,199  | 10.13                    | 10.13                      | 2  |              |
| 滙豐       | 7,097,524,598  | 7,443,251,550  | 4.87                     | 4.87                       | 3  |              |
| 合計       | 33,891,526,638 | 36,881,083,169 | 8.82                     | 8.82                       | —  |              |

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。

## 國內 109 年第二次委託經營

單位：新臺幣元

| 投信<br>名稱 | 委託金額          | 目前淨資產         | 112 年截至 9 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(111.5.13~112.9.30) |    |              |
|----------|---------------|---------------|--------------------------|-----------------------------|----|--------------|
|          |               |               |                          | 投資報酬率<br>(%)                | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| 安聯       | 1,000,000,000 | 1,377,765,447 | 35.75                    | 32.93                       | 3  | 41.76        |
| 保德信      | 1,000,000,000 | 1,398,296,755 | 37.33                    | 35.95                       | 1  |              |
| 野村       | 1,000,000,000 | 1,405,066,504 | 39.30                    | 33.61                       | 2  |              |
| 國泰       | 1,000,000,000 | 1,379,166,900 | 36.12                    | 32.45                       | 4  |              |
| 富邦       | 1,000,000,000 | 1,364,999,058 | 35.37                    | 30.25                       | 5  |              |
| 合計       | 5,000,000,000 | 6,925,294,664 | 36.77                    | 33.04                       | —  |              |

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。

### (二) 112 年 9 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         | 112 年截至 9 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(110.6.7~112.9.30) |    |              |
|-------------|---------------|---------------|--------------------------|----------------------------|----|--------------|
|             |               |               |                          | 投資報酬率<br>(%)               | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| 聯博          | 907,613,021   | 711,395,141   | -2.67                    | -21.62                     | 2  | -21.25       |
| 富蘭克林<br>坦伯頓 | 1,151,737,838 | 998,600,091   | -2.93                    | -17.86                     | 1  |              |
| 合計          | 2,059,350,859 | 1,709,995,232 | -2.82                    | -19.74                     | —  |              |

##### 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         | 112 年截至 9 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(111.1.6~112.9.30) |    |              |
|-------|---------------|---------------|--------------------------|----------------------------|----|--------------|
|       |               |               |                          | 投資報酬率<br>(%)               | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| PIMCO | 2,158,967,886 | 1,821,417,644 | -2.43                    | -17.78                     | —  | -18.29       |

##### 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         | 112 年截至 9 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(111.2.6~112.9.30) |    |              |
|------|---------------|---------------|--------------------------|----------------------------|----|--------------|
|      |               |               |                          | 投資報酬率<br>(%)               | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| 貝萊德  | 1,734,805,538 | 1,680,468,549 | 10.61                    | -3.13                      | 1  | -5.71        |
| 摩根   | 1,485,120,883 | 1,438,418,717 | 11.35                    | -3.14                      | 2  |              |
| 合計   | 3,219,926,421 | 3,118,887,266 | 10.95                    | -3.14                      | —  |              |

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       | 112 年截至 9 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(111.11.17~112.9.30) |    |              |
|------|-------------|-------------|--------------------------|------------------------------|----|--------------|
|      |             |             |                          | 投資報酬率<br>(%)                 | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| 景順   | 656,507,639 | 689,579,898 | 1.60                     | 5.04                         | —  | 1.03         |

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         | 112 年截至 9 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(111.12.4~112.9.30) |    |              |
|------|---------------|---------------|--------------------------|-----------------------------|----|--------------|
|      |               |               |                          | 投資報酬率<br>(%)                | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| 貝萊德  | 1,141,092,316 | 1,189,722,785 | 10.35                    | 5.53                        | 2  | 5.27         |
| 道富   | 1,513,655,177 | 1,582,083,855 | 10.59                    | 5.84                        | 1  |              |
| 合計   | 2,654,747,493 | 2,771,806,640 | 10.49                    | 5.70                        | —  |              |

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         | 112 年截至 9 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(110.7.1~112.9.30) |    |              |
|------|---------------|---------------|--------------------------|----------------------------|----|--------------|
|      |               |               |                          | 投資報酬率<br>(%)               | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| 道富   | 934,565,605   | 950,400,064   | 6.09                     | 1.69                       | 1  | 0.40         |
| 貝萊德  | 939,726,931   | 953,662,720   | 6.16                     | 1.48                       | 2  |              |
| 合計   | 1,874,292,536 | 1,904,062,784 | 6.12                     | 1.59                       | —  |              |

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         | 112 年截至 9 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(111.3.6~112.9.30) |    |              |
|----------------|---------------|---------------|--------------------------|----------------------------|----|--------------|
|                |               |               |                          | 投資報酬率<br>(%)               | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| Cohen & Steers | 2,410,932,432 | 1,932,722,079 | -3.83                    | -20.74                     | 2  | -22.54       |
| 景順             | 1,487,127,452 | 1,182,262,427 | -4.45                    | -20.50                     | 1  |              |
| 合計             | 3,898,059,884 | 3,114,984,506 | -4.07                    | -20.64                     | —  |              |



### 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         | 112 年截至 9 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(111. 7. 31~112. 9. 30) |    |              |
|--------|---------------|---------------|--------------------------|---------------------------------|----|--------------|
|        |               |               |                          | 投資報酬率<br>(%)                    | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| Pictet | 618, 843, 493 | 640, 795, 445 | 2. 54                    | 4. 03                           | —  | 4. 56        |

### 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            | 112 年截至 9 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(112. 4. 18~112. 9. 30) |    |              |
|------|------------------|------------------|--------------------------|---------------------------------|----|--------------|
|      |                  |                  |                          | 投資報酬率<br>(%)                    | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| 道富   | 1, 113, 392, 347 | 1, 077, 493, 090 | -3. 22                   | -3. 22                          | 1  | -3. 48       |
| 貝萊德  | 1, 132, 011, 599 | 1, 095, 139, 961 | -3. 26                   | -3. 26                          | 2  |              |
| 合計   | 2, 245, 403, 946 | 2, 172, 633, 051 | -3. 24                   | -3. 24                          | —  |              |

### 102-1 全球高股利增值股票型（續約）

單位：美元

| 受託機構 | 委託金額             | 目前淨資產            | 112 年截至 9 月<br>累積投資報酬<br>(%) | 委任迄今<br>(108. 1. 22~112. 9. 30) |    |              |
|------|------------------|------------------|------------------------------|---------------------------------|----|--------------|
|      |                  |                  |                              | 投資報酬率<br>(%)                    | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| 瑞萬通博 | 1, 186, 315, 337 | 1, 571, 309, 674 | 9. 87                        | 48. 24                          | 1  | 30. 45       |
| MFS  | 803, 318, 800    | 1, 046, 734, 543 | 0. 80                        | 40. 08                          | 3  |              |
| 威靈頓  | 1, 051, 647, 315 | 1, 352, 844, 424 | 1. 24                        | 42. 27                          | 2  |              |
| 合計   | 3, 041, 281, 452 | 3, 970, 888, 641 | 4. 47                        | 43. 26                          | —  |              |

### 102-1 全球信用主動債券型（續約）

單位：美元

| 受託機構 | 委託金額          | 目前淨資產         | 112 年截至 9 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(108.4.25~112.9.30) |    |              |
|------|---------------|---------------|--------------------------|-----------------------------|----|--------------|
|      |               |               |                          | 投資報酬率<br>(%)                | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| RBC  | 936,338,464   | 923,254,170   | 1.48                     | 2.28                        | 1  | -5.37        |
| 貝萊德  | 687,231,657   | 633,613,311   | -0.11                    | -5.15                       | 3  |              |
| 盧米斯  | 892,703,100   | 843,320,671   | 0.71                     | -2.84                       | 2  |              |
| 合計   | 2,516,273,221 | 2,400,188,152 | 0.76                     | -2.03                       | —  |              |

### 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         | 112 年截至 9 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(109.8.11~112.9.30) |    |              |
|-------|---------------|---------------|--------------------------|-----------------------------|----|--------------|
|       |               |               |                          | 投資報酬率<br>(%)                | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| 北美信託  | 1,696,617,127 | 2,031,696,288 | 17.87                    | 25.85                       | 2  | 24.88        |
| LGIM  | 1,705,083,447 | 2,038,830,586 | 18.01                    | 25.75                       | 3  |              |
| Geode | 1,675,075,832 | 2,013,368,016 | 18.10                    | 26.07                       | 1  |              |
| 合計    | 5,076,776,406 | 6,083,894,890 | 17.99                    | 25.89                       | —  |              |

### 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         | 112 年截至 9 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(109.9.25~112.9.30) |    |              |
|----------|---------------|---------------|--------------------------|-----------------------------|----|--------------|
|          |               |               |                          | 投資報酬率<br>(%)                | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| Magellan | 1,437,520,518 | 1,533,361,053 | -5.12                    | 6.67                        | 2  | 13.90        |
| RREEF    | 926,848,763   | 1,043,342,769 | -7.84                    | 12.57                       | 1  |              |
| 合計       | 2,364,369,281 | 2,576,703,822 | -6.24                    | 8.98                        | —  |              |

### 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         | 112 年截至 9 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(109.11.13~112.9.30) |    |              |
|------------|---------------|---------------|--------------------------|------------------------------|----|--------------|
|            |               |               |                          | 投資報酬率<br>(%)                 | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| Brandywine | 821,176,083   | 647,629,081   | -6.49                    | -22.67                       | 2  | -20.69       |
| 盧米斯        | 471,104,127   | 403,003,007   | -0.29                    | -17.42                       | 1  |              |
| 合計         | 1,292,280,210 | 1,050,632,088 | -4.25                    | -20.86                       | —  |              |

### 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         | 112 年截至 9 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(110.7.20~112.9.30) |    |                 |
|---------|---------------|---------------|--------------------------|-----------------------------|----|-----------------|
|         |               |               |                          | 投資報酬率<br>(%)                | 排名 | 指標/目標<br>報酬率(%) |
| Allianz | 578,698,278   | 528,586,013   | -1.74                    | -10.14                      | 2  | 5.71/16.71      |
| 摩根      | 1,645,715,430 | 1,460,736,629 | 0.77                     | -11.24                      | 3  |                 |
| DWS     | 975,711,371   | 958,726,195   | 5.08                     | -1.96                       | 1  |                 |
| 柏瑞      | 765,326,657   | 658,052,862   | -1.11                    | -14.02                      | 4  |                 |
| 合計      | 3,965,451,736 | 3,606,101,699 | 1.17                     | -9.41                       | —  |                 |

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       | 112 年截至 9 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(110.8.24~112.9.30) |    |              |
|------|-------------|-------------|--------------------------|-----------------------------|----|--------------|
|      |             |             |                          | 投資報酬率<br>(%)                | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| 貝萊德  | 949,175,052 | 865,464,375 | 6.28                     | -8.82                       | —  | -8.89        |

## 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         | 112 年截至 9 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(111.6.22~112.9.30) |    |              |
|------|---------------|---------------|--------------------------|-----------------------------|----|--------------|
|      |               |               |                          | 投資報酬率<br>(%)                | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| 貝萊德  | 551,552,002   | 608,985,165   | 8.64                     | 10.54                       | 3  | 10.04        |
| DWS  | 648,715,051   | 723,716,063   | 9.08                     | 11.81                       | 1  |              |
| 道富   | 649,045,562   | 723,987,470   | 9.02                     | 11.80                       | 2  |              |
| 北美信託 | 652,047,560   | 719,718,661   | 8.75                     | 10.52                       | 4  |              |
| 合計   | 2,501,360,175 | 2,776,407,359 | 8.88                     | 11.19                       | —  |              |

## 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         | 112 年截至 9 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(111.7.25~112.9.30) |    |                 |
|------------------|---------------|---------------|--------------------------|-----------------------------|----|-----------------|
|                  |               |               |                          | 投資報酬率<br>(%)                | 排名 | 指標/目標<br>報酬率(%) |
| American Century | 427,360,620   | 434,475,110   | 1.91                     | 1.66                        | 3  | 5.22/8.19       |
| 富達               | 965,211,657   | 1,027,095,818 | 0.84                     | 6.41                        | 1  |                 |
| TCW              | 1,039,618,153 | 1,057,884,829 | 2.46                     | 1.74                        | 2  |                 |
| 合計               | 2,432,190,430 | 2,519,455,757 | 1.70                     | 3.63                        | —  |                 |

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

單位：美元

| 受託機構   | 委託金額          | 目前淨資產         | 112 年截至 9 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(108.1.23~112.9.30) |    |                 |
|--------|---------------|---------------|--------------------------|-----------------------------|----|-----------------|
|        |               |               |                          | 投資報酬率<br>(%)                | 排名 | 指標/目標<br>報酬率(%) |
| Nomura | 300,000,000   | 298,442,853   | -0.62                    | 3.26                        | 5  | 8.86/32.31      |
| 景順     | 580,000,000   | 747,692,318   | 4.62                     | 44.25                       | 1  |                 |
| 威靈頓    | 600,000,000   | 733,078,832   | 3.96                     | 32.45                       | 3  |                 |
| CPR    | 580,000,000   | 728,366,771   | 10.90                    | 37.29                       | 2  |                 |
| 道富     | 580,000,000   | 666,196,079   | 1.31                     | 21.39                       | 4  |                 |
| 合計     | 2,640,000,000 | 3,173,776,853 | 4.59                     | 27.67                       | —  |                 |

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         | 112 年截至 9 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(108.12.18~112.9.30) |    |              |
|--------|---------------|---------------|--------------------------|------------------------------|----|--------------|
|        |               |               |                          | 投資報酬率<br>(%)                 | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| Amundi | 400,000,000   | 433,635,307   | 4.87                     | -0.43                        | 4  | 2.64         |
| DWS    | 400,000,000   | 404,784,150   | 3.72                     | -4.98                        | 5  |              |
| Nomura | 400,000,000   | 478,781,572   | 6.60                     | 10.56                        | 3  |              |
| 荷寶     | 300,000,000   | 389,167,404   | 11.00                    | 13.93                        | 1  |              |
| 道富     | 300,000,000   | 382,939,308   | 10.13                    | 11.22                        | 2  |              |
| 合計     | 1,800,000,000 | 2,089,307,741 | 7.08                     | 5.48                         | —  |              |

### 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         | 112 年截至 9 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(110.1.13~112.9.30) |    |              |
|---------|---------------|---------------|--------------------------|-----------------------------|----|--------------|
|         |               |               |                          | 投資報酬率<br>(%)                | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| DWS     | 600,000,000   | 541,792,300   | 0.23                     | -15.17                      | 3  | -14.41       |
| INSIGHT | 700,000,000   | 645,134,110   | 0.50                     | -14.20                      | 1  |              |
| 摩根      | 400,000,000   | 345,946,902   | 0.32                     | -15.20                      | 4  |              |
| PIMCO   | 480,000,000   | 424,413,173   | 0.03                     | -15.14                      | 2  |              |
| WESTERN | 400,000,000   | 341,957,144   | 0.24                     | -15.88                      | 5  |              |
| 合計      | 2,580,000,000 | 2,299,243,629 | 0.28                     | -15.12                      | —  |              |

### 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         | 112 年截至 9 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(110.9.8~112.9.30) |    |              |
|-------------|---------------|---------------|--------------------------|----------------------------|----|--------------|
|             |               |               |                          | 投資報酬率<br>(%)               | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| CBRE        | 350,000,000   | 311,578,258   | -7.17                    | -10.50                     | 2  | -9.43        |
| Clearbridge | 450,000,000   | 403,971,847   | -7.52                    | -8.30                      | 1  |              |
| Magellan    | 350,000,000   | 310,215,157   | -6.60                    | -12.70                     | 4  |              |
| RREEF       | 350,000,000   | 308,369,839   | -7.09                    | -11.60                     | 3  |              |
| 合計          | 1,500,000,000 | 1,334,135,101 | -7.11                    | -10.74                     | —  |              |

## 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         | 112 年截至 9 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(110.10.15~112.9.30) |    |                 |
|---------------|---------------|---------------|--------------------------|------------------------------|----|-----------------|
|               |               |               |                          | 投資報酬率<br>(%)                 | 排名 | 指標/目標<br>報酬率(%) |
| 富達            | 400,000,000   | 334,410,080   | 0.82                     | -16.74                       | 5  | 5.70/15.51      |
| 摩根            | 400,000,000   | 349,317,077   | 0.92                     | -12.83                       | 4  |                 |
| Ninety One    | 400,000,000   | 378,476,069   | -3.04                    | -5.88                        | 1  |                 |
| Schroders     | 400,000,000   | 367,225,024   | 3.47                     | -8.57                        | 2  |                 |
| T. Rowe Price | 400,000,000   | 359,752,139   | 3.46                     | -11.12                       | 3  |                 |
| 合計            | 2,000,000,000 | 1,789,180,389 | 1.04                     | -11.02                       | —  |                 |

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       | 112 年截至 9 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(112.4.28~112.9.30) |    |                 |
|-----------|-------------|-------------|--------------------------|-----------------------------|----|-----------------|
|           |             |             |                          | 投資報酬率<br>(%)                | 排名 | 指標/目標<br>報酬率(%) |
| 匯豐        | 100,000,000 | 100,604,483 | 0.60                     | 0.60                        | 1  | 0.52            |
| LGIM      | 100,000,000 | 99,468,590  | -0.53                    | -0.53                       | 4  |                 |
| 摩根士坦利     | 100,000,000 | 98,826,797  | -1.17                    | -1.17                       | 5  |                 |
| Schroders | 100,000,000 | 100,511,797 | 0.51                     | 0.51                        | 2  |                 |
| 威靈頓       | 100,000,000 | 100,300,290 | 0.30                     | 0.30                        | 3  |                 |
| 合計        | 500,000,000 | 499,711,957 | -0.06                    | -0.06                       | —  |                 |

## 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       | 112 年截至 9 月<br>累積投資報酬率(%) | 委任迄今<br>(112.7.19~112.9.30) |    |                 |
|---------------|-------------|-------------|---------------------------|-----------------------------|----|-----------------|
|               |             |             |                           | 投資報酬率<br>(%)                | 排名 | 指標/目標<br>報酬率(%) |
| 盧米斯           | 100,000,000 | 100,040,894 | 0.04                      | 0.04                        | 3  | 1.06/1.56       |
| Ninety One    | 100,000,000 | 99,362,129  | -0.64                     | -0.64                       | 5  |                 |
| PIMCO         | 100,000,000 | 99,126,977  | -0.87                     | -0.87                       | 6  |                 |
| PGIM          | 100,000,000 | 101,302,506 | 1.30                      | 1.30                        | 1  |                 |
| T. Rowe Price | 100,000,000 | 99,906,976  | -0.09                     | -0.09                       | 4  |                 |
| 威靈頓           | 100,000,000 | 101,099,061 | 1.10                      | 1.10                        | 2  |                 |
| 合計            | 600,000,000 | 600,838,543 | 0.14                      | 0.14                        | —  |                 |

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

## 2. 舊制勞工退休基金

### 96 國際平衡型(續約 3)

單位：美元

| 受託機構 | 委託金額        | 目前淨資產       | 112 年截至 9 月<br>累積投資報酬率(%) | 委任迄今<br>(108.6.24~112.9.30) |    |              |
|------|-------------|-------------|---------------------------|-----------------------------|----|--------------|
|      |             |             |                           | 投資報酬率<br>(%)                | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| 富達   | 786,579,222 | 941,183,222 | 5.06                      | 17.03                       | —  | 17.61        |

### 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         | 112 年截至 9 月<br>累積投資報酬率(%) | 委任迄今<br>(111.2.6~112.9.30) |    |              |
|-------|---------------|---------------|---------------------------|----------------------------|----|--------------|
|       |               |               |                           | 投資報酬率<br>(%)               | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| PIMCO | 1,003,724,736 | 825,412,493   | -2.41                     | -17.77                     | 1  | -18.29       |
| 盧米斯   | 948,693,762   | 771,052,995   | -3.05                     | -18.72                     | 2  |              |
| 合計    | 1,952,418,498 | 1,596,465,488 | -2.72                     | -18.23                     | —  |              |



### 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         | 112 年截至 9 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(111.2.6~112.9.30) |    |              |
|------|---------------|---------------|--------------------------|----------------------------|----|--------------|
|      |               |               |                          | 投資報酬率<br>(%)               | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| 貝萊德  | 1,156,987,544 | 1,120,865,484 | 10.61                    | -3.12                      | —  | -5.71        |

### 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       | 112 年截至 9 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(111.11.17~112.9.30) |    |              |
|------|-------------|-------------|--------------------------|------------------------------|----|--------------|
|      |             |             |                          | 投資報酬率<br>(%)                 | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| 景順   | 281,124,998 | 295,039,989 | 1.62                     | 4.95                         | —  | 1.03         |

### 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         | 112 年截至 9 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(111.3.6~112.9.30) |    |              |
|--------|---------------|---------------|--------------------------|----------------------------|----|--------------|
|        |               |               |                          | 投資報酬率<br>(%)               | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| 貝萊德    | 304,997,166   | 312,987,916   | 6.26                     | 2.62                       | 4  | 1.64         |
| 道富     | 360,436,214   | 370,873,760   | 5.99                     | 2.90                       | 1  |              |
| 瑞銀     | 308,879,836   | 317,752,302   | 6.22                     | 2.87                       | 2  |              |
| Nomura | 360,147,608   | 369,681,126   | 6.08                     | 2.65                       | 3  |              |
| 合計     | 1,334,460,824 | 1,371,295,104 | 6.13                     | 2.76                       | —  |              |

### 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       | 112 年截至 9 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(112.4.18~112.9.30) |    |              |
|------|-------------|-------------|--------------------------|-----------------------------|----|--------------|
|      |             |             |                          | 投資報酬率<br>(%)                | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| 貝萊德  | 751,993,706 | 727,636,501 | -3.24                    | -3.24                       | —  | -3.48        |

### 102-1 年全球高股利增值股票型(續約)

單位：美元

| 受託機構 | 委託金額        | 目前淨資產         | 112 年截至 9 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(108.1.22~112.9.30) |    |              |
|------|-------------|---------------|--------------------------|-----------------------------|----|--------------|
|      |             |               |                          | 投資報酬率<br>(%)                | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| 瑞萬通博 | 237,169,673 | 378,976,137   | 9.75                     | 48.31                       | 1  | 30.45        |
| MFS  | 196,618,331 | 296,118,363   | 0.81                     | 40.10                       | 3  |              |
| 威靈頓  | 453,548,464 | 667,485,012   | 1.22                     | 42.29                       | 2  |              |
| 合計   | 887,336,468 | 1,342,579,512 | 3.42                     | 43.43                       | —  |              |

### 102-2 全球基礎建設有價證券型(續約)

單位：美元

| 受託機構   | 委託金額        | 目前淨資產       | 112 年截至 9 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(108.5.29~112.9.30) |    |              |
|--------|-------------|-------------|--------------------------|-----------------------------|----|--------------|
|        |             |             |                          | 投資報酬率<br>(%)                | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| Lazard | 713,987,041 | 839,457,137 | 0.58                     | 18.47                       | —  | 7.29         |

### 102-2 全球不動產有價證券型 (續約)

單位：美元

| 受託機構      | 委託金額        | 目前淨資產       | 112 年截至 9 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(108.8.27~112.9.30) |    |              |
|-----------|-------------|-------------|--------------------------|-----------------------------|----|--------------|
|           |             |             |                          | 投資報酬率<br>(%)                | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| 信安環球      | 610,886,182 | 563,657,824 | -3.63                    | -10.75                      | 2  | -14.07       |
| Macquarie | 126,937,100 | 118,263,726 | -4.29                    | -6.83                       | 1  |              |
| 合計        | 737,823,282 | 681,921,550 | -3.75                    | -10.03                      | —  |              |

### 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         | 112 年截至 9 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(110.7.20~112.9.30) |    |                 |
|---------|---------------|---------------|--------------------------|-----------------------------|----|-----------------|
|         |               |               |                          | 投資報酬率<br>(%)                | 排名 | 指標/目標<br>報酬率(%) |
| Allianz | 155,447,975   | 139,898,854   | -1.69                    | -10.00                      | 2  | 5.71/16.71      |
| 摩根      | 594,592,070   | 529,731,072   | 0.89                     | -10.91                      | 3  |                 |
| DWS     | 311,387,682   | 305,539,774   | 5.04                     | -1.88                       | 1  |                 |
| 柏瑞      | 254,823,294   | 218,957,649   | -1.01                    | -14.07                      | 4  |                 |
| 合計      | 1,316,251,021 | 1,194,127,349 | 1.25                     | -9.28                       | —  |                 |

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       | 112 年截至 9 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(111.6.22~112.9.30) |    |              |
|------|-------------|-------------|--------------------------|-----------------------------|----|--------------|
|      |             |             |                          | 投資報酬率<br>(%)                | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| 貝萊德  | 127,303,524 | 140,514,387 | 8.56                     | 10.38                       | 3  | 10.04        |
| DWS  | 147,528,441 | 164,870,003 | 9.07                     | 11.75                       | 2  |              |
| 道富   | 157,982,595 | 176,703,840 | 9.04                     | 11.85                       | 1  |              |
| 北美信託 | 158,484,700 | 174,917,938 | 8.69                     | 10.37                       | 4  |              |
| 合計   | 591,299,260 | 657,006,168 | 8.85                     | 11.11                       | —  |              |

### 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       | 112 年截至 9 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(111.7.25~112.9.30) |    |                 |
|------------------|-------------|-------------|--------------------------|-----------------------------|----|-----------------|
|                  |             |             |                          | 投資報酬率<br>(%)                | 排名 | 指標/目標<br>報酬率(%) |
| American Century | 319,635,794 | 324,984,612 | 1.90                     | 1.67                        | 3  | 5.22/8.19       |
| 富達               | 299,785,344 | 320,631,242 | 1.04                     | 6.95                        | 1  |                 |
| TCW              | 328,000,470 | 333,912,906 | 2.53                     | 1.80                        | 2  |                 |
| 合計               | 947,421,608 | 979,528,760 | 1.83                     | 3.39                        | —  |                 |

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

單位：美元

| 受託機構   | 委託金額        | 目前淨資產       | 112 年截至 9 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(108.1.23~112.9.30) |    |                 |
|--------|-------------|-------------|--------------------------|-----------------------------|----|-----------------|
|        |             |             |                          | 投資報酬率<br>(%)                | 排名 | 指標/目標<br>報酬率(%) |
| Nomura | 40,000,000  | 35,933,465  | -0.45                    | 3.45                        | 5  | 8.86/32.31      |
| 景順     | 80,000,000  | 111,175,725 | 4.64                     | 43.42                       | 1  |                 |
| 威靈頓    | 80,000,000  | 100,081,142 | 3.96                     | 32.63                       | 3  |                 |
| CPR    | 80,000,000  | 107,641,001 | 11.11                    | 37.66                       | 2  |                 |
| 道富     | 80,000,000  | 91,759,359  | 1.30                     | 21.16                       | 4  |                 |
| 合計     | 360,000,000 | 446,590,692 | 4.82                     | 28.52                       | —  |                 |

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       | 112 年截至 9 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(110.9.8~112.9.30) |    |                 |
|-------------|-------------|-------------|--------------------------|----------------------------|----|-----------------|
|             |             |             |                          | 投資報酬率<br>(%)               | 排名 | 指標/目標<br>報酬率(%) |
| CBRE        | 30,000,000  | 26,868,017  | -7.17                    | -10.44                     | 2  | -9.43           |
| ClearBridge | 30,000,000  | 27,563,798  | -7.74                    | -8.12                      | 1  |                 |
| Magellan    | 30,000,000  | 26,343,739  | -6.62                    | -12.19                     | 4  |                 |
| RREEF       | 30,000,000  | 26,692,523  | -7.12                    | -11.02                     | 3  |                 |
| 合計          | 120,000,000 | 107,468,077 | -7.17                    | -10.44                     | —  |                 |

### (二)112 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)

112年9月30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)

112年9月30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             |
|---------|-----------------|----------------|----------------|
| 112年9月份 | -50,652,825,999 | 40,991,131,641 | 91,643,957,640 |

### (二)舊制勞工退休基金

單位：新臺幣元

|         | 餘絀              | 收入              | 支出          |
|---------|-----------------|-----------------|-------------|
| 112年9月份 | -14,699,352,705 | -14,562,374,357 | 136,978,348 |

## 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

| 112 年 9 月份 |                 | 單位：新臺幣元        |
|------------|-----------------|----------------|
| 項 目        | 金 額             |                |
| 現金收入       | 336,595,811,013 |                |
| 現金支出       | 341,334,680,735 |                |
| 現金增(減)數    |                 | -4,738,869,722 |

### (二)舊制勞工退休基金

| 112 年 9 月份 |                | 單位：新臺幣元 |
|------------|----------------|---------|
| 項 目        | 金 額            |         |
| 現金收入       | 26,424,381,491 |         |
| 現金支出       | 26,424,330,039 |         |
| 現金增(減)數    |                | 51,452  |