

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 7 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	24.58%	35.02%	1.57%	48.88%	11.33%	-0.75%

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 7 月底止基金規模與收益			
基金運用規模			5 兆 9,718 億 9,137 萬元
115 年截至 7 月底止 運用收益數及收益率	自行運用	國內固定收益	98 億 2,111 萬元 1.85%
		國內權益證券 及國外投資	3,997 億 4,934 萬元 36.06%
	委託經營		9,384 億 9,665 萬元 27.12%
	合 計		1 兆 3,480 億 6,710 萬元 24.58%

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 7 月之保證收益率為 1.7108%。

2. 舊制勞工退休基金

115 年 7 月底止基金規模與收益			
基金運用規模			12,013 億 9,213 萬元
115 年截至 7 月底止 運用收益數及收益率	自行運用	國內固定收益	29 億 7,010 萬元 1.73%
		國內權益證券 及國外投資	1,584 億 8,308 萬元 87.66%
	委託經營		1,650 億 157 萬元 26.61%
	合 計		3,264 億 5,475 萬元 35.02%

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 7 月 31 日

單位：新臺幣元

項 目	餘 額	占基金運用比率(%)
自行運用	2,045,726,190,154	34.26
轉存金融機構	478,291,754,572	8.01
短期票券	152,803,509,826	2.56
公債、公司債、金融債券及特別股	251,734,539,206	4.21
股票及受益憑證投資(含期貨)	311,555,741,999	5.22
國外投資	851,340,644,551	14.26
固定收益	721,154,157,630	12.08
權益證券	84,027,862,506	1.41
另類投資	46,158,624,415	0.77
委託經營	3,926,165,175,689	65.74
國內委託經營	1,171,597,084,307	19.62
國外委託經營	2,754,568,091,382	46.12
固定收益	596,266,506,088	9.98
權益證券	1,574,426,402,328	26.36
另類投資	583,875,182,966	9.78
合 計	5,971,891,365,843	100.00

2. 舊制勞工退休基金

115 年 7 月 31 日

單位：新臺幣元

項 目	餘 額	占基金運用比率(%)
自行運用	542,814,149,168	45.18
轉存金融機構	243,818,801,079	20.29
短期票券	73,524,579,727	6.12
公債、金融債券、公司債及證券化商品	86,936,556,465	7.24
股票及受益憑證投資(含期貨)	86,679,774,630	7.21
國外投資	51,854,437,267	4.32
固定收益	29,814,460,239	2.48
權益證券	22,039,977,028	1.84
另類投資	0	0.00
委託經營	658,577,983,800	54.82
國內委託經營	183,853,928,809	15.30
國外委託經營	474,724,054,991	39.52
固定收益	110,143,623,315	9.17
權益證券	243,869,586,211	20.30
另類投資	120,710,845,465	10.05
合 計	1,201,392,132,968	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 7 月 31 日

單位：新臺幣元

項 目	金 額	占基金運用比率(%)
自 行 運 用	2,045,726,190,154	34.26
委 託 經 營	3,926,165,175,689	65.74

2. 舊制勞工退休基金

115 年 7 月 31 日

單位：新臺幣元

項 目	金 額	占基金運用比率(%)
自 行 運 用	542,814,149,168	45.18
委 託 經 營	658,577,983,800	54.82

(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 7 月 31 日

單位：新臺幣元

項 目	金 額	占基金運用比率(%)
國 內 投 資	2,365,982,629,910	39.62
國 外 投 資	3,605,908,735,933	60.38

2. 舊制勞工退休基金

115 年 7 月 31 日

單位：新臺幣元

項 目	金 額	占基金運用比率(%)
國 內 投 資	674,813,640,710	56.16
國 外 投 資	526,578,492,258	43.84

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 7 月底

項 目	收益率(%)
國內權益證券	121.15

2. 舊制勞工退休基金

115 年截至 7 月底

項 目	收益率(%)
國內權益證券	133.48

(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 7 月 31 日

單位：新臺幣元

項 目	金 額	比 率 (%)
國內權益證券	311,555,741,999	5.22

2. 舊制勞工退休基金

115 年 7 月 31 日

單位：新臺幣元

項 目	金 額	比 率 (%)
國內權益證券	86,679,774,630	7.21

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 7 月 累積投資報酬 (%)	委任迄今 (114.9.27~115.7.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	目標報酬率 (%)
野村	53,037,175,831	103,171,495,458	63.16	94.53	—	5.27

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 7 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (112.1.30~115.7.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	目標報酬率 (%)
野村	6,829,066,771	23,175,252,518	62.05	239.36	—	21.13

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 7 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (113.7.16~115.7.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	目標報酬率 (%)
野村	25,455,695,879	58,059,587,887	61.29	128.08	1	11.98
玉山	7,430,070,832	12,830,277,484	36.64	72.68	2	
合計	32,885,766,711	70,889,865,371	56.19	115.56	—	

註：1.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 7 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (111.12.5~115.7.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	目標報酬率 (%)
國泰	10,445,113,310	26,081,939,969	56.18	149.70	—	22.09

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 7 月 累積投資報酬 (%)	委任迄今 (112.7.15~115.7.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
復華	29,101,525,086	79,596,508,766	64.13	173.51	—	162.64

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 7 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (113. 7. 20~115. 7. 31)		
				投資報酬率 (%)	排名	目標報酬率 (%)
野村	15, 198, 354, 580	40, 396, 399, 644	68. 98	165. 79	1	11. 91
統一	20, 913, 151, 881	38, 985, 680, 063	40. 84	86. 42	2	
合計	36, 111, 506, 461	79, 382, 079, 707	53. 88	119. 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。

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 7 月 累積投資報酬 (%)	委任迄今 (115. 1. 24~115. 7. 31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
統一	37, 517, 851, 631	56, 336, 151, 382	50. 16	50. 16	1	36. 62
復華	39, 053, 243, 767	55, 897, 686, 273	43. 13	43. 13	2	
合計	76, 571, 095, 398	112, 233, 837, 655	46. 57	46. 57	—	

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 7 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (111. 10. 11~115. 7. 31)		
				投資報酬率 (%)	排名	目標報酬率 (%)
台新	15, 841, 461, 125	41, 322, 318, 010	46. 72	160. 85	—	23. 02

註：本批次為絕對報酬型，契約目標報酬率係以臺灣證交所公告之最近 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 7 月 累積投資報酬 (%)	委任迄今 (114.12.1~115.7.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
國泰	23,658,255,796	40,415,302,192	61.90	70.83	2	67.26
統一	20,210,724,588	34,144,349,128	60.13	68.94	4	
復華	19,554,752,074	33,339,520,716	60.64	70.49	3	
滙豐	16,812,903,049	28,296,630,865	59.58	68.30	5	
安聯	24,098,049,298	41,223,752,467	62.36	71.07	1	
合計	104,334,684,805	177,419,555,368	61.05	70.05	—	

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 7 月 累積投資報酬 (%)	委任迄今 (112.4.6~115.7.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	目標報酬率 (%)
復華	4,799,121,512	12,929,826,184	51.74	169.42	1	19.98
安聯	3,601,238,896	7,926,139,191	36.39	120.09	2	
合計	8,400,360,408	20,855,965,375	45.52	148.27	—	

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 7 月 累積投資報酬 (%)	委任迄今 (112.2.7~115.7.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	目標報酬率 (%)
安聯	15,088,712,403	44,447,329,187	49.61	200.39	1	21.00
國泰	5,018,453,600	12,530,478,206	51.66	130.42	3	
群益	6,382,621,945	13,603,740,058	38.49	113.14	4	
滙豐	7,096,535,878	17,348,896,195	56.29	144.47	2	
合計	33,586,323,826	87,930,443,646	49.30	159.79	—	

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 7 月 累積投資報酬 (%)	委任迄今 (112.10.24~115.7.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
台新	8,254,694,051	25,518,246,126	56.72	209.14	7	209.34
安聯	12,775,472,416	40,249,195,792	59.85	215.05	4	
玉山	9,403,481,285	29,896,625,207	57.76	217.93	3	
統一	12,635,490,783	39,498,492,066	59.94	212.60	6	
國泰	10,445,956,159	33,972,525,542	61.87	225.22	2	
復華	7,235,716,436	22,662,104,792	58.44	213.20	5	
群益	4,439,275,178	14,479,782,645	60.75	226.17	1	
合計	65,190,086,308	206,276,972,170	59.40	216.42	—	

註：本批次為相對報酬型，以臺灣永續報酬指數為指定指標。

107 年第二次委託經營（續約）

單位：新臺幣元

投信 名稱	委託金額	目前淨資產	115 年截至 7 月 累積投資報酬 (%)	委任迄今 (113.5.24~115.7.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	目標報酬率 (%)
安聯	13,613,817,760	30,231,598,199	48.81	123.08	3	12.86
施羅德	11,400,361,947	30,148,968,555	63.10	164.46	2	
統一	13,638,402,860	28,605,010,963	46.90	110.39	6	
野村	20,601,693,072	56,940,962,295	68.91	177.90	1	
國泰	19,457,627,824	42,021,514,983	62.14	115.96	5	
復華	9,724,896,734	21,096,859,167	51.22	116.94	4	
合計	88,436,800,197	209,044,914,162	58.54	137.27	—	

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 7 月 累積投資報酬 (%)	委任迄今 (115.5.31~115.7.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	目標報酬率 (%)
台新	17,743,902,371	16,416,991,185	-7.48	-7.48	1	1.36
安聯	25,118,214,883	22,752,979,420	-9.42	-9.42	3	
玉山	18,706,659,825	16,064,777,486	-14.12	-14.12	5	
國泰	23,159,171,521	21,117,075,101	-8.82	-8.82	2	
野村	34,803,007,809	30,727,399,354	-11.71	-11.71	4	
合計	119,530,956,409	107,079,222,546	-10.42	-10.42	—	

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 7 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (111.5.13~115.7.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
安聯	3,000,000,000	7,088,003,475	39.21	127.91	3	125.54
玉山	3,000,000,000	7,046,409,838	35.61	128.36	2	
野村	3,000,000,000	7,058,698,601	32.70	123.75	4	
國泰	3,000,000,000	7,299,682,641	35.37	133.64	1	
富邦	3,000,000,000	6,973,552,798	34.97	121.66	5	
合計	15,000,000,000	35,466,347,353	35.54	127.06	—	

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 7 月 累積投資報酬 (%)	委任迄今 (110.12.15~115.7.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	目標報酬率 (%)
安聯	8,000,000,000	21,201,075,224	49.61	172.90	2	28.08
玉山	8,000,000,000	16,562,402,836	36.49	111.10	6	
國泰	8,000,000,000	20,580,006,389	62.65	169.96	3	
第一金	8,000,000,000	17,031,604,335	61.84	112.47	5	
野村	8,000,000,000	24,613,117,899	63.32	210.54	1	
富邦	8,000,000,000	21,079,896,694	49.04	168.64	4	
合計	48,000,000,000	121,068,103,377	53.84	157.62	—	

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。

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 7 月 累積投資報酬 (%)	委任迄今 (112.10.5~115.7.31)		
				投資 報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
安聯	7,000,000,000	12,706,419,190	35.42	107.19	6	16.81
施罗德	7,000,000,000	18,530,231,676	60.53	205.07	2	
國泰	7,000,000,000	15,293,632,896	53.59	160.05	3	
第一金	7,000,000,000	15,089,595,873	59.47	112.55	5	
野村	7,000,000,000	19,452,951,069	68.90	213.75	1	
華南 永昌	7,000,000,000	9,121,413,882	24.12	40.13	7	
滙豐	7,000,000,000	14,552,780,847	54.80	131.18	4	
合計	49,000,000,000	104,747,025,433	52.66	138.13	—	

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 7 月 累積投資報酬 (%)	委任迄今 (114.4.1~115.7.31)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標報酬率 (%)
安聯	9,000,000,000	13,507,194,558	56.17	150.00	1	116.73
兆豐 國際	9,000,000,000	12,874,751,853	49.57	127.03	3	
宏利	9,000,000,000	13,017,408,018	56.22	127.77	2	
施羅德	9,000,000,000	12,735,007,874	51.63	118.23	6	
野村	9,000,000,000	12,823,234,724	52.50	120.54	5	
摩根	9,000,000,000	12,903,392,256	52.54	124.43	4	
合計	54,000,000,000	77,860,989,283	53.13	128.00	—	

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 7 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (114.11.14~115.7.31)		
				投資 報酬率(%)	排名	目標報酬率 (%)
安聯	9,000,000,000	12,279,463,586	40.37	46.66	5	4.44
貝萊德	9,000,000,000	13,053,425,511	52.22	57.84	2	
施羅德	9,000,000,000	13,497,748,336	51.68	61.63	1	
野村	9,000,000,000	12,623,775,612	47.30	54.24	4	
摩根	9,000,000,000	13,042,654,095	51.13	56.98	3	
合計	45,000,000,000	64,497,067,140	48.56	55.50	—	

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 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 7 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (115.6.9~115.7.31)		
				投資 報酬率(%)	排名	目標報酬率 (%)
元大	5,000,000,000	4,902,240,425	-5.26	-5.26	1	0.90
安聯	5,000,000,000	4,758,895,333	-13.39	-13.39	3	
施羅德	5,000,000,000	4,805,757,397	-18.30	-18.30	5	
野村	5,000,000,000	4,750,492,655	-17.29	-17.29	4	
摩根	5,000,000,000	4,919,471,719	-10.84	-10.84	2	
合計	25,000,000,000	24,136,857,529	-12.99	-12.99	—	

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。

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 7 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (114.1.28~115.7.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	目標報酬率 (%)
富邦	15,603,507,854	32,320,138,788	51.85	107.13	1	9.47
統一	13,492,877,440	26,790,911,817	48.04	98.56	2	
合計	29,096,385,294	59,111,050,605	50.10	103.16	—	

註：本批次為絕對報酬型，契約目標報酬率係以臺灣證交所公告之最近 5 年年底股票集中市場平均殖利率加計 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 7 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (113.11.2~115.7.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
滙豐	6,530,798,735	13,425,179,562	53.13	105.57	—	97.78

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 7 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (113.5.4~115.7.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	目標報酬率 (%)
野村	27,357,530,009	78,465,559,204	67.52	186.82	—	13.20

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 7 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (112.4.6~115.7.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	目標報酬率 (%)
復華	4,800,107,976	12,931,832,350	51.74	169.41	1	19.98
安聯	2,601,947,821	6,928,377,916	34.43	116.93	2	
合計	7,402,055,797	19,860,210,266	44.53	146.60	—	

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

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 7 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (112.2.7~115.7.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	目標報酬率 (%)
安聯	15,089,937,312	44,451,751,213	49.61	200.39	1	21.00
國泰	3,019,107,110	10,627,945,460	50.67	128.93	3	
群益	4,384,957,618	11,811,294,891	38.42	113.09	4	
滙豐	5,597,524,598	15,904,763,483	55.89	143.85	2	
合計	28,091,526,638	82,795,755,047	48.85	159.01	—	

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 名稱	委託金額	目前淨資產	115 年截至 7 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (111.5.13~115.7.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
安聯	1,000,000,000	2,330,215,349	37.28	124.83	2	125.54
玉山	1,000,000,000	2,302,140,221	32.90	123.82	3	
野村	1,000,000,000	2,297,488,877	29.56	118.48	5	
國泰	1,000,000,000	2,374,031,106	32.05	127.99	1	
富邦	1,000,000,000	2,293,703,108	33.17	118.86	4	
合計	5,000,000,000	11,597,578,661	32.95	122.80	—	

註：本批次為相對報酬型，以臺灣企業社會責任中小型報酬指數為指定指標。

國內 111 年第一次委託經營

單位：新臺幣元

投信 名稱	委託金額	目前淨資產	115 年截至 7 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (112.10.5~115.7.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	目標報酬率 (%)
安聯	3,000,000,000	5,395,348,747	35.98	109.49	6	16.81
施羅德	3,000,000,000	7,802,702,228	60.63	206.65	2	
國泰	3,000,000,000	6,513,458,038	53.80	164.89	3	
第一金	3,000,000,000	6,612,291,633	59.57	113.72	5	
野村	3,000,000,000	8,185,169,896	68.87	212.61	1	
華南永昌	3,000,000,000	3,966,553,054	24.11	43.56	7	
滙豐	3,000,000,000	6,160,765,344	54.81	132.85	4	
合計	21,000,000,000	44,636,288,940	52.73	140.08	—	

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 7 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	115 年截至 7 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (115.6.7~115.7.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
聯博	900,495,639	897,752,897	-0.30	-0.30	1	-0.48
富蘭克林 坦伯頓	1,338,657,958	1,334,569,313	-0.31	-0.31	2	
合計	2,239,153,597	2,232,322,210	-0.31	-0.31	—	

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 7 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (111.1.6~115.7.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
PIMCO	2,408,967,886	2,364,612,047	-2.30	-4.96	—	-7.49

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 7 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (111.2.6~115.7.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
貝萊德	2,034,805,538	3,608,745,347	16.94	87.93	1	67.54
JPMorgan	1,585,120,883	2,656,287,171	11.15	69.68	2	
合計	3,619,926,421	6,265,032,518	14.34	79.49	—	

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 7 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (111.11.17~115.7.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
景順	656,507,639	1,304,933,202	18.17	98.77	—	88.20

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 7 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (111.12.4~115.7.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
貝萊德	1,321,092,316	2,348,868,079	11.68	88.27	2	87.05
道富	1,783,655,177	3,175,972,208	11.62	89.73	1	
合計	3,104,747,493	5,524,840,287	11.65	89.10	—	

100-1 全球基本面指數被動股票型（續約 3） 單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	115 年截至 7 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (115.7.1~115.7.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
道富	1,683,240,295	1,714,089,252	1.83	1.83	1	1.74
貝萊德	1,687,228,552	1,711,777,799	1.46	1.46	2	
合計	3,370,468,847	3,425,867,051	1.64	1.64	—	

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 7 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (111.3.6~115.7.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
Cohen & Steers	2,555,932,432	2,941,839,542	11.61	13.06	1	9.59
景順	1,417,127,452	1,552,479,450	12.84	8.07	2	
合計	3,973,059,884	4,494,318,992	12.06	11.17	—	

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	115 年截至 7 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (111. 7. 31~115. 7. 31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
Pictet	618, 843, 493	769, 778, 438	-1. 64	24. 97	—	27. 28

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	115 年截至 7 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (112. 4. 18~115. 7. 31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
道富	1, 263, 392, 347	1, 666, 508, 211	5. 23	34. 50	2	33. 37
貝萊德	1, 352, 011, 599	1, 781, 352, 129	5. 19	34. 71	1	
合計	2, 615, 403, 946	3, 447, 860, 340	5. 21	34. 60	—	

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 7 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (113. 1. 22~115. 7. 31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
瑞萬通博	1, 796, 000, 834	2, 098, 200, 969	2. 20	17. 44	3	50. 83
MFS	1, 164, 480, 846	1, 785, 160, 367	18. 27	54. 01	1	
威靈頓	1, 507, 914, 919	2, 290, 978, 822	14. 42	52. 79	2	
合計	4, 468, 396, 599	6, 174, 340, 158	10. 96	38. 90	—	

102-1 全球信用主動債券型（續約 2）

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	115 年截至 7 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (113.4.25~115.7.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
RBC	1,186,559,371	1,352,096,519	-1.30	14.57	1	13.76
貝萊德	670,392,768	760,653,316	-1.08	13.46	3	
盧米斯	941,561,542	1,065,528,056	-0.97	13.51	2	
合計	2,798,513,681	3,178,277,891	-1.14	13.93	—	

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 7 月 累積投資報酬 (%)	委任迄今 (114.8.11~115.7.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
北美信託	3,222,313,413	3,904,111,203	10.26	21.21	1	21.99
L&G	3,208,355,339	3,866,001,108	9.75	20.56	3	
Geode	3,189,006,741	3,853,735,625	10.02	20.90	2	
合計	9,619,675,493	11,623,847,936	10.01	20.89	—	

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 7 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (114.9.25~115.7.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
Magellan	1,159,305,130	1,318,692,011	9.58	13.75	1	12.47
RREEF	1,668,471,152	1,836,404,740	9.08	10.07	2	
合計	2,827,776,282	3,155,096,751	9.29	11.58	—	

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 7 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (114.11.13~115.7.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率(%)
盧米斯	819,799,803	807,373,161	-2.46	-1.52	—	-1.73

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 7 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (115.7.20~115.7.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標/目標報酬率(%)
Allianz	1,187,189,098	1,186,922,143	-0.02	-0.02	3	0.12/0.29
JPMorgan	1,826,834,228	1,837,933,172	0.61	0.61	2	
DWS	1,511,379,825	1,523,602,986	0.81	0.81	1	
合計	4,525,403,151	4,548,458,301	0.51	0.51	—	

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	115 年截至 7 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (110.8.24~115.7.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
貝萊德	949,175,052	1,656,860,388	26.00	74.56	—	68.66

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 7 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (111.6.22~115.7.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
貝萊德	641,552,002	1,179,392,915	19.06	91.71	4	91.40
DWS	848,715,051	1,520,309,377	19.05	96.07	1	
道富	849,045,562	1,538,613,293	19.02	95.78	2	
北美信託	762,047,560	1,408,516,487	19.05	93.77	3	
合計	3,101,360,175	5,646,832,072	19.04	94.42	—	

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 7 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (111.7.25~115.7.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標/目標 報酬率(%)
American Century	427,360,620	523,380,643	1.87	22.47	3	18.93/28.98
富達	905,211,657	1,164,994,046	1.77	27.35	1	
TCW	1,039,618,153	1,287,714,646	1.87	23.84	2	
合計	2,372,190,430	2,976,089,335	1.83	25.09	—	

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 7 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (113.1.23~115.7.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標/目標 報酬率(%)
景順	1,006,698,949	1,523,316,004	14.33	60.08	1	11.22/23.83
威靈頓	867,219,463	1,147,513,598	5.47	35.44	4	
CPR	938,885,217	1,316,573,361	12.73	45.70	3	
道富	806,462,703	1,142,750,317	8.33	47.11	2	
合計	3,619,266,332	5,130,153,280	10.51	47.36	—	

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 7 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (113.12.18~115.7.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
Nomura	559,865,985	792,418,771	11.16	42.23	1	44.12
荷寶	506,416,368	697,308,846	9.22	38.82	3	
道富	441,937,598	621,979,937	9.22	40.74	2	
合計	1,508,219,951	2,111,707,554	9.94	40.66	—	

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 7 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (115.1.13~115.7.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
Insight	1,059,063,706	1,049,063,723	-0.90	-0.90	3	-0.71
JPMorgan	558,802,476	554,364,692	-0.73	-0.73	1	
PIMCO	674,765,647	668,540,853	-0.89	-0.89	2	
合計	2,292,631,829	2,271,969,268	-0.86	-0.86	—	

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 7 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (110.9.8~115.7.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
CBRE	430,000,000	578,472,486	9.54	38.61	3	39.91
Clearbridge	700,000,000	957,679,882	12.63	52.49	1	
Magellan	350,000,000	487,745,804	8.04	37.25	4	
RREEF	430,000,000	583,830,731	11.96	39.50	2	
合計	1,910,000,000	2,607,728,903	10.77	42.39	—	

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 7 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (110.10.15~115.7.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標/目標 報酬率(%)
富達	400,000,000	515,794,235	11.39	28.42	2	19.47/43.46
JPMorgan	400,000,000	487,389,833	3.08	21.63	5	
Ninety One	400,000,000	491,940,624	3.02	22.34	4	
Schroders	400,000,000	538,651,033	7.72	34.11	1	
T. Rowe Price	400,000,000	509,014,558	6.99	25.76	3	
合計	2,000,000,000	2,542,790,283	6.43	26.45	—	

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 7 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (112.4.28~115.7.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
滙豐	400,000,000	617,340,295	11.75	81.85	2	73.15
LGIM	400,000,000	593,041,556	8.21	72.73	4	
摩根士丹利	400,000,000	603,262,281	9.51	73.91	3	
Schroders	400,000,000	580,538,915	8.19	70.05	5	
威靈頓	400,000,000	616,317,921	9.92	81.92	1	
合計	2,000,000,000	3,010,500,968	9.53	76.09	—	

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 7 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (112.7.19~115.7.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標/目標 報酬率(%)
盧米斯	600,000,000	687,485,218	0.90	20.93	2	14.22/21.82
Ninety One	500,000,000	585,326,949	1.32	19.64	4	
PIMCO	500,000,000	592,402,750	0.99	20.73	3	
PGIM	600,000,000	688,857,784	2.70	21.35	1	
T. Rowe Price	500,000,000	557,844,230	2.60	12.60	6	
威靈頓	500,000,000	574,633,525	3.27	17.70	5	
合計	3,200,000,000	3,686,550,456	1.93	18.83	—	

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 7 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (113.6.27~115.7.31)		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率(%)
Amundi	400,000,000	532,527,714	11.39	38.88	4	43.51
L&G	400,000,000	544,159,304	11.41	43.30	3	
道富	400,000,000	546,139,746	11.52	44.06	1	
北美信託	400,000,000	546,102,748	11.52	43.84	2	
合計	1,600,000,000	2,168,929,512	11.46	42.52	—	

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 7 月 累積投資報酬 (%)	委任迄今 (114.6.18~115.7.31)		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率(%)
貝萊德	400,000,000	450,426,531	12.95	15.44	4	15.44
Center Square	400,000,000	458,409,894	15.25	17.27	1	
富達	400,000,000	454,110,042	13.44	16.31	2	
RREEF	400,000,000	453,176,548	13.76	15.96	3	
合計	1,600,000,000	1,816,123,015	13.85	16.25	—	

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 7 月 累積投資報酬 (%)	委任迄今 (114.11.25~115.7.31)		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率(%)
貝萊德	400,000,000	423,356,755	7.65	11.17	1	10.43
HSBC	400,000,000	421,747,465	7.14	10.32	4	
道富	400,000,000	421,814,640	7.10	10.47	3	
UBS	400,000,000	422,040,147	7.16	10.54	2	
合計	1,600,000,000	1,688,959,007	7.26	10.63	—	

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 7 月 累積投資報酬率 (%)	委任迄今 (113.6.24~115.7.31)		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率(%)
富達	753,144,454	1,000,473,186	8.76	32.84	—	27.53

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 7 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (111.1.6~115.7.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
PIMCO	1,003,724,736	955,925,026	-2.24	-4.76	1	-7.49
盧米斯	1,018,693,762	951,725,548	-1.47	-7.77	2	
合計	2,022,418,498	1,907,650,574	-1.85	-6.23	—	

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	115 年截至 7 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (111.2.6~115.7.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
貝萊德	456,987,544	1,504,388,734	16.45	86.91	—	67.54

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 7 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (111.11.17~115.7.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
景順	181,124,998	388,876,019	18.14	97.47	—	88.20

100-1 全球基本面指數被動股票型(續約 3)

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	115 年截至 7 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (115.7.1~115.7.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
貝萊德	303,753,501	308,345,333	1.51	1.51	4	1.74
道富	456,179,013	464,380,516	1.80	1.80	1	
瑞銀	361,201,485	367,521,178	1.75	1.75	2	
Nomura	405,779,245	412,290,581	1.60	1.60	3	
合計	1,526,913,244	1,552,537,608	1.68	1.68	—	

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	115 年截至 7 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (112.4.18~115.7.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
貝萊德	751,993,706	1,013,212,614	5.16	34.74	—	33.37

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 7 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (113.1.22~115.7.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
瑞萬通博	414,056,068	485,988,414	2.19	17.37	3	50.83
MFS	315,296,707	485,100,246	18.23	53.86	1	
威靈頓	704,502,354	1,076,341,328	14.42	52.78	2	
合計	1,433,855,129	2,047,429,988	12.09	42.79	—	

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 7 月 累積投資報酬 (%)	委任迄今 (113.5.29~115.7.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
Lazard	954,418,976	1,388,520,134	5.50	45.48	—	40.03

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 7 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (113.8.27~115.7.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
信安環球	708,888,643	801,020,312	12.41	13.00	2	15.22
Nomura	144,937,350	174,802,014	13.79	20.61	1	
合計	853,825,993	975,822,326	12.66	14.29	—	

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 7 月 累積投資報酬 (%)	委任迄今 (115.7.20~115.7.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標/目標 報酬率(%)
Allianz	275,923,278	275,639,320	-0.10	-0.10	3	0.12/0.29
摩根	440,558,255	442,701,115	0.49	0.49	2	
DWS	443,166,315	446,332,480	0.71	0.71	1	
合計	1,159,647,848	1,164,672,915	0.43	0.43	—	

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 7 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (111.6.22~115.7.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
貝萊德	127,303,524	243,246,878	18.93	91.08	4	91.40
DWS	147,528,441	288,944,122	19.01	95.86	1	
道富	157,982,595	308,803,058	18.90	95.47	2	
北美信託	158,484,700	306,792,507	19.08	93.58	3	
合計	591,299,260	1,147,786,565	18.98	94.11	—	

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	115 年截至 7 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (111.7.25~115.7.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標/目標 報酬率(%)
American Century	319,635,794	391,326,795	1.88	22.43	3	18.93/28.98
富達	279,785,344	361,976,287	1.78	27.89	1	
TCW	328,000,470	409,014,201	1.96	24.70	2	
合計	927,421,608	1,162,317,283	1.88	24.97	—	

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 7 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (113.1.23~115.7.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標/目標 報酬率(%)
景順	116,977,839	187,362,563	14.44	60.17	1	11.22/23.83
威靈頓	107,476,614	145,514,023	5.44	35.39	3	
CPR	115,110,097	167,820,235	12.81	45.79	2	
合計	339,564,550	500,696,821	11.15	47.45	—	

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 7 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (110.9.8~115.7.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
CBRE	60,000,000	82,391,662	9.55	38.95	3	39.91
ClearBridge	60,000,000	90,179,012	12.57	54.23	1	
Magellan	60,000,000	73,920,654	8.02	38.19	4	
RREEF	60,000,000	83,221,636	11.95	40.38	2	
合計	240,000,000	329,712,964	10.61	42.52	—	

(二)115 年 7 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7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7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7月份	-179,686,975,241	181,456,083,956	361,143,059,197

(二)舊制勞工退休基金

單位：新臺幣元

	餘絀	收入	支出
115年7月份	-52,719,783,445	-52,485,104,460	234,678,985

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 7 月份		單位：新臺幣元
項 目	金 額	
現金收入	283,475,601,649	
現金支出	294,087,733,562	
現金增(減)數		-10,612,131,913

(二)舊制勞工退休基金

115 年 7 月份		單位：新臺幣元
項 目	金 額	
現金收入	95,358,832,332	
現金支出	95,358,246,286	
現金增(減)數		586,046