

## 勞工退休基金運用情形

### 一、勞工退休基金 97 年 1 月迄今整體績效

截至 103 年 9 月底

新制基金	3.1560%
舊制基金	2.7778%

註：舊制基金自 76 年 6 月之績效為 5.0195%

### 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

單位：新台幣萬元

至 103 年 9 月底止基金規模與收益		
基金運用規模		1 兆 2,411 億 27 萬元
103 年截至 9 月底止 運用總損益及評價後報酬率	自行運用	93 億 3,714 萬元 1.70%
	委託經營	349 億 4,283 萬元 5.80%
	合計	442 億 7,997 萬元 3.84%

註 1：評價後報酬率係以當期報酬率（即收益÷103 年之日平均餘額）列示。

註 2：103 年 9 月之保證收益率為 1.3916%。

## 2. 舊制勞工退休基金

單位：新台幣萬元

至 103 年 9 月底止基金規模與收益		
基金運用規模		6,187 億 8,683 萬元
103 年截至 9 月底止 運用總損益及評價後報酬率	自行運用	121 億 1,108 萬元 3.82%
	委託經營	150 億 7,622 萬元 5.70%
	合計	271 億 8,730 萬元 4.67%

註：評價後報酬率係以當期報酬率（即收益÷103年之日平均餘額）列示

### (二) 資產配置

#### 1. 新制勞工退休基金

截至 103 年 9 月底

單位：新台幣元

項 目	餘 額	占基金運用比例(%)
<b>自行運用</b>	<b>542,468,236,686</b>	<b>43.71</b>
轉存金融機構	187,746,865,808	15.13
短期票券	47,313,618,859	3.81
公債、公司債及金融債券	157,963,191,412	12.73
貨幣型基金	0	0.00
股票及受益憑證投資(含期貨)	22,913,031,767	1.85
國外投資	126,531,528,840	10.19
固定收益	107,978,486,935	8.70
權益證券	12,097,044,391	0.97
另類投資	6,455,997,514	0.52
<b>委託經營</b>	<b>698,632,033,859</b>	<b>56.29</b>
國內委託經營	262,126,860,766	21.12
國外委託經營	436,505,173,093	35.17
固定收益	158,254,908,490	12.75
權益證券	226,472,978,198	18.25
另類投資	51,777,286,405	4.17
<b>合 計</b>	<b>1,241,100,270,545</b>	<b>100.00</b>

## 2. 舊制勞工退休基金

截至 103 年 9 月底

單位：新台幣元

項 目	餘 額	占基金運用比例(%)
<b>自行運用</b>	<b>358,190,502,569</b>	<b>57.89</b>
轉存金融機構	143,134,272,159	23.13
短期票券	17,698,048,366	2.86
公債、金融債券、公司債及證券化商品	61,584,996,165	9.95
貨幣型基金	0	0.00
股票及受益憑證投資(含期貨)	61,616,140,559	9.96
國外投資	74,157,045,320	11.99
固定收益	40,774,504,337	6.59
權益證券	25,792,944,620	4.17
另類投資	7,589,596,363	1.23
<b>委託經營</b>	<b>260,596,330,458</b>	<b>42.11</b>
國內委託經營	102,265,872,472	16.53
國外委託經營	158,330,457,986	25.58
固定收益	55,714,312,677	9.00
權益證券	93,449,078,293	15.10
另類投資	9,167,067,016	1.48
<b>合 計</b>	<b>618,786,833,027</b>	<b>100.00</b>

### (三)基金自營投資與委外投資比例

#### 1. 新制勞工退休基金

截至 103 年 9 月底

單位：新台幣元

項 目	金 額	占基金運用比例 (%)
自行運用	542,468,236,686	43.71
委託經營	698,632,033,859	56.29

#### 2. 舊制勞工退休基金

截至 103 年 9 月底

單位：新台幣元

項 目	金 額	占基金運用比例 (%)
自行運用	358,190,502,569	57.89
委託經營	260,596,330,458	42.11

#### (四)基金國內投資與國外投資比例

##### 1. 新制勞工退休基金

截至 103 年 9 月底

單位：新台幣元

項 目	金 額	占基金運用比例 (%)
國 內 投 資	678,063,568,612	54.64
國 外 投 資	563,036,701,933	45.36

##### 2. 舊制勞工退休基金

截至 103 年 9 月底

單位：新台幣元

項 目	金 額	占基金運用比例 (%)
國 內 投 資	386,299,329,721	62.43
國 外 投 資	232,487,503,306	37.57

### 三、基金自營投資概況

#### (一)基金自營投資績效 (國內權益證券)

##### 1. 新制勞工退休基金

截至 103 年 9 月底

項 目	收益率 (%)
國內權益證券	8.56

##### 2. 舊制勞工退休基金

截至 103 年 9 月底

項 目	收益率 (%)
國內權益證券	11.51

#### (二)基金自營股票及受益憑證投資比例概況

##### 1. 新制勞工退休基金

截至 103 年 9 月底

單位：新台幣元

項 目	金 額	比 例 (%)
國內權益證券	22,913,031,767	1.85

##### 2. 舊制勞工退休基金

截至 103 年 9 月底

單位：新台幣元

項 目	金 額	比 例 (%)
國內權益證券	61,616,140,559	9.96

註：不含貨幣型基金

#### 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 年第一次委託經營安泰 (續約 2)

單位：新台幣元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	103 年截至 9 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (102. 9. 27~103. 9. 30)		
				投資報酬率 (%)	委託經營排名	大盤報酬率(%)
安泰	7,804,845,205	8,933,853,178	11.19	14.47	—	9.56

##### 97 年第一次委託經營安泰 (續約 2)

單位：新台幣元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	103 年截至 9 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (103. 1. 20~103. 9. 30)		
				投資報酬率 (%)	委託經營排名	大盤報酬率(%)
安泰	5,783,138,827	6,453,124,932	11.59	11.59	—	4.32

##### 97 年第二次委託經營 (續約)

單位：新台幣元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	103 年截至 9 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (100. 10. 8~103. 9. 30)		
				投資報酬率 (%)	委託經營排名	大盤報酬率(%)
富邦	6,747,919,987	7,747,766,865	6.10	14.82	2	24.33
群益	7,256,147,326	8,403,791,272	5.29	15.82	1	
合計	14,004,067,313	16,151,558,137	5.68	15.33	—	

### 98 年第一次委託經營 (續約)

單位：新台幣元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	103 年截至 9 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (101.7.14~103.9.30)		
				投資報酬率(%)	委託經營排名	大盤報酬率(%)
安泰	3,421,364,679	4,356,877,537	11.30	27.34	1	26.22
保德信	3,423,163,553	4,186,105,089	4.17	22.29	2	
合計	6,844,528,232	8,542,982,626	7.69	24.81	—	

### 99 年第一次委託經營 (續約)

單位：新台幣元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	103 年截至 9 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (102.3.9~103.9.30)		
				投資報酬率(%)	委託經營排名	大盤報酬率(%)
保德信	7,790,534,548	8,641,409,439	4.50	10.92	—	11.87

### 99 年第二次委託經營

單位：新台幣元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	103 年截至 9 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (99.11.30~103.9.30)		
				投資報酬率(%)	委託經營排名	大盤報酬率(%)
永豐	5,000,000,000	5,206,093,198	2.73	4.12	3	7.17
國泰	5,000,000,000	6,309,575,011	5.38	26.19	1	
富邦	5,000,000,000	5,750,978,809	5.08	15.02	2	
滙豐中華	5,000,000,000	5,025,790,850	6.32	0.52	4	
合計	20,000,000,000	22,292,437,868	4.88	11.46	—	



## 100 年第一次委託經營(相對報酬)

單位：新台幣元

投信 名稱	委託金額	目前淨資產	103 年截至 9 月 累積投資報酬 (%)	委任迄今 (100.7.15~103.9.30)		
				投資報酬 率(%)	委託經 營排名	大盤/指 標報酬率 (%)
國泰	5,000,000,000	6,533,863,056	5.90	14.35	4	5.73/ 21.77
富邦	5,000,000,000	6,541,027,290	7.02	17.49	3	
復華	11,294,673,623	13,681,176,319	6.44	19.15	2	
滙豐中華	12,034,391,172	14,682,760,205	7.06	19.71	1	
合計	33,329,064,795	41,438,826,870	6.63	17.67	—	

註：本次委託為相對報酬委託經營，採分批撥款，上述績效係採幾何報酬率計算；以就業 99 指數為指定指標。

## 100 年第二次委託經營第一期

單位：新台幣元

投信 名稱	委託金額	目前淨資產	103 年截至 9 月 累積投資報酬 (%)	委任迄今 (100.8.10~103.9.30)		
				投資報酬 率(%)	委託經 營排名	大盤報 酬率(%)
保德信	3,000,000,000	3,543,590,490	7.80	18.12	2	19.67
統一	3,000,000,000	3,468,370,151	11.68	15.61	3	
富邦	3,000,000,000	3,173,384,259	7.06	5.78	5	
復華	3,000,000,000	3,724,805,028	7.13	24.16	1	
摩根	3,000,000,000	3,203,221,797	3.53	6.77	4	
合計	15,000,000,000	17,113,371,725	7.44	14.09	—	

## 100 年第二次委託經營第二期

單位：新台幣元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	103 年截至 9 月 累積投資報酬 (%)	委任迄今 (100.11.23~103.9.30)		
				投資報酬 率(%)	委託經 營排名	大盤報 酬率(%)
保德信	2,000,000,000	2,415,080,953	7.25	20.75	3	28.10
統一	2,000,000,000	2,465,213,421	11.61	23.26	2	
富邦	2,000,000,000	2,258,465,247	6.93	12.92	5	
復華	2,000,000,000	2,649,487,932	7.31	32.47	1	
滙豐中華	2,000,000,000	2,353,841,224	5.91	17.69	4	
摩根	2,000,000,000	2,147,445,570	3.52	7.37	6	
合計	12,000,000,000	14,289,534,347	7.13	19.08	—	

## 100 年第二次委託經營 A 帳戶

單位：新台幣元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	103 年截至 9 月 累積投資報酬 (%)	委任迄今 (102.4.22~103.9.30)		
				投資報酬 率(%)	委託經 營排名	大盤報 酬率(%)
復華	4,511,827,956	5,193,114,557	8.06	15.10	—	13.06

## 100 年第二次委託經營 B 帳戶

單位：新台幣元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	103 年截至 9 月 累積投資報酬 (%)	委任迄今 (103.8.6~103.9.30)		
				投資報酬 率(%)	委託經 營排名	大盤報 酬率(%)
復華	5,480,000,000	5,390,695,834	-1.63	-1.63	—	-1.91

## 101 年第一次委託經營(相對報酬)

單位：新台幣元

投信 名稱	委託金額	目前淨資產	103 年截至 9 月 累積投資報酬 (%)	委任迄今 (101.4.18~103.9.30)		
				投資報酬 率(%)	委託經 營排名	大盤/指 標報酬 率(%)
國泰	4,500,000,000	5,358,841,120	6.88	25.72	2	18.21/ 30.09
滙豐中華	9,546,945,283	10,888,075,225	7.06	27.39	1	
合計	14,046,945,283	16,246,916,345	6.81	26.37	—	

註：本次委託為相對報酬委託經營，採分批撥款，上述績效係採幾何報酬率計算；以加權股價報酬指數為指定指標。

## 101 年第二次委託經營

單位：新台幣元

投信 名稱	委託金額	目前淨資產	103 年截至 9 月 累積投資報酬 (%)	委任迄今 (101.7.16~103.9.30)		
				投資報酬 率(%)	委託經 營排名	大盤報 酬率(%)
安泰	5,000,000,000	6,261,013,583	11.25	25.22	2	26.22
保德信	5,000,000,000	5,759,375,330	6.22	15.19	6	
國泰	5,000,000,000	6,106,039,319	11.95	22.12	3	
統一	5,000,000,000	6,897,210,357	18.33	37.94	1	
富邦	5,000,000,000	5,868,810,375	4.85	17.38	5	
滙豐中華	5,000,000,000	5,903,976,689	5.34	18.08	4	
合計	30,000,000,000	36,796,425,653	9.73	22.65	—	

## 102 年第一次委託經營第一期

單位：新台幣元

投信 名稱	委託金額	目前淨資產	103 年截至 9 月 累積投資報酬 (%)	委任迄今 (102.6.7~103.9.30)		
				投資報酬 率(%)	委託經 營排名	大盤報 酬率(%)
國泰	2,500,000,000	2,815,017,129	4.71	12.60	3	10.76
統一	2,500,000,000	2,984,283,187	11.12	19.37	1	
富邦	2,500,000,000	2,622,581,097	0.42	4.90	6	
復華	2,500,000,000	2,818,282,078	8.17	12.73	2	
德盛安聯	2,500,000,000	2,789,242,611	6.35	11.57	4	
摩根	2,500,000,000	2,688,869,636	4.53	7.55	5	
合計	15,000,000,000	16,718,275,738	5.91	11.46	—	

## 102 年第一次委託經營第二期

單位：新台幣元

投信 名稱	委託金額	目前淨資產	103 年截至 9 月 累積投資報酬 (%)	委任迄今 (102.11.22~103.9.30)		
				投資報酬 率(%)	委託經 營排名	大盤報 酬率(%)
國泰	2,500,000,000	2,596,996,462	2.34	3.88	5	10.71
統一	2,500,000,000	2,807,333,026	9.18	12.29	1	
富邦	2,500,000,000	2,546,702,037	0.65	1.87	6	
復華	2,500,000,000	2,761,782,007	7.90	10.47	2	
德盛安聯	2,500,000,000	2,725,212,226	7.33	9.01	3	
摩根	2,500,000,000	2,624,887,953	4.48	5.00	4	
合計	15,000,000,000	16,062,913,711	5.33	7.09	—	

## 102 年第二次委託經營(相對報酬)

單位：新台幣元

投信 名稱	委託金額	目前淨資產	103 年截至 9 月 累積投資報酬 (%)	委任迄今 (103.1.20~103.9.30)		
				投資報酬 率(%)	委託經 營排名	大盤/指 標報酬 率(%)
保德信	3,000,000,000	3,200,935,705	6.70	6.70	4	4.32/ 7.50
統一	3,000,000,000	3,226,394,341	7.55	7.55	3	
富邦	3,000,000,000	3,135,056,885	4.50	4.50	6	
復華	3,000,000,000	3,308,779,184	10.29	10.29	1	
群益	3,000,000,000	3,230,670,226	7.69	7.69	2	
滙豐中華	3,000,000,000	3,197,110,076	6.57	6.57	5	
合計	18,000,000,000	19,298,946,417	7.22	7.22	—	

註：本次委託為相對報酬委託經營，採分批撥款，上述績效係採幾何報酬率計算；以加權股價報酬指數為指定指標。

## 103 年第一次委託經營

單位：新台幣元

投信 名稱	委託金額	目前淨資產	103 年截至 9 月 累積投資報酬 (%)	委任迄今 (103.8.11~103.9.30)		
				投資報酬 率(%)	委託經 營排名	大盤/指 標報酬 率(%)
國泰	7,000,000,000	6,910,258,631	-1.28	-1.28	1	-1.31
統一	7,000,000,000	6,861,609,219	-1.98	-1.98	2	
復華	7,000,000,000	6,836,233,563	-2.34	-2.34	3	
合計	21,000,000,000	20,608,101,413	-1.87	-1.87	—	

## 2. 舊制勞工退休基金

### 國內 98 年第二次委託經營(續)

單位：新台幣元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	103 年截至 9 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (102.1.26~103.9.30)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤 報酬率(%)
保德信	3,380,116,383	3,892,989,752	3.97	15.17	2	16.87
富邦	3,208,581,038	3,674,781,793	5.11	14.53	3	
統一	3,514,321,648	4,492,102,514	10.88	27.82	1	
合計	10,103,019,069	12,059,874,059	6.81	19.37	—	

### 國內 100 年第一次委託經營

單位：新台幣元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	103 年截至 9 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (100.3.17~103.9.30)		
				投資 報酬率(%)	委託 經營 排名	大盤 報酬率(%)
保德信	5,000,000,000	5,447,502,708	4.29	8.95	5	7.72
群益	5,000,000,000	5,816,207,317	7.55	16.32	2	
復華	5,000,000,000	5,781,277,030	7.27	15.63	3	
國泰	5,000,000,000	5,635,395,228	6.56	12.71	4	
統一	5,000,000,000	6,268,944,506	11.32	25.38	1	
合計	25,000,000,000	28,949,326,789	7.46	15.80	—	

### 國內 101 年第一次委託經營(相對報酬)

單位：新台幣元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	103 年截至 9 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (101.10.30~103.9.30)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤/指標 報酬率(%)
匯豐中華	2,163,012,619	2,506,945,239	7.08	31.88	—	26.44/34.14

註：本次委託為相對報酬委託經營，採分批撥款，上述績效係採幾何報酬率計算；以加權股價報酬指數為指定指標。

## 國內 101 年第二次委託經營

單位：新台幣元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	103 年截至 9 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (101.4.30~103.9.30)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤 報酬率(%)
保德信	5,000,000,000	5,732,385,058	5.19	14.65	6	19.87
群益	5,000,000,000	5,823,503,910	4.65	16.47	5	
匯豐中華	5,000,000,000	5,948,967,660	5.97	18.98	3	
安泰	5,000,000,000	6,385,535,940	9.22	27.71	1	
國泰	5,000,000,000	5,913,841,113	7.06	18.28	4	
統一	5,000,000,000	6,093,388,833	11.24	21.87	2	
合計	30,000,000,000	35,897,622,514	7.23	19.66	—	

## 國內 102 年第一次委託經營第一期

單位：新台幣元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	103 年截至 9 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (102.6.7~103.9.30)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤 報酬率(%)
德盛安聯	2,500,000,000	2,789,352,423	6.35	11.57	4	10.76
復華	2,500,000,000	2,818,413,941	8.18	12.74	2	
國泰	2,500,000,000	2,815,141,860	4.71	12.61	3	
富邦	2,500,000,000	2,622,717,423	0.43	4.91	6	
摩根	2,500,000,000	2,688,990,020	4.53	7.56	5	
統一	2,500,000,000	2,984,424,459	11.12	19.38	1	
合計	15,000,000,000	16,719,040,126	5.91	11.46	—	

## 國內 102 年第一次委託經營第二期

單位：新台幣元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	103 年截至 9 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (102.11.22~103.9.30)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤 報酬率(%)
德盛安聯	2,500,000,000	2,725,299,233	7.33	9.01	3	10.71
復華	2,500,000,000	2,761,873,735	7.90	10.47	2	
國泰	2,500,000,000	2,597,081,384	2.35	3.88	5	
富邦	2,500,000,000	2,546,790,950	0.65	1.87	6	
摩根	2,500,000,000	2,624,973,481	4.48	5.00	4	
統一	2,500,000,000	2,807,428,428	9.18	12.30	1	
合計	15,000,000,000	16,063,447,211	5.33	7.09	—	

## (二) 103 年度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：

投信名稱	收回日期	收回委託金額	經理人	收回理由
100-1P 元大寶來	103.2.13	50 億	謝○○	委託經營投資契約第 23 條規定，收回全數委託資產
101-1 元大寶來	103.2.13	45 億	林○○	委託經營投資契約第 23 條規定，收回全數委託資產
101-1 富邦	103.8.5	45 億	詹○○	委託經營投資契約第 23 條規定，收回全數委託資產

#### 舊制勞工退休基金：

投信名稱	收回日期	收回委託金額	經理人	收回理由
99-1 日盛	103.2.13	40 億元	黃○○	委託經營投資契約第 23 條規定，收回全數委託資產
101-1 元大寶來	103.2.13	10 億元	張○○	委託經營投資契約第 23 條規定，收回全數委託資產

### 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 全球股票型 (續約)

單位：美元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	103年截至9月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (101.5.21~103.9.30)		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率(%)
坦伯頓	500,000,000	742,502,399	0.44	59.88	—	47.32

##### 97-1 全球債券型 (續約)

單位：美元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	103年截至9月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (101.6.4~103.9.30)		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率(%)
聯博	750,000,000	770,553,178	1.96	2.74	2	1.93
高盛	400,000,000	409,268,405	0.46	2.32	3	
坦伯頓	650,000,000	749,898,580	4.00	15.37	1	
合計	1,800,000,000	1,929,720,163	2.41	7.21	—	

##### 97-2 全球增值債券型 (續約)

單位：美元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	103年截至9月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (102.1.7~103.9.30)		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率(%)
太平洋	615,416,988	619,178,344	2.85	0.61	1	0.14
高盛	479,694,715	480,398,664	0.51	0.15	2	
合計	1,095,111,703	1,099,577,008	1.82	0.41	—	

### 97-2 全球增值股票型 (續約)

單位：美元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	103 年截至 9 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (102.2.5~103.9.30)		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率(%)
貝萊德	584,277,868	696,878,185	5.79	29.73	1	22.16
摩根	587,857,352	725,900,530	4.16	23.48	2	
合計	1,172,135,220	1,422,778,715	4.85	25.99	—	

### 98-1 亞太 (日本除外) 股票型 (續約)

單位：美元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	103 年截至 9 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (102.11.18~103.9.30)		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率(%)
景順	471,501,358	501,220,613	5.46	6.30	—	3.08

### 98-1 全球被動股票型 (續約)

單位：美元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	103 年截至 9 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (102.12.2~103.9.30)		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率(%)
貝萊德	299,329,552	316,425,784	3.83	5.71	2	5.52
道富	349,680,272	370,000,503	4.00	5.81	1	
合計	649,009,824	686,426,287	3.92	5.77	—	

### 99-1 全球新興市場股票型 (續約)

單位：美元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	103 年截至 9 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (103.8.25~103.9.30)		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率(%)
摩根士丹利	403,049,882	380,711,193	-5.54	-5.54	2	-6.53
瑞萬通博	716,993,858	686,715,228	-4.22	-4.22	1	
合計	1,120,043,740	1,067,426,421	-4.70	-4.70	—	

### 100-1 全球基本面指數被動股票型

單位：美元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	103 年截至 9 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (100.7.1~103.9.30、 100.7.13~103.9.30)		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率(%)
道富	300,000,000	390,490,564	3.08	30.16	2	29.12
貝萊德	300,000,000	400,040,152	2.99	33.35	1	32.79
合計	600,000,000	790,530,716	3.04	31.76	—	—

註：其中道富委託日 100.7.1，貝萊德委託日 100.7.13。

### 100-1 全球不動產股票型

單位：美元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	103 年截至 9 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (101.3.6~103.9.30)		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率(%)
Cohen & Steers	550,000,000	616,765,073	6.34	27.57	2	23.84
景順	600,000,000	682,463,615	7.32	28.40	1	
EII	400,000,000	465,354,047	3.92	22.27	3	
合計	1,550,000,000	1,764,582,735	5.98	26.02	—	

## 101-1 全球新興市場債券型

單位：美元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	103年截至9月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (101.7.31~103.9.30)		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率(%)
Ashmore	300,000,000	296,779,781	2.90	2.17	1	3.04
Bluebay	300,000,000	296,194,810	2.95	0.88	2	
實港	300,000,000	289,261,499	2.84	-1.76	4	
Pictet	300,000,000	293,687,405	3.18	-0.20	3	
合計	1,200,000,000	1,175,923,495	2.97	0.27	—	

## 101-1 全球低波動指數被動股票型

單位：美元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	103年截至9月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (102.4.18~103.9.30)		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率(%)
道富	500,000,000	540,423,650	5.86	7.84	1	7.60
貝萊德	500,000,000	538,861,129	5.99	7.51	2	
合計	1,000,000,000	1,079,284,779	5.92	7.67	—	

## 102-1 全球高股利增值股票型

單位：美元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	103年截至9月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (103.1.22~103.9.30)		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率(%)
瑞萬通博	500,000,000	505,317,881	3.96	3.96	2	4.25
MFS	500,000,000	495,599,515	2.53	2.53	3	
威靈頓	500,000,000	503,440,875	4.67	4.67	1	
合計	1,500,000,000	1,504,358,271	3.72	3.72	—	

## 102-1 全球信用債券型

單位：美元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	103年截至9月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (103.4.25~103.9.30)		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率(%)
Bluebay	300,000,000	296,044,747	-0.68	-0.68	2	-0.40
貝萊德	300,000,000	296,321,283	-0.73	-0.73	3	
盧米斯	300,000,000	296,772,763	-0.62	-0.62	1	
合計	900,000,000	889,138,793	-0.68	-0.68	—	

## 2. 舊制勞工退休基金

### 96年續約國外委託經營(平衡型)

單位：美元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	103年截至9月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (100.6.21~103.9.30)		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率(%)
富達國際	425,533,349	562,227,180	3.45	29.84	-	28.46

### 97年續約國外委託經營(全球增值債券型)

單位：美元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	103年截至9月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (102.1.6~103.9.30)		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率(%)
太平洋	731,384,466	730,941,086	2.46	-0.06	1	0.14
盧米斯	712,476,555	708,066,191	1.37	-0.62	2	
合計	1,443,861,021	1,439,007,277	1.92	-0.34	—	

### 97 年續約國外委託經營(全球增值股票型)

單位：美元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	103 年截至 9 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (102.2.5~103.9.30)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
貝萊德	384,953,368	499,405,036	5.81	29.73	-	22.16

### 98 年續約國外委託經營(亞太股票型)

單位：美元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	103 年截至 9 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (102.11.17~103.9.30)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
景順	262,187,756	280,092,616	5.68	6.83	-	3.08

### 100 年國外委託經營(全球基本面指數股票型)

單位：美元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	103 年截至 9 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (101.3.6~103.9.30)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
貝萊德	300,000,000	365,733,166	3.08	36.25	3	35.93
道富	300,000,000	366,476,288	3.17	36.79	1	
瑞銀環球	300,000,000	364,966,905	2.89	36.19	4	
野村	300,000,000	365,938,973	3.01	36.60	2	
合計	1,200,000,000	1,463,115,332	3.04	36.46	—	

### 101 年國外委託經營(全球低波動指數股票型)

單位：美元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	103 年截至 9 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (102.6.13~103.9.30)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
貝萊德	300,000,000	319,233,631	5.80	11.38	—	11.51

### 102 年國外委託經營(全球高股利增值股票型)

單位：美元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	103 年截至 9 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (103.1.22~103.9.30)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
瑞萬通博	150,000,000	154,866,128	4.00	4.00	2	4.45
MFS	150,000,000	152,709,678	2.69	2.69	3	
威靈頓	150,000,000	155,604,701	4.81	4.81	1	
合計	450,000,000	463,180,507	3.83	3.83	—	

### 102 年國外委託經營(全球基礎建設有價證券型)

單位：美元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	103 年截至 9 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (103.5.29~103.9.30)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
Lazard	100,000,000	96,052,240	-3.09	-3.09	2	-0.68
Cohen & Steers	100,000,000	98,396,732	-0.65	-0.65	1	
合計	200,000,000	194,448,972	-1.87	-1.87	—	

## 102 年國外委託經營(全球不動產有價證券型)

單位：美元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	103 年截至 9 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (103.8.27~103.9.30)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
PGI	50,000,000	47,025,485	-5.95	-5.95	1	-6.20
AMP	50,000,000	46,822,526	-6.35	-6.35	2	
合計	100,000,000	93,848,011	-6.15	-6.15	—	

### (二)103 年度被提前收回之國外委外投資帳戶

#### 基金國外委外投資被提前收回帳戶經理人名單及收回原因

1. 新制勞工退休基金：無
2. 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)

103年9月30日

#### 1. 避險：

種類	避險比例
權益證券避險	0%
匯率避險	7.70%

#### 2. 投資：無

### (二)舊制勞工退休基金自營部位

(依交易目的)

103年9月30日

#### 1. 避險：

種類	避險比例
權益證券避險	0%
匯率避險	1.23%

#### 2. 投資：無

## 七、勞工退休基金財務收支表

### (一)新制勞工退休基金

單位：新台幣元

	餘絀	營業收入	營業支出
103年9月	-22,258,148,870	10,680,153,768	32,938,302,638

註：上述金額係依權責基礎填列。

### (二)舊制勞工退休基金

單位：新台幣元

	餘絀	營業收入	營業支出
103年9月	-12,597,791,331	3,906,555,283	16,504,346,614

註：上述金額係依權責基礎填列。

## 八、勞工退休基金投資運用現金收支表

### (一)新制勞工退休基金

103年9月份

單位：新台幣元

項 目	金 額
基金收入	233,147,336,951
基金支出	231,936,550,374
現金增(減)數	1,210,786,577

註：本表採現金基礎。

### (二)舊制勞工退休基金

103年9月份

單位：新台幣元

項 目	金 額
基金收入	29,413,670,749
基金支出	29,413,666,597
現金增(減)數	4,152

註：本表採現金基礎。