

## 勞工退休基金運用情形

### 一、勞工退休基金整體績效

#### (一) 113 年截至 7 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 | Bloomberg<br>全球債券指數 |
|---------|--------|--------|-------------------|--------------|-----------------|---------------------|
| 收益率/報酬率 | 14.24% | 16.42% | 1.48%             | 23.81%       | 13.10%          | -0.49%              |

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(112 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 | Bloomberg<br>全球債券指數 |
|---------|--------|--------|-------------------|--------------|-----------------|---------------------|
| 收益率/報酬率 | 12.60% | 14.83% | 1.21%             | 26.83%       | 22.20%          | 5.72%               |

#### (三) 近三年(110~112 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 | Bloomberg<br>全球債券指數 |
|---------|-------|-------|-------------------|--------------|-----------------|---------------------|
| 收益率/報酬率 | 5.26% | 5.83% | 0.96%             | 6.77%        | 5.75%           | -5.51%              |

#### (四) 近五年(108~112 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 | Bloomberg<br>全球債券指數 |
|---------|-------|-------|-------------------|--------------|-----------------|---------------------|
| 收益率/報酬率 | 6.51% | 7.90% | 0.81%             | 13.01%       | 11.72%          | -0.32%              |

## 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

| 113 年 7 月底止基金規模與收益         |      |                 |                            |
|----------------------------|------|-----------------|----------------------------|
| 基金運用規模                     |      |                 | 4 兆 4,714 億 9,220 萬元       |
| 113 年截至 7 月底止<br>運用收益數及收益率 | 自行運用 | 國內固定收益          | 74 億 6,719 萬元<br>1.58%     |
|                            |      | 國內權益證券<br>及國外投資 | 1,766 億 6,812 萬元<br>19.90% |
|                            | 委託經營 |                 | 4,139 億 6,023 萬元<br>16.58% |
|                            | 合 計  |                 | 5,980 億 9,554 萬元<br>14.24% |

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 3：113 年 7 月之保證收益率為 1.7108%。

#### 2. 舊制勞工退休基金

| 113 年 7 月底止基金規模與收益         |      |                 |                            |
|----------------------------|------|-----------------|----------------------------|
| 基金運用規模                     |      |                 | 10,556 億 7,583 萬元          |
| 113 年截至 7 月底止<br>運用收益數及收益率 | 自行運用 | 國內固定收益          | 25 億 5,380 萬元<br>1.52%     |
|                            |      | 國內權益證券<br>及國外投資 | 677 億 9,726 萬元<br>30.69%   |
|                            | 委託經營 |                 | 738 億 1,712 萬元<br>14.21%   |
|                            | 合 計  |                 | 1,441 億 6,818 萬元<br>16.42% |

註：評價後報酬率係以當期報酬率（即收益÷113 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

113 年 7 月 31 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>1,799,422,522,858</b> | <b>40.24</b>  |
| 轉存金融機構          | 532,948,866,423          | 11.92         |
| 短期票券            | 86,744,877,347           | 1.94          |
| 公債、公司債、金融債券及特別股 | 232,153,806,251          | 5.19          |
| 股票及受益憑證投資(含期貨)  | 228,978,865,322          | 5.12          |
| 國外投資            | 718,596,107,515          | 16.07         |
| 固定收益            | 602,034,111,898          | 13.46         |
| 權益證券            | 58,626,602,017           | 1.31          |
| 另類投資            | 57,935,393,600           | 1.30          |
| <b>委託經營</b>     | <b>2,672,069,676,908</b> | <b>59.76</b>  |
| 國內委託經營          | 615,157,422,925          | 13.76         |
| 國外委託經營          | 2,056,912,253,983        | 46.00         |
| 固定收益            | 538,525,873,727          | 12.04         |
| 權益證券            | 1,062,690,902,769        | 23.77         |
| 另類投資            | 455,695,477,487          | 10.19         |
| <b>合 計</b>      | <b>4,471,492,199,766</b> | <b>100.00</b> |

## 2. 舊制勞工退休基金

113 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              | 511,499,792,310   | 48.45      |
| 轉存金融機構            | 154,172,266,796   | 14.60      |
| 短期票券              | 63,899,102,296    | 6.05       |
| 公債、金融債券、公司債及證券化商品 | 76,757,537,763    | 7.27       |
| 股票及受益憑證投資(含期貨)    | 114,609,974,867   | 10.86      |
| 國外投資              | 102,060,910,588   | 9.67       |
| 固定收益              | 57,090,335,021    | 5.41       |
| 權益證券              | 36,158,116,959    | 3.43       |
| 另類投資              | 8,812,458,608     | 0.83       |
| 委託經營              | 544,176,034,421   | 51.55      |
| 國內委託經營            | 116,491,532,521   | 11.04      |
| 國外委託經營            | 427,684,501,900   | 40.51      |
| 固定收益              | 105,037,649,339   | 9.95       |
| 權益證券              | 217,225,443,618   | 20.57      |
| 另類投資              | 105,421,408,943   | 9.99       |
| 合 計               | 1,055,675,826,731 | 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

113 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 | 1,799,422,522,858 | 40.24      |
| 委託經營 | 2,672,069,676,908 | 59.76      |

#### 2. 舊制勞工退休基金

113 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 | 511,499,792,310 | 48.45      |
| 委託經營 | 544,176,034,421 | 51.55      |

#### (四)基金國內投資與國外投資比率

##### 1. 新制勞工退休基金

113 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 | 1,695,983,838,268 | 37.93      |
| 國 外 投 資 | 2,775,508,361,498 | 62.07      |

##### 2. 舊制勞工退休基金

113 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 | 525,930,414,243 | 49.82      |
| 國 外 投 資 | 529,745,412,488 | 50.18      |

#### 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

113 年截至 7 月底

| 項 目    | 收益率(%) |
|--------|--------|
| 國內權益證券 | 46.89  |

##### 2. 舊制勞工退休基金

113 年截至 7 月底

| 項 目    | 收益率(%) |
|--------|--------|
| 國內權益證券 | 44.19  |

## (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

113 年 7 月 31 日

單位：新臺幣元

| 項 目    | 金 額             | 比 率 (%) |
|--------|-----------------|---------|
| 國內權益證券 | 228,978,865,322 | 5.12    |

### 2. 舊制勞工退休基金

113 年 7 月 31 日

單位：新臺幣元

| 項 目    | 金 額             | 比 率 (%) |
|--------|-----------------|---------|
| 國內權益證券 | 114,609,974,867 | 10.86   |

## 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          | 113 年截至 7 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(111.9.27~113.7.31) |    |              |
|----------|----------------|----------------|--------------------------|-----------------------------|----|--------------|
|          |                |                |                          | 投資報酬率<br>(%)                | 排名 | 目標報酬率<br>(%) |
| 野村       | 28,072,603,831 | 40,458,601,781 | 16.69                    | 44.12                       | —  | 11.54        |

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。

#### 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         | 113 年截至 7 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(112.1.30~113.7.31) |    |              |
|----------|---------------|---------------|--------------------------|-----------------------------|----|--------------|
|          |               |               |                          | 投資報酬率<br>(%)                | 排名 | 目標報酬率<br>(%) |
| 野村       | 6,829,066,771 | 9,434,184,123 | 16.07                    | 38.15                       | —  | 9.43         |

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<br>名稱 | 委託金額           | 目前淨資產          | 113 年截至 7 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(113.7.16~113.7.31) |    |              |
|----------|----------------|----------------|--------------------------|-----------------------------|----|--------------|
|          |                |                |                          | 投資報酬率<br>(%)                | 排名 | 目標報酬率<br>(%) |
| 野村       | 25,455,695,879 | 23,515,272,616 | -7.62                    | -7.62                       | 2  | 0.27         |
| 保德信      | 7,430,070,832  | 7,206,259,793  | -3.01                    | -3.01                       | 1  |              |
| 合計       | 32,885,766,711 | 30,721,532,409 | -6.58                    | -6.58                       | —  |              |

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

## 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          | 113 年截至 7 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(111.12.5~113.7.31) |    |              |
|----------|----------------|----------------|--------------------------|-----------------------------|----|--------------|
|          |                |                |                          | 投資報酬率<br>(%)                | 排名 | 目標報酬率<br>(%) |
| 國泰       | 10,445,113,310 | 12,920,689,255 | 12.45                    | 23.70                       | —  | 10.38        |

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          | 113 年截至 7 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(112.7.15~113.7.31) |    |              |
|----------|----------------|----------------|--------------------------|-----------------------------|----|--------------|
|          |                |                |                          | 投資報酬率<br>(%)                | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| 復華       | 29,101,525,086 | 35,929,738,494 | 17.89                    | 23.46                       | —  | 24.58        |

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<br>名稱 | 委託金額           | 目前淨資產          | 113 年截至 7 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(113.7.20~113.7.31) |    |              |
|----------|----------------|----------------|--------------------------|-----------------------------|----|--------------|
|          |                |                |                          | 投資報酬率<br>(%)                | 排名 | 目標報酬率<br>(%) |
| 野村       | 15,198,354,580 | 14,758,026,532 | -2.90                    | -2.90                       | 1  | 0.20         |
| 統一       | 20,913,151,881 | 20,181,956,224 | -3.50                    | -3.50                       | 2  |              |
| 合計       | 36,111,506,461 | 34,939,982,756 | -3.24                    | -3.24                       | —  |              |

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 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          | 113 年截至 7 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(111.1.24~113.7.31) |    |              |
|----------|----------------|----------------|--------------------------|-----------------------------|----|--------------|
|          |                |                |                          | 投資報酬率<br>(%)                | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| 統一       | 14,437,134,744 | 20,208,644,252 | 25.83                    | 39.98                       | 1  | 37.24        |
| 復華       | 18,009,802,076 | 23,536,143,315 | 25.70                    | 29.44                       | 2  |              |
| 合計       | 32,446,936,820 | 43,744,787,567 | 25.75                    | 33.98                       | —  |              |

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          | 113 年截至 7 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(111.10.11~113.7.31) |    |              |
|----------|----------------|----------------|--------------------------|------------------------------|----|--------------|
|          |                |                |                          | 投資報酬率<br>(%)                 | 排名 | 目標報酬率<br>(%) |
| 台新       | 15,841,461,125 | 22,045,843,869 | 12.68                    | 39.17                        | —  | 11.31        |

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          | 113 年截至 7 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(110.12.1~113.7.31) |    |              |
|----------|----------------|----------------|--------------------------|-----------------------------|----|--------------|
|          |                |                |                          | 投資報酬率<br>(%)                | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| 國泰       | 14,836,482,661 | 21,183,303,360 | 19.68                    | 44.46                       | 5  | 48.89        |
| 統一       | 11,353,734,691 | 16,709,475,317 | 19.80                    | 47.17                       | 1  |              |
| 復華       | 10,890,868,617 | 15,899,175,513 | 19.72                    | 45.99                       | 2  |              |
| 滙豐       | 10,790,827,015 | 15,643,608,949 | 19.51                    | 44.97                       | 3  |              |
| 安聯       | 15,017,345,063 | 21,516,640,147 | 19.16                    | 44.80                       | 4  |              |
| 合計       | 62,889,258,047 | 90,952,203,286 | 19.56                    | 45.40                       | —  |              |

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          | 113 年截至 7 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(112.4.6~113.7.31) |    |              |
|----------|---------------|----------------|--------------------------|----------------------------|----|--------------|
|          |               |                |                          | 投資報酬率<br>(%)               | 排名 | 目標報酬率<br>(%) |
| 復華       | 4,799,121,512 | 6,111,934,070  | 14.77                    | 27.36                      | 1  | 8.27         |
| 安聯       | 3,601,238,896 | 4,457,200,303  | 14.85                    | 23.77                      | 2  |              |
| 合計       | 8,400,360,408 | 10,569,134,373 | 14.80                    | 25.82                      | —  |              |

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。

### 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          | 113 年截至 7 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(112.2.7~113.7.31) |    |              |
|----------|----------------|----------------|--------------------------|----------------------------|----|--------------|
|          |                |                |                          | 投資報酬率<br>(%)               | 排名 | 目標報酬率<br>(%) |
| 安聯       | 14,088,712,403 | 19,216,978,285 | 16.74                    | 36.40                      | 1  | 9.29         |
| 國泰       | 6,318,453,600  | 8,005,892,116  | 13.04                    | 26.71                      | 2  |              |
| 群益       | 6,382,621,945  | 7,947,455,510  | 7.20                     | 24.52                      | 4  |              |
| 滙豐       | 7,096,535,878  | 8,836,425,670  | 11.80                    | 24.52                      | 3  |              |
| 合計       | 33,886,323,826 | 44,006,751,581 | 13.24                    | 29.87                      | —  |              |

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<br>名稱 | 委託金額           | 目前淨資產          | 113 年截至 7 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(112.10.24~113.7.31) |    |              |
|----------|----------------|----------------|--------------------------|------------------------------|----|--------------|
|          |                |                |                          | 投資報酬率<br>(%)                 | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| 台新       | 8,254,694,051  | 11,814,742,311 | 29.12                    | 43.13                        | 2  | 43.32        |
| 安聯       | 12,775,472,416 | 18,178,384,766 | 29.02                    | 42.29                        | 4  |              |
| 保德信      | 9,403,481,285  | 13,472,318,798 | 29.85                    | 43.27                        | 1  |              |
| 統一       | 12,635,490,783 | 17,952,841,226 | 28.70                    | 42.08                        | 5  |              |
| 國泰       | 10,445,956,159 | 14,660,855,068 | 27.67                    | 40.35                        | 7  |              |
| 復華       | 7,235,716,436  | 10,324,241,972 | 29.24                    | 42.68                        | 3  |              |
| 群益       | 4,439,275,178  | 6,293,852,576  | 28.50                    | 41.78                        | 6  |              |
| 合計       | 65,190,086,308 | 92,697,236,717 | 28.86                    | 42.20                        | —  |              |

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<br>名稱 | 委託金額           | 目前淨資產          | 113 年截至 7 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(113.5.24~113.7.31) |    |              |
|----------|----------------|----------------|--------------------------|-----------------------------|----|--------------|
|          |                |                |                          | 投資報酬率<br>(%)                | 排名 | 目標報酬率<br>(%) |
| 安聯       | 11,613,817,760 | 11,837,138,073 | 1.92                     | 1.92                        | 5  | 1.15         |
| 施罗德      | 11,400,361,947 | 11,592,286,638 | 1.68                     | 1.68                        | 6  |              |
| 統一       | 11,638,402,860 | 12,032,042,198 | 3.38                     | 3.38                        | 2  |              |
| 野村       | 18,601,693,072 | 19,018,131,738 | 2.24                     | 2.24                        | 4  |              |
| 國泰       | 19,457,627,824 | 20,454,156,541 | 5.12                     | 5.12                        | 1  |              |
| 復華       | 9,724,896,734  | 9,988,012,739  | 2.71                     | 2.71                        | 3  |              |
| 合計       | 82,436,800,197 | 84,921,767,927 | 3.01                     | 3.01                        | —  |              |

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。

## 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          | 113 年截至 7 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(110.5.13~113.7.31) |    |              |
|----------|----------------|----------------|--------------------------|-----------------------------|----|--------------|
|          |                |                |                          | 投資報酬率<br>(%)                | 排名 | 目標報酬率<br>(%) |
| 台新       | 8,000,000,000  | 10,559,634,625 | 13.43                    | 32.00                       | 3  | 18.60        |
| 安聯       | 8,000,000,000  | 10,569,245,909 | 17.88                    | 32.12                       | 2  |              |
| 保德信      | 8,000,000,000  | 9,672,246,924  | 11.98                    | 20.90                       | 5  |              |
| 國泰       | 8,000,000,000  | 11,444,663,485 | 20.84                    | 43.06                       | 1  |              |
| 野村       | 8,000,000,000  | 10,454,238,538 | 16.98                    | 30.68                       | 4  |              |
| 合計       | 40,000,000,000 | 52,700,029,481 | 16.28                    | 31.75                       | —  |              |

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          | 113 年截至 7 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(111.5.13~113.7.31) |    |              |
|----------|----------------|----------------|--------------------------|-----------------------------|----|--------------|
|          |                |                |                          | 投資報酬率<br>(%)                | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| 安聯       | 3,000,000,000  | 4,968,186,728  | 6.48                     | 59.75                       | 3  | 70.66        |
| 保德信      | 3,000,000,000  | 5,089,272,520  | 7.52                     | 64.94                       | 1  |              |
| 野村       | 3,000,000,000  | 5,117,194,691  | 7.28                     | 62.20                       | 2  |              |
| 國泰       | 3,000,000,000  | 4,960,040,580  | 6.14                     | 58.75                       | 4  |              |
| 富邦       | 3,000,000,000  | 4,886,026,215  | 5.98                     | 55.31                       | 5  |              |
| 合計       | 15,000,000,000 | 25,020,720,734 | 6.68                     | 60.19                       | —  |              |

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          | 113 年截至 7 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(110.12.15~113.7.31) |    |              |
|----------|----------------|----------------|--------------------------|------------------------------|----|--------------|
|          |                |                |                          | 投資報酬率<br>(%)                 | 排名 | 目標報酬率<br>(%) |
| 安聯       | 8,000,000,000  | 9,603,333,910  | 16.61                    | 23.62                        | 3  | 16.38        |
| 保德信      | 8,000,000,000  | 9,431,517,897  | 4.86                     | 20.21                        | 4  |              |
| 國泰       | 8,000,000,000  | 10,065,734,741 | 20.93                    | 32.04                        | 1  |              |
| 第一金      | 8,000,000,000  | 8,794,470,658  | 3.23                     | 9.71                         | 6  |              |
| 野村       | 8,000,000,000  | 9,468,221,663  | 16.94                    | 19.46                        | 5  |              |
| 富邦       | 8,000,000,000  | 9,759,903,095  | 18.17                    | 24.38                        | 2  |              |
| 合計       | 48,000,000,000 | 57,123,181,964 | 13.33                    | 21.55                        | —  |              |

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<br>名稱 | 委託金額           | 目前淨資產          | 113 年截至 7 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(112.10.5~113.7.31) |    |              |
|----------|----------------|----------------|--------------------------|-----------------------------|----|--------------|
|          |                |                |                          | 投資<br>報酬率<br>(%)            | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| 安聯       | 2,000,000,000  | 2,333,527,537  | 14.09                    | 16.68                       | 3  | 5.10         |
| 施罗德      | 2,000,000,000  | 2,415,579,530  | 19.07                    | 20.78                       | 2  |              |
| 國泰       | 2,000,000,000  | 2,576,288,236  | 18.14                    | 28.81                       | 1  |              |
| 第一金      | 2,000,000,000  | 2,143,066,431  | 2.98                     | 7.15                        | 7  |              |
| 野村       | 2,000,000,000  | 2,331,787,840  | 15.97                    | 16.59                       | 4  |              |
| 華南<br>永昌 | 2,000,000,000  | 2,263,340,531  | 7.02                     | 13.17                       | 6  |              |
| 滙豐       | 2,000,000,000  | 2,305,066,392  | 10.39                    | 15.25                       | 5  |              |
| 合計       | 14,000,000,000 | 16,368,656,497 | 12.50                    | 16.92                       | —  |              |

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          | 113 年截至 7 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(111.1.28~113.7.31) |    |              |
|----------|----------------|----------------|--------------------------|-----------------------------|----|--------------|
|          |                |                |                          | 投資報酬率<br>(%)                | 排名 | 目標報酬率<br>(%) |
| 富邦       | 12,256,867,963 | 14,798,234,276 | 17.65                    | 20.73                       | 2  | 15.27        |
| 統一       | 10,364,185,361 | 13,185,236,250 | 13.23                    | 27.22                       | 1  |              |
| 合計       | 22,621,053,324 | 27,983,470,526 | 15.53                    | 23.71                       | —  |              |

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         | 113 年截至 7 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(109.11.2~113.7.31) |    |              |
|----------|---------------|---------------|--------------------------|-----------------------------|----|--------------|
|          |               |               |                          | 投資報酬率<br>(%)                | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| 滙豐       | 3,685,000,000 | 8,236,924,827 | 23.48                    | 89.68                       | —  | 101.50       |

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 3)

單位：新臺幣元

| 投信<br>名稱 | 委託金額           | 目前淨資產          | 113 年截至 7 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(113.05.04~113.7.31) |    |              |
|----------|----------------|----------------|--------------------------|------------------------------|----|--------------|
|          |                |                |                          | 投資報酬率<br>(%)                 | 排名 | 目標報酬率<br>(%) |
| 野村       | 27,357,530,009 | 29,271,959,829 | 7.00                     | 7.00                         | —  | 1.49         |

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

## 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          | 113 年截至 7 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(112.4.6~113.7.31) |    |              |
|----------|---------------|----------------|--------------------------|----------------------------|----|--------------|
|          |               |                |                          | 投資報酬率<br>(%)               | 排名 | 目標報酬率<br>(%) |
| 復華       | 4,800,107,976 | 6,113,176,329  | 14.77                    | 27.35                      | 1  | 8.27         |
| 安聯       | 3,601,947,821 | 4,458,079,386  | 14.84                    | 23.77                      | 2  |              |
| 合計       | 8,402,055,797 | 10,571,255,715 | 14.80                    | 25.82                      | —  |              |

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 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          | 113 年截至 7 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(112.2.7~113.7.31) |    |              |
|----------|----------------|----------------|--------------------------|----------------------------|----|--------------|
|          |                |                |                          | 投資報酬率<br>(%)               | 排名 | 目標報酬率<br>(%) |
| 安聯       | 14,089,937,312 | 19,219,078,004 | 16.74                    | 36.40                      | 1  | 9.29         |
| 國泰       | 6,319,107,110  | 8,006,963,700  | 13.04                    | 26.71                      | 2  |              |
| 群益       | 6,384,957,618  | 7,953,075,039  | 7.22                     | 24.56                      | 3  |              |
| 滙豐       | 7,097,524,598  | 8,837,815,327  | 11.80                    | 24.52                      | 4  |              |
| 合計       | 33,891,526,638 | 44,016,932,070 | 13.25                    | 29.88                      | —  |              |

註：本批次為絕對報酬型，112.2.7 加碼安聯 30 億元，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         | 113 年截至 7 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(111.5.13~113.7.31) |    |              |
|----------|---------------|---------------|--------------------------|-----------------------------|----|--------------|
|          |               |               |                          | 投資報酬率<br>(%)                | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| 安聯       | 1,000,000,000 | 1,656,228,137 | 6.48                     | 59.80                       | 3  | 70.66        |
| 保德信      | 1,000,000,000 | 1,696,531,837 | 7.52                     | 64.94                       | 1  |              |
| 野村       | 1,000,000,000 | 1,705,853,156 | 7.28                     | 62.22                       | 2  |              |
| 國泰       | 1,000,000,000 | 1,653,504,281 | 6.14                     | 58.80                       | 4  |              |
| 富邦       | 1,000,000,000 | 1,628,712,051 | 5.98                     | 55.41                       | 5  |              |
| 合計       | 5,000,000,000 | 8,340,829,462 | 6.69                     | 60.23                       | —  |              |

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<br>名稱 | 委託金額          | 目前淨資產         | 113 年截至 7 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(112.10.5~113.7.31) |    |              |
|----------|---------------|---------------|--------------------------|-----------------------------|----|--------------|
|          |               |               |                          | 投資報酬率<br>(%)                | 排名 | 目標報酬率<br>(%) |
| 安聯       | 500,000,000   | 583,313,957   | 14.18                    | 16.66                       | 3  | 5.10         |
| 施羅德      | 500,000,000   | 603,949,622   | 19.08                    | 20.79                       | 2  |              |
| 國泰       | 500,000,000   | 644,483,646   | 18.23                    | 28.90                       | 1  |              |
| 第一金      | 500,000,000   | 535,783,883   | 2.99                     | 7.16                        | 7  |              |
| 野村       | 500,000,000   | 583,000,113   | 16.00                    | 16.60                       | 4  |              |
| 華南<br>永昌 | 500,000,000   | 566,067,945   | 7.05                     | 13.21                       | 6  |              |
| 滙豐       | 500,000,000   | 576,285,315   | 10.39                    | 15.26                       | 5  |              |
| 合計       | 3,500,000,000 | 4,092,884,481 | 12.54                    | 16.94                       | —  |              |

## (二) 113 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         | 113 年截至 7 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(110.6.7~113.7.31) |    |              |
|-------------|---------------|---------------|--------------------------|----------------------------|----|--------------|
|             |               |               |                          | 投資報酬率<br>(%)               | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| 聯博          | 907,613,021   | 771,416,287   | -0.69                    | -15.01                     | 2  | -15.27       |
| 富蘭克林<br>坦伯頓 | 1,251,737,838 | 1,176,671,204 | -1.13                    | -11.50                     | 1  |              |
| 合計          | 2,159,350,859 | 1,948,087,491 | -0.95                    | -13.29                     | —  |              |

##### 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         | 113 年截至 7 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(111.1.6~113.7.31) |    |              |
|-------|---------------|---------------|--------------------------|----------------------------|----|--------------|
|       |               |               |                          | 投資報酬率<br>(%)               | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| PIMCO | 2,158,967,886 | 1,987,917,118 | -0.43                    | -10.26                     | —  | -12.08       |

##### 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         | 113 年截至 7 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(111.2.6~113.7.31) |    |              |
|----------|---------------|---------------|--------------------------|----------------------------|----|--------------|
|          |               |               |                          | 投資報酬率<br>(%)               | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| 貝萊德      | 1,734,805,538 | 2,159,380,352 | 15.24                    | 24.47                      | 1  | 18.41        |
| JPMorgan | 1,485,120,883 | 1,812,124,910 | 13.50                    | 22.02                      | 2  |              |
| 合計       | 3,219,926,421 | 3,971,505,262 | 14.44                    | 23.34                      | —  |              |



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       | 113 年截至 7 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(111.11.17~113.7.31) |    |              |
|------|-------------|-------------|--------------------------|------------------------------|----|--------------|
|      |             |             |                          | 投資報酬率<br>(%)                 | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| 景順   | 656,507,639 | 771,106,452 | 7.86                     | 17.46                        | —  | 18.38        |

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         | 113 年截至 7 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(111.12.4~113.7.31) |    |              |
|------|---------------|---------------|--------------------------|-----------------------------|----|--------------|
|      |               |               |                          | 投資報酬率<br>(%)                | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| 貝萊德  | 1,141,092,316 | 1,496,084,802 | 13.10                    | 32.70                       | 2  | 32.20        |
| 道富   | 1,513,655,177 | 1,992,835,891 | 13.53                    | 33.31                       | 1  |              |
| 合計   | 2,654,747,493 | 3,488,920,693 | 13.35                    | 33.05                       | —  |              |

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         | 113 年截至 7 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(110.7.1~113.7.31) |    |              |
|------|---------------|---------------|--------------------------|----------------------------|----|--------------|
|      |               |               |                          | 投資報酬率<br>(%)               | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| 道富   | 934,565,605   | 1,166,046,381 | 11.62                    | 24.77                      | 1  | 22.81        |
| 貝萊德  | 939,726,931   | 1,167,661,064 | 11.18                    | 24.26                      | 2  |              |
| 合計   | 1,874,292,536 | 2,333,707,445 | 11.40                    | 24.51                      | —  |              |

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         | 113 年截至 7 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(111.3.6~113.7.31) |    |              |
|----------------|---------------|---------------|--------------------------|----------------------------|----|--------------|
|                |               |               |                          | 投資報酬率<br>(%)               | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| Cohen & Steers | 2,485,932,432 | 2,349,247,926 | 3.08                     | -6.96                      | 1  | -9.82        |
| 景順             | 1,567,127,452 | 1,425,774,246 | 0.05                     | -9.77                      | 2  |              |
| 合計             | 4,053,059,884 | 3,775,022,172 | 1.92                     | -8.03                      | —  |              |

### 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         | 113 年截至 7 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(111. 7. 31~113. 7. 31) |    |              |
|--------|---------------|---------------|--------------------------|---------------------------------|----|--------------|
|        |               |               |                          | 投資報酬率<br>(%)                    | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| Pictet | 618, 843, 493 | 692, 618, 035 | -0. 13                   | 12. 44                          | —  | 13. 26       |

### 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            | 113 年截至 7 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(112. 4. 18~113. 7. 31) |    |              |
|------|------------------|------------------|--------------------------|---------------------------------|----|--------------|
|      |                  |                  |                          | 投資報酬率<br>(%)                    | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| 道富   | 1, 163, 392, 347 | 1, 311, 929, 278 | 9. 72                    | 13. 11                          | 2  | 12. 58       |
| 貝萊德  | 1, 252, 011, 599 | 1, 408, 947, 376 | 9. 73                    | 13. 32                          | 1  |              |
| 合計   | 2, 415, 403, 946 | 2, 720, 876, 654 | 9. 73                    | 13. 21                          | —  |              |

### 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            | 113 年截至 7 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(113. 1. 22~113. 7. 31) |    |              |
|------|------------------|------------------|--------------------------|---------------------------------|----|--------------|
|      |                  |                  |                          | 投資報酬率<br>(%)                    | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| 瑞萬通博 | 1, 716, 000, 834 | 1, 833, 211, 752 | 6. 83                    | 6. 83                           | 3  | 10. 04       |
| MFS  | 1, 114, 480, 846 | 1, 266, 580, 753 | 13. 65                   | 13. 65                          | 1  |              |
| 威靈頓  | 1, 427, 914, 919 | 1, 565, 976, 301 | 9. 67                    | 9. 67                           | 2  |              |
| 合計   | 4, 258, 396, 599 | 4, 665, 768, 806 | 9. 57                    | 9. 57                           | —  |              |

### 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         | 113 年截至 7 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(113.4.25~113.7.31) |    |              |
|------|---------------|---------------|--------------------------|-----------------------------|----|--------------|
|      |               |               |                          | 投資報酬率<br>(%)                | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| RBC  | 1,086,559,371 | 1,142,307,162 | 5.13                     | 5.13                        | 1  | 4.54         |
| 貝萊德  | 670,392,768   | 700,228,553   | 4.45                     | 4.45                        | 3  |              |
| 盧米斯  | 891,561,542   | 932,400,046   | 4.58                     | 4.58                        | 2  |              |
| 合計   | 2,648,513,681 | 2,774,935,761 | 4.77                     | 4.77                        | —  |              |

### 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         | 113 年截至 7 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(109.8.11~113.7.31) |    |              |
|-------|---------------|---------------|--------------------------|-----------------------------|----|--------------|
|       |               |               |                          | 投資報酬率<br>(%)                | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| 北美信託  | 1,796,617,127 | 2,809,141,751 | 18.08                    | 67.25                       | 2  | 65.15        |
| LGIM  | 1,795,083,447 | 2,803,786,232 | 18.05                    | 66.88                       | 3  |              |
| Geode | 1,775,075,832 | 2,782,918,614 | 18.03                    | 67.43                       | 1  |              |
| 合計    | 5,366,776,406 | 8,395,846,597 | 18.05                    | 67.19                       | —  |              |

### 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         | 113 年截至 7 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(109.9.25~113.7.31) |    |              |
|----------|---------------|---------------|--------------------------|-----------------------------|----|--------------|
|          |               |               |                          | 投資報酬率<br>(%)                | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| Magellan | 1,287,520,518 | 1,654,989,702 | 4.64                     | 26.29                       | 2  | 35.21        |
| RREEF    | 926,848,763   | 1,252,618,059 | 7.29                     | 35.15                       | 1  |              |
| 合計       | 2,214,369,281 | 2,907,607,761 | 5.80                     | 29.88                       | —  |              |

### 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         | 113 年截至 7 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(109.11.13~113.7.31) |    |              |
|------------|---------------|---------------|--------------------------|------------------------------|----|--------------|
|            |               |               |                          | 投資報酬率<br>(%)                 | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| Brandywine | 821,176,083   | 697,167,744   | -5.43                    | -16.76                       | 2  | -15.67       |
| 盧米斯        | 471,104,127   | 429,445,949   | -2.10                    | -12.00                       | 1  |              |
| 合計         | 1,292,280,210 | 1,126,613,693 | -4.19                    | -15.14                       | —  |              |

### 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         | 113 年截至 7 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(110.7.20~113.7.31) |    |             |
|----------|---------------|---------------|--------------------------|-----------------------------|----|-------------|
|          |               |               |                          | 投資報酬率<br>(%)                | 排名 | 指標/目標報酬率(%) |
| Allianz  | 678,698,278   | 718,632,386   | 7.36                     | 4.56                        | 3  | 10.36/25.54 |
| JPMorgan | 1,645,715,430 | 1,724,266,094 | 8.03                     | 4.77                        | 2  |             |
| DWS      | 1,025,711,371 | 1,116,704,270 | 4.87                     | 8.83                        | 1  |             |
| 柏瑞       | 765,326,657   | 745,988,457   | 5.10                     | -2.53                       | 4  |             |
| 合計       | 4,115,451,736 | 4,305,591,207 | 6.55                     | 4.22                        | —  |             |

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         | 113 年截至 7 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(110.8.24~113.7.31) |    |              |
|------|-------------|---------------|--------------------------|-----------------------------|----|--------------|
|      |             |               |                          | 投資報酬率<br>(%)                | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| 貝萊德  | 949,175,052 | 1,029,377,585 | 9.90                     | 8.45                        | —  | 7.24         |

## 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         | 113 年截至 7 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(111.6.22~113.7.31) |    |              |
|------|---------------|---------------|--------------------------|-----------------------------|----|--------------|
|      |               |               |                          | 投資報酬率<br>(%)                | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| 貝萊德  | 601,552,002   | 790,901,715   | 9.60                     | 33.69                       | 4  | 33.32        |
| DWS  | 648,715,051   | 880,827,703   | 10.57                    | 36.09                       | 2  |              |
| 道富   | 749,045,562   | 991,096,069   | 10.63                    | 36.13                       | 1  |              |
| 北美信託 | 702,047,560   | 929,311,892   | 10.20                    | 34.32                       | 3  |              |
| 合計   | 2,701,360,175 | 3,592,137,379 | 10.28                    | 35.11                       | —  |              |

## 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         | 113 年截至 7 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(111.7.25~113.7.31) |    |                 |
|------------------|---------------|---------------|--------------------------|-----------------------------|----|-----------------|
|                  |               |               |                          | 投資報酬率<br>(%)                | 排名 | 指標/目標<br>報酬率(%) |
| American Century | 427,360,620   | 470,068,785   | 3.11                     | 9.99                        | 3  | 9.85/14.90      |
| 富達               | 965,211,657   | 1,128,206,413 | 4.63                     | 16.89                       | 1  |                 |
| TCW              | 1,039,618,153 | 1,153,365,722 | 3.63                     | 10.92                       | 2  |                 |
| 合計               | 2,432,190,430 | 2,751,640,920 | 3.95                     | 13.18                       | —  |                 |

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         | 113 年截至 7 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(113.1.23~113.7.31) |    |                 |
|------|---------------|---------------|--------------------------|-----------------------------|----|-----------------|
|      |               |               |                          | 投資報酬率<br>(%)                | 排名 | 指標/目標<br>報酬率(%) |
| 景順   | 786,698,949   | 873,885,974   | 11.08                    | 11.08                       | 2  | 2.72/5.34       |
| 威靈頓  | 787,219,463   | 864,010,361   | 9.75                     | 9.75                        | 4  |                 |
| CPR  | 778,885,217   | 890,158,962   | 14.29                    | 14.29                       | 1  |                 |
| 道富   | 706,462,703   | 784,424,428   | 11.04                    | 11.04                       | 3  |                 |
| 合計   | 3,059,266,332 | 3,412,479,725 | 11.55                    | 11.55                       | —  |                 |

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         | 113 年截至 7 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(108.12.18~113.7.31) |    |              |
|--------|---------------|---------------|--------------------------|------------------------------|----|--------------|
|        |               |               |                          | 投資報酬率<br>(%)                 | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| Amundi | 350,000,000   | 452,016,352   | 9.02                     | 15.27                        | 4  | 18.54        |
| DWS    | 300,000,000   | 374,257,152   | 8.12                     | 11.06                        | 5  |              |
| Nomura | 400,000,000   | 555,809,974   | 7.15                     | 28.34                        | 3  |              |
| 荷寶     | 300,000,000   | 467,197,803   | 10.54                    | 36.77                        | 1  |              |
| 道富     | 300,000,000   | 451,807,533   | 9.22                     | 31.23                        | 2  |              |
| 合計     | 1,650,000,000 | 2,301,088,814 | 8.74                     | 23.69                        | —  |              |

## 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         | 113 年截至 7 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(110.1.13~113.7.31) |    |              |
|----------|---------------|---------------|--------------------------|-----------------------------|----|--------------|
|          |               |               |                          | 投資報酬率<br>(%)                | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| DWS      | 600,000,000   | 598,166,923   | 2.16                     | -6.35                       | 4  | -5.49        |
| Insight  | 700,000,000   | 718,916,263   | 2.74                     | -4.39                       | 1  |              |
| JPMorgan | 400,000,000   | 384,786,103   | 2.63                     | -5.68                       | 3  |              |
| PIMCO    | 480,000,000   | 472,016,563   | 2.65                     | -5.63                       | 2  |              |
| Western  | 400,000,000   | 378,867,209   | 2.21                     | -6.80                       | 5  |              |
| 合計       | 2,580,000,000 | 2,552,753,061 | 2.49                     | -5.76                       | —  |              |

## 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         | 113 年截至 7 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(110.9.8~113.7.31) |    |              |
|-------------|---------------|---------------|--------------------------|----------------------------|----|--------------|
|             |               |               |                          | 投資報酬率<br>(%)               | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| CBRE        | 350,000,000   | 371,502,641   | 5.82                     | 6.71                       | 3  | 9.26         |
| Clearbridge | 450,000,000   | 476,850,743   | 4.11                     | 8.25                       | 1  |              |
| Magellan    | 350,000,000   | 362,755,223   | 4.31                     | 2.08                       | 4  |              |
| RREEF       | 350,000,000   | 373,299,027   | 9.21                     | 7.01                       | 2  |              |
| 合計          | 1,500,000,000 | 1,584,407,634 | 5.72                     | 6.00                       | —  |              |

## 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         | 113 年截至 7 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(110.10.15~113.7.31) |    |                 |
|---------------|---------------|---------------|--------------------------|------------------------------|----|-----------------|
|               |               |               |                          | 投資報酬率<br>(%)                 | 排名 | 指標/目標<br>報酬率(%) |
| 富達            | 400,000,000   | 393,445,956   | 9.23                     | -2.04                        | 5  | 10.35/24.34     |
| JPMorgan      | 400,000,000   | 412,249,939   | 8.07                     | 2.88                         | 4  |                 |
| Ninety One    | 400,000,000   | 420,575,658   | 3.71                     | 4.59                         | 2  |                 |
| Schroders     | 400,000,000   | 423,143,390   | 7.45                     | 5.35                         | 1  |                 |
| T. Rowe Price | 400,000,000   | 421,729,662   | 7.98                     | 4.19                         | 3  |                 |
| 合計            | 2,000,000,000 | 2,071,144,605 | 7.23                     | 3.00                         | —  |                 |

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         | 113 年截至 7 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(112.4.28~113.7.31) |    |              |
|-----------|---------------|---------------|--------------------------|-----------------------------|----|--------------|
|           |               |               |                          | 投資報酬率<br>(%)                | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| 匯豐        | 200,000,000   | 253,162,773   | 15.25                    | 29.89                       | 2  | 28.08        |
| LGIM      | 200,000,000   | 250,198,573   | 13.44                    | 27.88                       | 4  |              |
| 摩根士坦利     | 200,000,000   | 246,470,158   | 13.32                    | 25.24                       | 5  |              |
| Schroders | 200,000,000   | 250,583,394   | 13.85                    | 29.55                       | 3  |              |
| 威靈頓       | 200,000,000   | 255,288,245   | 15.58                    | 31.35                       | 1  |              |
| 合計        | 1,000,000,000 | 1,255,703,143 | 14.29                    | 28.78                       | —  |              |



## 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         | 113 年截至 7 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(112. 7. 19~113. 7. 31) |    |                 |
|---------------|---------------|---------------|--------------------------|---------------------------------|----|-----------------|
|               |               |               |                          | 投資報酬率<br>(%)                    | 排名 | 指標/目標<br>報酬率(%) |
| 盧米斯           | 400,000,000   | 430,316,379   | 4.28                     | 8.97                            | 1  | 5.50/8.10       |
| Ninety One    | 400,000,000   | 430,719,403   | 4.40                     | 8.10                            | 3  |                 |
| PIMCO         | 400,000,000   | 429,362,625   | 3.52                     | 7.53                            | 4  |                 |
| PGIM          | 400,000,000   | 425,141,353   | 4.61                     | 8.62                            | 2  |                 |
| T. Rowe Price | 400,000,000   | 404,143,293   | 1.73                     | 1.74                            | 6  |                 |
| 威靈頓           | 400,000,000   | 414,814,380   | 3.07                     | 5.26                            | 5  |                 |
| 合計            | 2,400,000,000 | 2,534,497,433 | 3.61                     | 6.72                            | —  |                 |

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       | 113 年截至 7 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(113. 6. 27~113. 7. 31) |    |              |
|--------|-------------|-------------|--------------------------|---------------------------------|----|--------------|
|        |             |             |                          | 投資報酬率<br>(%)                    | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| Amundi | 100,000,000 | 101,422,806 | 1.42                     | 1.42                            | 1  | 1.42         |
| LGIM   | 100,000,000 | 101,417,823 | 1.42                     | 1.42                            | 2  |              |
| 道富     | 100,000,000 | 101,402,991 | 1.40                     | 1.40                            | 3  |              |
| 北美信託   | 100,000,000 | 101,385,261 | 1.39                     | 1.39                            | 4  |              |
| 合計     | 400,000,000 | 405,628,881 | 1.41                     | 1.41                            | —  |              |

## 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         | 113 年截至 7 月<br>累積投資報酬率(%) | 委任迄今<br>(113. 6. 24~113. 7. 31) |    |              |
|------|---------------|---------------|---------------------------|---------------------------------|----|--------------|
|      |               |               |                           | 投資報酬率<br>(%)                    | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| 富達   | 753, 144, 454 | 778, 430, 394 | 3. 36                     | 3. 36                           | —  | 1. 64        |

### 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            | 113 年截至 7 月<br>累積投資報酬率(%) | 委任迄今<br>(111. 1. 6~113. 7. 31) |    |              |
|-------|------------------|------------------|---------------------------|--------------------------------|----|--------------|
|       |                  |                  |                           | 投資報酬率<br>(%)                   | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| PIMCO | 1, 003, 724, 736 | 899, 744, 069    | -0. 51                    | -10. 36                        | 1  | -12. 08      |
| 盧米斯   | 1, 018, 693, 762 | 903, 674, 629    | -0. 95                    | -12. 42                        | 2  |              |
| 合計    | 2, 022, 418, 498 | 1, 803, 418, 698 | -0. 72                    | -11. 36                        | —  |              |

### 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            | 113 年截至 7 月<br>累積投資報酬率(%) | 委任迄今<br>(111. 2. 6~113. 7. 31) |    |              |
|------|------------------|------------------|---------------------------|--------------------------------|----|--------------|
|      |                  |                  |                           | 投資報酬率<br>(%)                   | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| 貝萊德  | 1, 156, 987, 544 | 1, 440, 684, 806 | 15. 25                    | 24. 52                         | —  | 18. 41       |

### 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         | 113 年截至 7 月<br>累積投資報酬率(%) | 委任迄今<br>(111. 11. 17~113. 7. 31) |    |              |
|------|---------------|---------------|---------------------------|----------------------------------|----|--------------|
|      |               |               |                           | 投資報酬率<br>(%)                     | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| 景順   | 231, 124, 998 | 275, 803, 160 | 7. 55                     | 17. 00                           | —  | 18. 38       |

### 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            | 113 年截至 7 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(111. 3. 6~113. 7. 31) |    |              |
|--------|------------------|------------------|--------------------------|--------------------------------|----|--------------|
|        |                  |                  |                          | 投資報酬率<br>(%)                   | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| 貝萊德    | 304, 997, 166    | 383, 369, 005    | 11. 15                   | 25. 70                         | 3  | 24. 33       |
| 道富     | 360, 436, 214    | 454, 876, 635    | 11. 53                   | 26. 20                         | 1  |              |
| 瑞銀     | 308, 879, 836    | 389, 370, 689    | 11. 24                   | 26. 06                         | 2  |              |
| Nomura | 360, 147, 608    | 452, 095, 555    | 11. 05                   | 25. 53                         | 4  |              |
| 合計     | 1, 334, 460, 824 | 1, 679, 711, 884 | 11. 25                   | 25. 87                         | —  |              |

### 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         | 113 年截至 7 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(112. 4. 18~113. 7. 31) |    |              |
|------|---------------|---------------|--------------------------|---------------------------------|----|--------------|
|      |               |               |                          | 投資報酬率<br>(%)                    | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| 貝萊德  | 751, 993, 706 | 852, 707, 931 | 9. 76                    | 13. 39                          | —  | 12. 58       |

### 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            | 113 年截至 7 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(113. 1. 22~113. 7. 31) |    |              |
|------|------------------|------------------|--------------------------|---------------------------------|----|--------------|
|      |                  |                  |                          | 投資報酬率<br>(%)                    | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| 瑞萬通博 | 414, 056, 068    | 442, 313, 219    | 6. 82                    | 6. 82                           | 3  | 10. 04       |
| MFS  | 315, 296, 707    | 358, 301, 285    | 13. 64                   | 13. 64                          | 1  |              |
| 威靈頓  | 704, 502, 354    | 772, 605, 330    | 9. 67                    | 9. 67                           | 2  |              |
| 合計   | 1, 433, 855, 129 | 1, 573, 219, 834 | 9. 72                    | 9. 72                           | —  |              |

### 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            | 113 年截至 7 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(113. 5. 29~113. 7. 31) |    |              |
|--------|---------------|------------------|--------------------------|---------------------------------|----|--------------|
|        |               |                  |                          | 投資報酬率<br>(%)                    | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| Lazard | 954, 418, 976 | 1, 005, 183, 902 | 5. 32                    | 5. 32                           | —  | 6. 35        |

## 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       | 113 年截至 7 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(108.8.27~113.7.31) |    |              |
|-----------|-------------|-------------|--------------------------|-----------------------------|----|--------------|
|           |             |             |                          | 投資報酬率<br>(%)                | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| 信安環球      | 610,886,182 | 672,711,124 | 3.10                     | 6.52                        | 2  | 1.16         |
| Macquarie | 126,937,100 | 137,143,835 | 1.96                     | 8.04                        | 1  |              |
| 合計        | 737,823,282 | 809,854,959 | 2.90                     | 6.85                        | —  |              |

## 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         | 113 年截至 7 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(110.7.20~113.7.31) |    |                 |
|---------|---------------|---------------|--------------------------|-----------------------------|----|-----------------|
|         |               |               |                          | 投資報酬率<br>(%)                | 排名 | 指標/目標<br>報酬率(%) |
| Allianz | 155,447,975   | 162,782,563   | 7.35                     | 4.72                        | 3  | 10.36/25.54     |
| 摩根      | 594,592,070   | 625,577,661   | 8.09                     | 5.21                        | 2  |                 |
| DWS     | 311,387,682   | 339,121,271   | 4.86                     | 8.91                        | 1  |                 |
| 柏瑞      | 254,823,294   | 248,222,253   | 5.09                     | -2.59                       | 4  |                 |
| 合計      | 1,316,251,021 | 1,375,703,748 | 6.64                     | 4.52                        | —  |                 |

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。

## 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       | 113 年截至 7 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(111.6.22~113.7.31) |    |              |
|------|-------------|-------------|--------------------------|-----------------------------|----|--------------|
|      |             |             |                          | 投資報酬率<br>(%)                | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| 貝萊德  | 127,303,524 | 169,839,575 | 9.55                     | 33.41                       | 4  | 33.32        |
| DWS  | 147,528,441 | 200,638,164 | 10.57                    | 36.00                       | 2  |              |
| 道富   | 157,982,595 | 215,016,634 | 10.55                    | 36.10                       | 1  |              |
| 北美信託 | 158,484,700 | 212,615,069 | 10.21                    | 34.15                       | 3  |              |
| 合計   | 591,299,260 | 798,109,442 | 10.25                    | 34.98                       | —  |              |

### 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         | 113 年截至 7 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(111.7.25~113.7.31) |    |                 |
|------------------|-------------|---------------|--------------------------|-----------------------------|----|-----------------|
|                  |             |               |                          | 投資報酬率<br>(%)                | 排名 | 指標/目標<br>報酬率(%) |
| American Century | 319,635,794 | 351,436,231   | 3.06                     | 9.95                        | 3  | 9.85/14.90      |
| 富達               | 299,785,344 | 352,181,044   | 4.79                     | 17.48                       | 1  |                 |
| TCW              | 328,000,470 | 365,049,504   | 3.87                     | 11.30                       | 2  |                 |
| 合計               | 947,421,608 | 1,068,666,779 | 3.90                     | 12.80                       | —  |                 |

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       | 113 年截至 7 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(113.1.23~113.7.31) |    |                 |
|------|-------------|-------------|--------------------------|-----------------------------|----|-----------------|
|      |             |             |                          | 投資報酬率<br>(%)                | 排名 | 指標/目標<br>報酬率(%) |
| 景順   | 116,977,839 | 129,941,772 | 11.08                    | 11.08                       | 2  | 2.72/5.34       |
| 威靈頓  | 107,476,614 | 117,960,153 | 9.75                     | 9.75                        | 3  |                 |
| CPR  | 115,110,097 | 131,555,122 | 14.29                    | 14.29                       | 1  |                 |
| 合計   | 339,564,550 | 379,457,047 | 11.75                    | 11.75                       | —  |                 |

註：本批次為絕對報酬型，契約目標報酬率係以 USD 3-Month T-Bill (指標報酬率)加計 500 個基點為基準。

### 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       | 113 年截至 7 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(110.9.8~113.7.31) |    |              |
|-------------|-------------|-------------|--------------------------|----------------------------|----|--------------|
|             |             |             |                          | 投資報酬率<br>(%)               | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| CBRE        | 60,000,000  | 63,429,823  | 6.00                     | 6.97                       | 3  | 9.26         |
| ClearBridge | 60,000,000  | 63,970,921  | 5.09                     | 9.41                       | 1  |              |
| Magellan    | 30,000,000  | 30,798,402  | 4.29                     | 2.66                       | 4  |              |
| RREEF       | 60,000,000  | 63,837,674  | 9.23                     | 7.68                       | 2  |              |
| 合計          | 210,000,000 | 222,036,820 | 6.17                     | 6.71                       | —  |              |

(二)113 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)

113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)

113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             |
|---------|----------------|-----------------|----------------|
| 113年7月份 | 58,310,934,739 | 116,449,218,982 | 58,138,284,243 |

### (二)舊制勞工退休基金

單位：新臺幣元

|         | 餘絀             | 收入             | 支出          |
|---------|----------------|----------------|-------------|
| 113年7月份 | 14,094,564,819 | 14,270,259,023 | 175,694,204 |

## 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

| 113 年 7 月份 |                 | 單位：新臺幣元       |
|------------|-----------------|---------------|
| 項 目        | 金 額             |               |
| 現金收入       | 180,120,182,571 |               |
| 現金支出       | 173,459,636,797 |               |
| 現金增(減)數    |                 | 6,660,545,774 |

### (二)舊制勞工退休基金

| 113 年 7 月份 |                | 單位：新臺幣元 |
|------------|----------------|---------|
| 項 目        | 金 額            |         |
| 現金收入       | 38,842,298,371 |         |
| 現金支出       | 38,842,256,332 |         |
| 現金增(減)數    |                | 42,039  |