

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(106年6月)績效

基金別	收益率	台灣10年期 公債殖利率	台灣 加權股價指數	MSCI 全球股票指數	Barclays 全球債券指數
新制基金	3.78%	1.10%	12.34%	11.48%	4.41%
舊制基金	3.71%				

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，且均為原幣別報酬率。

(二) 近一年(105年)績效

基金別	收益率	台灣10年期 公債殖利率	台灣 加權股價指數	MSCI 全球股票指數	Barclays 全球債券指數
新制基金	3.23%	0.86%	10.98%	7.86%	2.09%
舊制基金	4.17%				

(三) 近三年(103~105年)平均績效

基金別	收益率	台灣10年期 公債殖利率	台灣 加權股價指數	MSCI 全球股票指數	Barclays 全球債券指數
新制基金	3.01%	1.29%	2.43%	3.13%	-0.19%
舊制基金	3.60%				

(四) 近五年(101~105年)平均績效

基金別	收益率	台灣10年期 公債殖利率	台灣 加權股價指數	MSCI 全球股票指數	Barclays 全球債券指數
新制基金	3.72%	1.30%	5.52%	9.36%	0.21%
舊制基金	4.34%				

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 106 年 6 月底止基金規模與收益			
基金運用規模		1 兆 7,737 億 9,603 萬元	
106 年截至 6 月底止 運用總損益及評價後報酬率	自行運用	國內固定收益	27 億 8,639 萬元 1.09%
		國內權益證券 及國外投資	45 億 4,931 萬元 1.68%
	委託經營		574 億 798 萬元 6.17%
	合 計		647 億 4,368 萬元 3.78%

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÷106 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。

註 3：106 年 6 月之保證收益率為 1.0541%。

2. 舊制勞工退休基金

至 106 年 6 月底止基金規模與收益			
基金運用規模		8,501 億 6,564 萬元	
106 年截至 6 月底止 運用總損益及評價後報酬率	自行運用	國內固定收益	14 億 407 萬元 0.96%
		國內權益證券 及國外投資	113 億 2,997 萬元 6.24%
	委託經營		159 億 9,248 萬元 4.55%
	合 計		287 億 2,652 萬元 3.71%

註：評價後報酬率係以當期報酬率（即收益÷106 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

截至 106 年 6 月底

單位：新台幣元

項 目	餘 額	占基金運用比例(%)
自行運用	832,638,351,699	46.94
轉存金融機構	314,913,873,337	17.75
短期票券	80,846,437,117	4.56
公債、公司債、金融債券及特別股	157,202,833,375	8.86
股票及受益憑證投資(含期貨)	61,129,058,246	3.45
國外投資	218,546,149,624	12.32
固定收益	168,896,907,189	9.52
權益證券	26,051,912,681	1.47
另類投資	23,597,329,754	1.33
委託經營	941,157,681,458	53.06
國內委託經營	231,964,063,357	13.08
國外委託經營	709,193,618,101	39.98
固定收益	174,693,863,792	9.85
權益證券	373,520,079,996	21.06
另類投資	160,979,674,313	9.07
合 計	1,773,796,033,157	100.00

2. 舊制勞工退休基金

截至 106 年 6 月底

單位：新台幣元

項 目	餘 額	占基金運用比例(%)
自行運用	505,800,406,830	59.50
轉存金融機構	166,633,590,052	19.60
短期票券	43,953,022,205	5.17
公債、金融債券、公司債及證券化商品	102,797,973,581	12.09
股票及受益憑證投資(含期貨)	79,871,192,409	9.40
國外投資	112,544,628,583	13.24
固定收益	57,614,621,167	6.78
權益證券	42,245,088,370	4.97
另類投資	12,684,919,046	1.49
委託經營	344,365,228,457	40.50
國內委託經營	92,389,719,404	10.87
國外委託經營	251,975,509,053	29.63
固定收益	62,609,400,774	7.36
權益證券	145,146,412,095	17.07
另類投資	44,219,696,184	5.20
合 計	850,165,635,287	100.00

(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 106 年 6 月底

單位：新台幣元

項 目	金 額	占基金運用比例(%)
自行運用	832,638,351,699	46.94
委託經營	941,157,681,458	53.06

2. 舊制勞工退休基金

截至 106 年 6 月底

單位：新台幣元

項 目	金 額	占基金運用比例(%)
自行運用	505,800,406,830	59.50
委託經營	344,365,228,457	40.50

(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 106 年 6 月底

單位：新台幣元

項 目	金 額	占基金運用比例 (%)
國內投資	846,056,265,432	47.70
國外投資	927,739,767,725	52.30

2. 舊制勞工退休基金

截至 106 年 6 月底

單位：新台幣元

項 目	金 額	占基金運用比例 (%)
國內投資	485,645,497,651	57.13
國外投資	364,520,137,636	42.87

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 106 年 6 月底

項 目	收益率 (%)
國內權益證券	11.19

2. 舊制勞工退休基金

截至 106 年 6 月底

項 目	收益率 (%)
國內權益證券	14.22

(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 106 年 6 月底 單位：新台幣元

項 目	金 額	比 例 (%)
國內權益證券	61,129,058,246	3.45

2. 舊制勞工退休基金

截至 106 年 6 月底 單位：新台幣元

項 目	金 額	比 例 (%)
國內權益證券	79,871,192,409	9.40

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 3)

單位：新台幣元

投信 名稱	委託金額	目前淨資產	106 年截至 6 月 累積投資報酬 (%)	委任迄今 (105.9.27~106.6.30)		
				投資 報酬率 (%)	委託經 營排名	大盤 報酬率 (%)
野村	15,000,000,000	16,056,586,965	8.83	7.04	—	13.06

97 年第一次委託經營 (續約 3)

單位：新台幣元

投信 名稱	委託金額	目前淨資產	106 年截至 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (106.1.20~106.6.30)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤 報酬率(%)
野村	7,198,313,969	7,744,068,954	7.58	7.58	—	11.56

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	106 年截至 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (104.7.14~106.6.30)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤 報酬率(%)
野村	10,576,888,916	11,651,712,080	9.20	10.16	2	15.07
保德信	4,365,128,502	4,859,141,010	7.88	11.32	1	
合計	14,942,017,418	16,510,853,090	8.81	10.50	—	

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	106 年截至 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (103.12.1~106.6.30)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤 報酬率(%)
國泰	6,366,621,977	7,481,865,197	6.49	17.52	—	13.15

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	106 年截至 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (104.7.15~106.6.30)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤/指標 報酬率(%)
復華	14,358,076,699	16,893,890,145	9.76	17.66	1	14.97/ 17.97
滙豐中華	15,278,501,877	17,794,175,933	9.72	16.47	2	
合計	29,636,578,576	34,688,066,078	9.74	17.04	—	

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 名稱	委託金額	目前淨資產	106 年截至 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (104.8.10~106.6.30)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤 報酬率(%)
復華	17,101,520,990	19,386,464,652	9.64	13.36	—	23.13

101 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	106 年截至 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (105.4.18~106.6.30)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤/指標 報酬率(%)
國泰	5,387,135,656	6,756,460,898	13.03	25.42	1	19.48/ 25.60
滙豐中華	10,927,481,593	13,693,447,718	12.96	25.31	2	
合計	16,314,617,249	20,449,908,616	12.98	25.35	—	

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

投信名稱	委託金額	目前淨資產	106 年截至 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (105.7.18~106.6.30)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤 報酬率(%)
野村	6,850,998,495	7,515,743,651	9.14	9.70	2	16.15
統一	7,019,680,328	8,051,545,401	11.62	14.70	1	
合計	13,870,678,823	15,567,289,052	10.41	12.23	—	

102 年第一次委託經營(續約)

單位：新台幣元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	106 年截至 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (106.6.7~106.6.30)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤 報酬率(%)
統一	3,126,252,099	3,194,580,124	2.19	2.19	1	1.85
復華	6,481,866,342	6,575,845,675	1.45	1.45	2	
合計	9,608,118,441	9,770,425,799	1.69	1.69	—	

102 年第二次委託經營(相對報酬)

單位：新台幣元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	106 年截至 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (103.1.20~106.6.30)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤/指標 報酬率(%)
保德信	5,000,000,000	6,177,034,160	10.97	29.38	4	20.93/ 36.20
統一	5,000,000,000	6,278,170,648	12.38	31.35	3	
復華	5,000,000,000	6,805,703,097	15.19	44.60	1	
群益	5,000,000,000	5,989,055,232	10.50	27.81	5	
滙豐中華	5,000,000,000	6,504,009,637	13.01	36.37	2	
合計	25,000,000,000	31,753,972,774	12.46	33.92	—	

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

投信名稱	委託金額	目前淨資產	106 年截至 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (103.8.11~106.6.30)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤 報酬率(%)
國泰	7,000,000,000	7,982,508,929	7.34	14.04	1	14.41
統一	7,000,000,000	7,311,170,817	8.75	4.45	3	
復華	7,000,000,000	7,570,512,033	10.09	8.15	2	
合計	21,000,000,000	22,864,191,779	8.69	8.88	—	

103 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	106 年截至 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (103.10.8~106.6.30)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤 報酬率(%)
台新	7,000,000,000	7,902,128,080	8.48	12.89	1	14.98
保德信	7,000,000,000	7,675,069,173	6.43	9.64	2	
群益	7,000,000,000	7,595,996,656	9.32	8.51	3	
合計	21,000,000,000	23,173,193,909	8.06	10.35	—	

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	106 年截至 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (104.3.31~106.6.30)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤 報酬率(%)
永豐	2,500,000,000	2,685,302,708	9.28	7.41	3	9.17
國泰	2,500,000,000	2,665,181,772	6.34	6.61	4	
統一	2,500,000,000	2,767,054,300	9.87	10.68	2	
復華	2,500,000,000	2,643,307,850	10.47	5.73	5	
滙豐中華	2,500,000,000	2,783,959,317	7.52	11.36	1	
安聯	2,500,000,000	2,596,247,983	6.51	3.85	6	
合計	15,000,000,000	16,141,053,930	8.32	7.61	—	

104 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	106 年截至 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (105.12.28~106.6.30)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤 報酬率(%)
永豐	2,500,000,000	2,590,481,140	3.60	3.62	5	14.12
國泰	2,500,000,000	2,575,854,097	3.01	3.03	6	
統一	2,500,000,000	2,674,345,066	6.89	6.97	2	
復華	2,500,000,000	2,744,073,912	9.73	9.76	1	
匯豐中華	2,500,000,000	2,637,924,527	5.45	5.52	3	
安聯	2,500,000,000	2,624,578,426	4.90	4.98	4	
合計	15,000,000,000	15,847,257,168	5.60	5.65	—	

2. 舊制勞工退休基金

國內 98 年第二次委託經營(續約 2)

單位：新台幣元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	106 年截至 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (105.1.26~106.6.30)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤 報酬率(%)
富邦	4,927,262,338	5,519,047,304	6.91	12.01	2	31.68
統一	5,071,927,246	5,960,809,610	9.88	17.53	1	
合計	9,999,189,584	11,479,856,914	8.43	14.81	—	

國內 100 年第一次委託經營(續約)

單位：新台幣元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	106 年截至 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (104.3.17~106.6.30)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤 報酬率(%)
群益	3,094,525,480	2,993,394,300	9.14	1.32	3	9.27
復華	6,134,978,456	6,621,660,353	9.51	7.93	1	
統一	6,511,946,664	6,870,063,689	10.03	5.50	2	
合計	15,741,450,600	16,485,118,342	9.49	4.86	—	

國內 101 年第一次委託經營(相對報酬)(續約)

單位：新台幣元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	106 年截至 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (105.10.31~106.6.30)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤/指標 報酬率(%)
匯豐中華	5,684,367,652	6,350,202,621	12.65	11.71	—	11.69/12.75

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(續約)

單位：新台幣元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	106 年截至 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (105.5.3~106.6.30)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤 報酬率(%)
野村	16,650,814,154	19,455,873,530	9.58	16.85	—	24.08

國內 102 年第一次委託經營(續約)

單位：新台幣元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	106 年截至 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (106.6.7~106.6.30)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤 報酬率(%)
統一	3,126,679,953	3,195,017,101	2.19	2.19	1	1.85
復華	12,007,032,629	12,184,564,492	1.48	1.48	2	
合計	15,133,712,582	15,379,581,593	1.62	1.62	—	

國內 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	106 年截至 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (104.3.31~106.6.30)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤 報酬率(%)
永豐	2,500,000,000	2,685,476,405	9.28	7.42	3	9.17
國泰	2,500,000,000	2,665,340,566	6.34	6.61	4	
統一	2,500,000,000	2,767,245,356	9.88	10.69	2	
復華	2,500,000,000	2,643,437,457	10.47	5.74	5	
匯豐中華	2,500,000,000	2,784,176,530	7.52	11.37	1	
安聯	2,500,000,000	2,596,422,342	6.51	3.86	6	
合計	15,000,000,000	16,142,098,656	8.32	7.61	—	

國內 104 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	106 年截至 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (105.12.28~106.6.30)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤 報酬率(%)
永豐	2,500,000,000	2,590,517,806	3.61	3.62	5	14.12
國泰	2,500,000,000	2,575,880,269	3.01	3.04	6	
統一	2,500,000,000	2,674,390,385	6.89	6.98	2	
復華	2,500,000,000	2,744,115,693	9.73	9.76	1	
匯豐中華	2,500,000,000	2,637,967,561	5.46	5.52	3	
安聯	2,500,000,000	2,624,621,330	4.91	4.98	4	
合計	15,000,000,000	15,847,493,044	5.60	5.65	—	

(二) 106 年 6 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 2)

單位：美元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	106 年截至 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (105.6.6~106.6.30)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
聯博	793,101,125	794,679,325	5.08	0.20	1	-0.97
坦伯頓	744,405,663	743,264,092	3.66	-0.15	2	
合計	1,537,506,788	1,537,943,417	4.39	0.03	—	

97-2 全球增值債券型 (續約 2)

單位：美元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	106 年截至 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (106.1.6~106.6.30)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
太平洋	819,586,290	859,194,818	4.83	4.83	—	3.98

97-2 全球增值股票型 (續約 2)

單位：美元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	106 年截至 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (106.2.6~106.6.30)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
貝萊德	967,348,593	1,060,828,808	9.66	9.66	1	7.66
摩根	802,177,668	862,287,144	7.49	7.49	2	
合計	1,769,526,261	1,923,115,952	8.68	8.68	—	

98-1 亞太 (日本除外) 主動股票型 (續約)

單位：美元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	106 年截至 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (102.11.18~106.6.30)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
景順	571,501,358	715,154,997	23.06	27.65	—	18.61

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	106 年截至 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (102.12.2~106.6.30)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
貝萊德	399,329,552	490,293,496	11.71	25.77	1	24.40
道富	549,680,272	667,888,537	11.60	25.44	2	
合計	949,009,824	1,158,182,033	11.65	25.58	—	

99-1 全球新興市場主動股票型 (續約)

單位：美元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	106年截至6月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (103.8.25~106.6.30)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
摩根士丹利	403,049,882	401,363,423	20.32	-0.42	2	-0.40
瑞萬通博	716,993,858	754,299,416	22.09	5.20	1	
合計	1,120,043,740	1,155,662,839	21.47	3.18	—	

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	106年截至6月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (105.7.1~106.6.30)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
道富	562,180,574	683,821,070	9.11	21.64	2	21.49
貝萊德	566,301,910	689,175,871	9.08	21.70	1	
合計	1,128,482,484	1,372,996,941	9.09	21.67	—	

100-1 全球不動產有價證券型 (續約)

單位：美元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	106年截至6月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (106.3.6~106.6.30)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
Cohen & Steers	951,936,411	997,427,609	4.78	4.78	1	3.68
景順	984,104,927	1,016,477,865	3.29	3.29	2	
合計	1,936,041,338	2,013,905,474	4.02	4.02	—	

101-1 全球新興市場主動債券型

單位：美元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	106年截至6月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (101.7.31~106.6.30)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
Ashmore	300,000,000	299,257,447	7.78	3.02	1	4.55
Bluebay	300,000,000	283,438,321	7.12	-3.47	4	
實港	300,000,000	287,018,121	8.66	-2.52	3	
Pictet	300,000,000	299,931,020	7.22	1.92	2	
合計	1,200,000,000	1,169,644,909	7.69	-0.26	—	

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	106年截至6月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (102.4.18~106.6.30)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
道富	500,000,000	630,397,747	11.17	25.79	1	23.92
貝萊德	500,000,000	626,778,624	11.16	25.05	2	
合計	1,000,000,000	1,257,176,371	11.17	25.42	—	

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	106年截至6月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (103.1.22~106.6.30)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
瑞萬通博	500,000,000	690,617,920	18.71	42.08	1	16.50
MFS	500,000,000	574,874,904	11.05	18.94	3	
威靈頓	500,000,000	596,955,017	11.77	24.11	2	
合計	1,500,000,000	1,862,447,841	14.01	28.41	—	

102-1 全球信用主動債券型

單位：美元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	106年截至6月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (103.4.25~106.6.30)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
Bluebay	400,000,000	416,935,319	5.84	4.49	3	4.55
貝萊德	400,000,000	417,475,823	5.28	4.57	2	
盧米斯	400,000,000	422,517,227	5.56	5.85	1	
合計	1,200,000,000	1,256,928,369	5.56	4.97	—	

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	106年截至6月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (104.8.11~106.6.30)		
				投資 報酬率(%)	排名	大盤/指標 報酬率(%)
北美信託	650,000,000	774,169,752	13.96	17.93	1	17.75
LGIM	650,000,000	774,603,210	13.97	17.80	2	
Geode	650,000,000	772,522,054	13.83	17.53	3	
合計	1,950,000,000	2,321,295,016	13.92	17.75	—	

104-2 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	106年截至6月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (104.9.25~106.6.30)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
Cohen & Steers	350,000,000	406,136,740	11.31	15.88	4	21.68
麥格理	350,000,000	417,587,388	12.79	21.38	2	
Magellan	350,000,000	410,267,961	15.79	25.93	1	
RREEF	350,000,000	408,087,515	11.85	21.04	3	
合計	1,400,000,000	1,642,079,604	12.91	21.10	—	

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	106年截至6月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (104.11.13~106.6.30)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
NNIP	300,000,000	314,224,573	8.32	9.32	3	9.57
Brandywine	300,000,000	328,423,128	10.03	14.61	1	
盧米斯	300,000,000	320,710,591	8.35	9.86	2	
合計	900,000,000	963,358,292	8.98	11.32	—	

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	106年截至6月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (105.7.20~106.6.30)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
安聯	450,000,000	466,104,026	3.98	3.99	4	0.95
摩根	450,000,000	482,941,928	6.40	7.66	1	
德意志	450,000,000	476,020,786	4.85	5.80	3	
柏瑞	450,000,000	475,744,031	6.63	5.83	2	
合計	1,800,000,000	1,900,810,771	5.46	5.82	—	

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	106年截至6月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (105.8.24~106.6.30)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
貝萊德	500,000,000	551,410,161	16.57	12.15	2	11.89
北美信託	500,000,000	546,139,512	15.72	10.94	3	
領航	500,000,000	555,421,776	17.04	14.80	1	
合計	1,500,000,000	1,652,971,449	16.45	12.63	—	

106-1 全球 ESG 混合指數被動股票型

單位：美元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	106 年截至 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (106.6.22~106.6.30)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標報酬率 (%)
貝萊德	80,000,000	79,712,037	-0.36	-0.36	1	-0.33
德意志	80,000,000	79,650,631	-0.44	-0.44	3	
道富	80,000,000	79,646,392	-0.44	-0.44	4	
北美信託	80,000,000	79,686,859	-0.39	-0.39	2	
合計	320,000,000	318,695,919	-0.41	-0.41	—	

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	106 年截至 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (104.6.22~106.6.30)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
富達國際	783,555,210	843,747,610	6.75	8.94	—	10.28

97 年續約 2 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	106 年截至 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (106.1.6~106.6.30)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
太平洋	923,576,760	968,402,846	4.85	4.85	1	3.98
盧米斯	698,763,197	731,359,679	4.66	4.66	2	
合計	1,622,339,957	1,699,762,525	4.77	4.77	—	

97 年續約 2 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	106 年截至 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (106.2.6~106.6.30)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
貝萊德	756,337,413	829,557,527	9.68	9.68	-	7.66

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	106 年截至 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (102.11.17~106.6.30)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
景順	362,187,756	453,076,564	22.54	27.65	-	18.61

100 年續約國外委託經營(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	106 年截至 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (106.3.6~106.6.30)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
貝萊德	405,588,950	420,984,713	3.80	3.80	4	3.64
道富	408,539,391	424,419,301	3.89	3.89	2	
瑞銀	406,994,133	422,511,174	3.81	3.81	3	
野村	407,549,840	423,700,872	3.96	3.96	1	
合計	1,628,672,314	1,691,616,060	3.86	3.86	-	

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	106 年截至 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (102.6.13~106.6.30)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
貝萊德	500,000,000	607,751,156	11.03	29.62	-	28.35

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	106 年截至 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (103.1.22~106.6.30)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
瑞萬通博	200,000,000	262,250,985	18.55	41.96	1	16.50
MFS	200,000,000	234,381,293	11.01	18.66	3	
威靈頓	400,000,000	475,807,987	11.79	24.05	2	
合計	800,000,000	972,440,265	13.09	27.65	—	

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	106 年截至 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (103.5.29~106.6.30)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
Lazard	300,000,000	382,523,619	19.53	31.72	1	9.74
Cohen & Steers	100,000,000	104,526,271	11.28	5.54	2	
合計	400,000,000	487,049,890	17.66	21.11	—	

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	106 年截至 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (103.8.27~106.6.30)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
PGI	300,000,000	329,265,878	6.90	11.41	1	9.53
AMP	100,000,000	105,511,746	4.08	5.06	2	
合計	400,000,000	434,777,624	6.20	9.07	—	

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	106 年截至 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (105.7.20~106.6.30)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
安聯	150,000,000	155,219,144	3.89	3.89	4	0.95
摩根	150,000,000	161,004,260	6.42	7.66	1	
德意志	150,000,000	158,656,740	4.88	5.80	3	
柏瑞	150,000,000	158,605,836	6.63	5.85	2	
合計	600,000,000	633,485,980	5.45	5.80	—	

106 年國外委託經營(全球 ESG 混合指數被動股票型)

單位：美元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	106 年截至 6 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (106.6.22~106.6.30)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
貝萊德	50,000,000	49,825,142	-0.35	-0.35	1	-0.33
德意志	50,000,000	49,782,016	-0.44	-0.44	3	
道富	50,000,000	49,752,783	-0.49	-0.49	4	
北美	50,000,000	49,805,100	-0.39	-0.39	2	
合計	200,000,000	199,165,041	-0.42	-0.42	—	

(二)106年6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)

106年6月30日

1. 避險：

種類	避險比例
權益證券避險	0%
匯率避險	5.01%

2. 投資：無

(二)舊制勞工退休基金自營部位

(依交易目的)

106年6月30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	收入	支出
106年6月	25,883,827,044	30,840,599,905	4,956,772,861

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	收入	支出
106年6月	11,295,223,439	10,071,616,594	-1,223,606,845

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

106年6月份

單位：新台幣元

項 目	金 額
基金收入	347,170,012,614
基金支出	357,774,971,452
現金增(減)數	-10,604,958,838

註：本表採現金基礎。

(二)舊制勞工退休基金

106年6月份

單位：新台幣元

項 目	金 額
基金收入	72,532,105,901
基金支出	72,531,307,180
現金增(減)數	798,721

註：本表採現金基礎。