勞工退休基金運用情形

一、勞工退休基金整體績效

（一）112 年截至 6 月底績效

基金與指標	新制基金	舊制基金	台灣 10 年期公債殖利率	台灣加權股價指數	MSCI 全球股票指數	Barclays 全球債券指數
收益率/報酬率	8.38%	10.00%	1.19%	19.65%	13.93%	1.43%

註 1：股、債指數係依據勞動部 111 年 4 月 29 日勞動福 4 字第 1110145465 號函核定之勞動基金投資政策書所載參考指標，且均為原幣別報酬率。

註 2：收益率係評價後收益數÷日平均餘額。

（二）近一年(111 年)績效

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

（三）近三年(109～111 年)平均績效

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

（四）近五年(107～111 年)平均績效

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

二、基金運用概況表

（一）基金規模與投資績效

1.新制勞工退休基金

112 年 6 月底止基金規模與收益			
基金運用規模			3 兆 7,878 億 6,032 萬元
112 年截至 6 月底止 運用收益數及收益率	自行運用	國內固定收益	62 億 3,699 萬元 1.48%
		國內權益證券 及國外投資	791 億 6,782 萬元 11.98%
	委託經營		2,212 億 9,469 萬元 10.29%
	合　　計		3,066 億 9,950 萬元 8.38%

註 1：勞工退休金條例施行細則第 34 條規定收益率事項應另以本局公告為準。
註 2：收益率係以當期收益率列示，惟國內固定收益係以年化收益率列示。
註 3：112 年 6 月之保證收益率為 1.5866%。

2.舊制勞工退休基金

112 年 6 月底止基金規模與收益			
基金運用規模			9,987 億 6,897 萬元
112 年截至 6 月底止 運用收益數及收益率	自行運用	國內固定收益	18 億 1,438 萬元 1.38%
		國內權益證券 及國外投資	431 億 3,496 萬元 18.15%
	委託經營		408 億 1,964 萬元 7.87%
	合　　計		857 億 6,898 萬元 10.00%

註：評價後報酬率係以當期報酬率（即收益÷112 年之日平均餘額）列示，惟國內固定收益係以年化報酬率列示。

(二)資產配置

1.新制勞工退休基金

112 年 6 月 30 日　　單位：新臺幣元

項　　目	餘　　額	占基金運用比率（%）
自行運用	**1,561,806,209,102**	**41.23**
轉存金融機構	508,202,054,070	13.42
短期票券	103,812,744,232	2.74
公債、公司債、金融債券及特別股	218,736,579,988	5.77
股票及受益憑證投資（含期貨）	248,218,343,885	6.55
國外投資	482,836,486,927	12.75
固定收益	359,811,642,047	9.50
權益證券	64,259,349,625	1.70
另類投資	58,765,495,255	1.55
委託經營	**2,226,054,111,358**	**58.77**
國內委託經營	495,054,888,969	13.07
國外委託經營	1,730,999,222,389	45.70
固定收益	417,856,215,613	11.03
權益證券	885,319,816,641	23.37
另類投資	427,823,190,135	11.30
合　　計	**3,787,860,320,460**	**100.00**

2.舊制勞工退休基金

112 年 6 月 30 日　　單位：新臺幣元

項　　目	餘　　額	占基金運用比率(％)
自行運用	**507,035,945,773**	**50.77**
轉存金融機構	161,386,417,322	16.16
短期票券	52,032,576,668	5.21
公債、金融債券、公司債及證券化商品	61,063,896,810	6.11
股票及受益憑證投資(含期貨)	119,199,465,206	11.94
國外投資	113,353,589,767	11.35
固定收益	59,261,549,147	5.93
權益證券	42,746,951,750	4.28
另類投資	11,345,088,870	1.14
委託經營	**491,733,024,012**	**49.23**
國內委託經營	96,667,847,114	9.67
國外委託經營	395,065,176,898	39.56
固定收益	102,693,640,310	10.28
權益證券	198,460,328,535	19.87
另類投資	93,911,208,053	9.41
合　　計	**998,768,969,785**	**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

112 年 6 月 30 日　　單位：新臺幣元

項　　目	金　　額	占基金運用比率（％）
自 行 運 用	1,561,806,209,102	41.23
委 託 經 營	2,226,054,111,358	58.77

2.舊制勞工退休基金

112 年 6 月 30 日　　單位：新臺幣元

項　　目	金　　額	占基金運用比率（％）
自 行 運 用	507,035,945,773	50.77
委 託 經 營	491,733,024,012	49.23

(四)基金國內投資與國外投資比率

1.新制勞工退休基金

112 年 6 月 30 日　　單位：新臺幣元

項　　目	金　　額	占基金運用比率（%）
國 內 投 資	1,574,024,611,144	41.55
國 外 投 資	2,213,835,709,316	58.45

2.舊制勞工退休基金

112 年 6 月 30 日　　單位：新臺幣元

項　　目	金　　額	占基金運用比率（%）
國 內 投 資	490,350,203,120	49.09
國 外 投 資	508,418,766,665	50.91

三、基金自營投資概況

(一)基金自營投資績效（國內權益證券）

1.新制勞工退休基金

112 年截至 6 月底

項　　目	收益率（%）
國內權益證券	22.33

2.舊制勞工退休基金

112 年截至 6 月底

項　　目	收益率（%）
國內權益證券	25.94

(二)基金自營股票及受益憑證投資比率概況

1.新制勞工退休基金

112 年 6 月 30 日　　單位：新臺幣元

項　　目	金　　額	比　　率（%）
國內權益證券	248,218,343,885	6.55

2.舊制勞工退休基金

112 年 6 月 30 日　　單位：新臺幣元

項　　目	金　　額	比　　率（%）
國內權益證券	119,199,465,206	11.94

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

投信名稱	委託金額	目前淨資產	112 年截至 6 月累積投資報酬（%）	委任迄今（111.9.27~112.6.30）		
				投資報酬率(%)	排名	目標報酬率（%）
野村	28,072,603,831	32,099,169,978	14.40	14.34	—	4.77

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

投信名稱	委託金額	目前淨資產	112 年截至 6 月累積投資報酬（%）	委任迄今（112.1.30~112.6.30）		
				投資報酬率(%)	排名	目標報酬率（%）
野村	6,829,066,771	7,529,074,922	10.25	10.25	—	2.65

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

98 年第一次委託經營(續約 4)

單位：新臺幣元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	112 年截至 6 月累積投資報酬(%)	委任迄今(110.7.16~112.6.30)		
				投資報酬率(%)	排名	目標報酬率(%)
野村	19,093,323,980	18,632,377,976	15.62	-2.41	2	11.08
保德信	6,277,574,114	6,229,407,810	20.27	-0.77	1	
合計	25,370,898,094	24,861,785,786	16.75	-2.01	—	

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 4 年年底股票集中市場平均殖利率加計 200 個基本點為基準。

99 年第二次委託經營(續約 3)

單位：新臺幣元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	112 年截至 6 月累積投資報酬(%)	委任迄今(111.12.5~112.6.30)		
				投資報酬率(%)	排名	目標報酬率(%)
國泰	10,445,113,310	10,528,021,799	0.61	0.79	—	3.61

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 2)(相對報酬)

單位：新臺幣元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	112 年截至 6 月累積投資報酬(%)	委任迄今(108.7.15~112.6.30)		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率(%)
復華	11,295,508,988	28,167,348,380	25.96	93.26	—	96.93

註：本批次為相對報酬型，以臺灣就業 99 指數為指定指標。

101 年第一次委託經營(續約 2)(相對報酬)

單位：新臺幣元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	112 年截至 6 月累積投資報酬(%)	委任迄今(109.4.20~112.6.30)		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率(%)
國泰	8,014,871,501	14,237,735,416	20.76	77.64	1	80.59
滙豐	10,927,481,593	18,998,831,711	19.60	73.86	2	
合計	18,942,353,094	33,236,567,127	20.09	75.46	—	

註：本批次為相對報酬型，以臺灣加權股價報酬指數為指定指標。

101 年第二次委託經營(續約 2)

單位：新臺幣元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	112 年截至 6 月累積投資報酬(%)	委任迄今(109.7.20~112.6.30)		
				投資報酬率(%)	排名	目標報酬率(%)
野村	9,057,257,704	11,551,622,348	15.31	27.54	1	17.05
統一	12,294,643,442	15,504,303,141	11.93	26.11	2	
合計	21,351,901,146	27,055,925,489	13.35	26.71	—	

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 200 個基本點為基準。

102 年第二次委託經營(續約 2)(相對報酬)

單位：新臺幣元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	112 年截至 6 月累積投資報酬(%)	委任迄今(111.1.24~112.6.30)		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率(%)
統一	14,437,134,744	14,868,390,589	26.76	2.99	1	0.78
復華	19,009,802,076	18,277,558,520	22.70	-3.85	2	
合計	33,446,936,820	33,145,949,109	24.48	-0.90	—	

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 年第一次委託經營第二期(續約 2)

單位：新臺幣元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	112 年截至 6 月累積投資報酬(%)	委任迄今(111.10.11~112.6.30)		
				投資報酬率(%)	排名	目標報酬率(%)
台新	15,841,461,125	18,097,368,574	15.65	14.24	—	4.53

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

投信名稱	委託金額	目前淨資產	112 年截至 6 月累積投資報酬(%)	委任迄今(110.12.1~112.6.30)		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率(%)
國泰	14,836,482,661	15,622,934,047	20.19	6.54	5	9.28
統一	11,353,734,691	12,240,009,164	21.11	7.81	3	
復華	10,890,868,617	11,750,000,435	20.61	7.89	2	
滙豐	10,790,827,015	11,671,190,844	19.78	8.16	1	
安聯	15,017,345,063	15,930,779,764	20.59	7.21	4	
合計	62,889,258,047	67,214,914,254	20.45	7.45	—	

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	112 年截至 6 月累積投資報酬(%)	委任迄今(112.4.6~112.6.30)		
				投資報酬率(%)	排名	目標報酬率(%)
復華	4,799,121,512	5,056,073,951	5.35	5.35	1	1.50
安聯	3,601,238,896	3,671,119,088	1.94	1.94	2	
合計	8,400,360,408	8,727,193,039	3.89	3.89	—	

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	112 年截至 6 月累積投資報酬（%）	委任迄今（112.2.7~112.6.30）		
				投資報酬率(%)	排名	目標報酬率（%）
安聯	14,088,712,403	15,191,795,026	7.83	7.83	1	2.51
國泰	6,318,453,600	6,500,444,269	2.88	2.88	4	
群益	6,382,621,945	6,851,439,571	7.35	7.35	2	
滙豐	7,096,535,878	7,541,765,934	6.27	6.27	3	
合計	33,886,323,826	36,085,444,800	6.49	6.49	—	

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。

107 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	112 年截至 6 月累積投資報酬（%）	委任迄今（107.10.24~112.6.30）		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率（%）
台新	6,000,000,000	10,285,641,816	22.36	102.91	6	111.09
安聯	6,000,000,000	10,964,815,328	20.63	116.46	2	
保德信	6,000,000,000	10,601,769,204	21.33	105.77	4	
統一	4,000,000,000	8,806,610,657	21.38	121.94	1	
國泰	6,000,000,000	10,543,647,020	20.59	105.65	5	
復華	4,000,000,000	8,404,368,110	20.99	107.36	3	
群益	2,500,000,000	6,505,164,360	20.98	100.30	7	
合計	34,500,000,000	66,112,016,495	21.18	108.47	—	

註：本批次為相對報酬型，以臺灣永續報酬指數為指定指標。

107 年第二次委託經營

單位：新臺幣元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	112 年截至 6 月累積投資報酬（%）	委任迄今（108.5.24~112.6.30）		
				投資報酬率(%)	排名	目標報酬率（%）
安聯	6,000,000,000	9,294,353,526	12.05	61.89	2	24.63
施羅德	6,000,000,000	8,728,679,675	8.85	50.58	5	
統一	6,000,000,000	9,382,198,215	17.80	62.69	1	
野村	11,000,000,000	14,872,894,547	15.59	61.68	3	
國泰	11,000,000,000	15,090,595,445	12.23	57.70	4	
復華	6,000,000,000	8,268,496,955	16.87	45.97	6	
合計	46,000,000,000	65,637,218,363	13.82	56.60	—	

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 200 個基本點為基準。

109 年第一次委託經營

單位：新臺幣元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	112 年截至 6 月累積投資報酬（%）	委任迄今（110.5.13~112.6.30）		
				投資報酬率（%）	排名	目標報酬率（%）
台新	8,000,000,000	8,526,241,384	18.66	6.58	2	12.37
安聯	8,000,000,000	8,481,095,500	9.51	6.01	3	
保德信	8,000,000,000	8,058,218,528	16.89	0.73	5	
國泰	8,000,000,000	8,897,744,576	17.32	11.22	1	
野村	8,000,000,000	8,254,389,495	13.76	3.18	4	
合計	40,000,000,000	42,217,689,483	15.15	5.54	—	

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

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	112 年截至 6 月累積投資報酬（%）	委任迄今（111.5.13~112.6.30）		
				投資報酬率（%）	排名	指標報酬率（%）
安聯	3,000,000,000	3,885,995,938	27.64	24.95	2	32.85
保德信	3,000,000,000	3,903,781,570	27.80	26.52	1	
野村	3,000,000,000	3,933,536,151	29.99	24.68	3	
國泰	3,000,000,000	3,894,018,698	28.12	24.63	4	
富邦	3,000,000,000	3,856,455,348	27.50	22.58	5	
合計	15,000,000,000	19,473,787,705	28.21	24.67	—	

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	112 年截至 6 月累積投資報酬（%）	委任迄今（110.12.15~112.6.30）		
				投資報酬率(%)	排名	目標報酬率（%）
安聯	6,000,000,000	6,128,806,788	11.28	-0.37	2	9.60
保德信	6,000,000,000	6,424,514,480	20.76	3.96	1	
國泰	6,000,000,000	6,060,697,374	10.62	-0.68	3	
第一金	6,000,000,000	6,096,936,236	10.72	-1.81	4	
野村	6,000,000,000	5,887,821,914	13.66	-5.65	6	
富邦	6,000,000,000	6,037,805,300	19.61	-3.16	5	
合計	36,000,000,000	36,636,582,092	14.34	-1.28	—	

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

投信名稱	委託金額	目前淨資產	112 年截至 6 月累積投資報酬(%)	委任迄今(111.1.28~112.6.30)		
				投資報酬率(%)	排名	目標報酬率(%)
富邦	12,256,867,963	11,584,662,126	20.63	-5.48	2	8.65
統一	10,364,185,361	10,497,598,351	16.76	1.29	1	
合計	22,621,053,324	22,082,260,477	18.76	-2.38	—	

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 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

投信名稱	委託金額	目前淨資產	112 年截至 6 月累積投資報酬(%)	委任迄今(109.11.2~112.6.30)		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率(%)
匯豐	5,685,000,000	8,169,619,472	19.56	43.70	—	47.97

註：本批次為相對報酬型，以臺灣加權股價報酬指數為指定指標。

國內 101 年第二次委託經營(續約 2)

單位：新臺幣元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	112 年截至 6 月累積投資報酬(%)	委任迄今(109.05.04~112.6.30)		
				投資報酬率(%)	排名	目標報酬率(%)
野村	19,272,822,959	27,278,028,800	15.61	41.54	—	18.36

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

國內 104 年第一次委託經營(續約 2)

單位：新臺幣元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	112 年截至 6 月累積投資報酬(%)	委任迄今(112.4.6~112.6.30)		
				投資報酬率(%)	排名	目標報酬率(%)
復華	4,800,107,976	5,057,095,273	5.35	5.35	1	1.50
安聯	3,601,947,821	3,671,845,515	1.94	1.94	2	
合計	8,402,055,797	8,728,940,788	3.89	3.89	—	

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

國內 106 年第一次委託經營

單位：新臺幣元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	112 年截至 6 月累積投資報酬(%)	委任迄今(112.2.7~112.6.30)		
				投資報酬率(%)	排名	目標報酬率(%)
安聯	14,089,937,312	15,193,157,573	7.83	7.83	1	2.51
國泰	6,319,107,110	6,501,164,089	2.88	2.88	4	
群益	6,384,957,618	6,853,950,665	7.35	7.35	2	
滙豐	7,097,524,598	7,542,844,803	6.27	6.27	3	
合計	33,891,526,638	36,091,117,130	6.49	6.49	—	

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 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	112 年截至 6 月累積投資報酬(%)	委任迄今(111.5.13~112.6.30)		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率(%)
安聯	1,000,000,000	1,295,411,222	27.64	24.99	2	32.85
保德信	1,000,000,000	1,301,286,802	27.80	26.51	1	
野村	1,000,000,000	1,311,216,074	30.00	24.69	3	
國泰	1,000,000,000	1,298,082,854	28.12	24.66	4	
富邦	1,000,000,000	1,285,466,642	27.48	22.66	5	
合計	5,000,000,000	6,491,463,594	28.21	24.70	—	

註：本批次為相對報酬型，以臺灣企業社會責任中小型報酬指數為指定指標。

(二) 112 年 6 月被提前收回之國內委外投資帳戶

1. 基金國內委外投資被提前收回帳戶經理人名單及收回原因

新制勞工退休基金：無

舊制勞工退休基金：無

2. 受託機構經管本基金帳戶被主管機關懲處之相關資訊

新制勞工退休基金：無

舊制勞工退休基金：無

五、基金國外委外投資概況表

(一)基金國外委外投資績效、績效指標及排名表

1. 新制勞工退休基金

97-1 全球主動債券型（續約 3） 單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	112 年截至 6 月累積投資報酬（%）	委任迄今（110.6.7~112.6.30）		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率（%）
聯博	907,613,021	739,623,242	1.19	-18.51	2	-18.02
富蘭克林坦伯頓	1,151,737,838	1,043,488,355	1.44	-14.17	1	
合計	2,059,350,859	1,783,111,597	1.34	-16.31	—	

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	112 年截至 6 月累積投資報酬（%）	委任迄今（111.1.6~112.6.30）		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率（%）
PIMCO	2,158,967,886	1,893,999,010	1.46	-14.50	—	-14.94

97-2 全球增值股票型（續約 3）

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	112 年截至 6 月累積投資報酬（%）	委任迄今（111.2.6~112.6.30）		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率（%）
貝萊德	1,734,805,538	1,733,597,719	14.11	-0.07	2	-2.38
摩根	1,485,120,883	1,484,205,807	14.90	-0.06	1	
合計	3,219,926,421	3,217,803,526	14.47	-0.07	—	

98-1 亞太（日本除外）主動股票型（續約 3）

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	112 年截至 6 月累積投資報酬（%）	委任迄今（111.11.17~112.6.30）		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率（%）
景順	656,507,639	720,451,527	6.15	9.74	—	4.55

98-1 全球被動股票型（續約 3）

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	112 年截至 6 月累積投資報酬（%）	委任迄今（111.12.4~112.6.30）		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率（%）
貝萊德	991,092,316	1,081,904,382	14.15	9.16	2	8.98
道富	1,313,655,177	1,436,982,476	14.30	9.39	1	
合計	2,304,747,493	2,518,886,858	14.24	9.29	—	

99-1 全球新興市場主動股票型（續約 2）

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	112 年截至 6 月累積投資報酬（%）	委任迄今（107.8.27~112.6.30）		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率（%）
瑞萬通博	557,229,489	532,702,289	1.88	-5.75	—	8.64

100-1 全球基本面指數被動股票型（續約 2）

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	112 年截至 6 月累積投資報酬（%）	委任迄今（110.7.1~112.6.30）		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率（%）
道富	934,565,605	969,190,341	8.19	3.70	1	2.37
貝萊德	939,726,931	972,271,580	8.23	3.46	2	
合計	1,874,292,536	1,941,461,921	8.21	3.58	—	

100-1 全球不動產有價證券型（續約 2）

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	112 年截至 6 月累積投資報酬（%）	委任迄今（111.3.6~112.6.30）		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率（%）
Cohen & Steers	2,410,932,432	2,062,723,300	2.64	-15.41	1	-17.91
景順	1,487,127,452	1,249,065,818	0.95	-16.01	2	
合計	3,898,059,884	3,311,789,118	1.99	-15.62	—	

101-1 全球新興市場主動債券型（續約 2）

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	112 年截至 6 月累積投資報酬（%）	委任迄今（111.7.31~112.6.30）		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率（%）
Pictet	618,843,493	665,605,985	6.51	8.06	—	8.09

101-1 全球低波動指數被動股票型（續約 2）

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	112 年截至 6 月累積投資報酬（%）	委任迄今（112.4.18~112.6.30）		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率（%）
道富	1,113,392,347	1,108,010,829	-0.48	-0.48	1	-0.63
貝萊德	1,132,011,599	1,126,096,268	-0.52	-0.52	2	
合計	2,245,403,946	2,234,107,097	-0.50	-0.50	—	

102-1 全球高股利增值股票型（續約）

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	112 年截至 6 月累積投資報酬（%）	委任迄今（108.1.22~112.6.30）		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率（%）
瑞萬通博	1,136,315,337	1,588,603,443	14.74	54.81	1	32.40
MFS	703,318,800	969,402,434	3.20	43.42	3	
威靈頓	951,647,315	1,282,488,700	3.63	45.63	2	
合計	2,791,281,452	3,840,494,577	7.84	47.87	—	

102-1 全球信用主動債券型 （續約）

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	112 年截至 6 月累積投資報酬（%）	委任迄今（108.4.25~112.6.30）		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率（%）
RBC	936,338,464	945,658,402	3.95	4.76	1	-2.63
貝萊德	687,231,657	651,956,513	2.78	-2.40	3	
盧米斯	892,703,100	868,921,308	3.77	0.11	2	
合計	2,516,273,221	2,466,536,223	3.55	0.68	—	

104-1 全球高品質被動股票型（續約）

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	112 年截至 6 月累積投資報酬（%）	委任迄今（109.8.11~112.6.30）		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率（%）
北美信託	1,596,617,127	1,992,443,413	21.25	29.45	2	28.39
LGIM	1,605,083,447	1,997,671,401	21.27	29.22	3	
Geode	1,575,075,832	1,973,246,148	21.46	29.66	1	
合計	4,776,776,406	5,963,360,962	21.33	29.44	—	

104-2 全球基礎建設有價證券型（續約）

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	112 年截至 6 月累積投資報酬（%）	委任迄今（109.9.25~112.6.30）		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率（%）
Magellan	1,437,520,518	1,685,465,188	4.30	17.25	2	23.88
RREEF	926,848,763	1,142,783,468	0.95	23.30	1	
合計	2,364,369,281	2,828,248,656	2.92	19.62	—	

104-1 全球主權信用增值債券型（續約）

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	112 年截至 6 月累積投資報酬（%）	委任迄今（109.11.13~112.6.30）		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率（%）
Brandywine	821,176,083	710,979,601	2.66	-15.11	2	-17.22
盧米斯	471,104,127	419,580,602	3.82	-14.02	1	
合計	1,292,280,210	1,130,560,203	3.03	-14.84	—	

105-1 全球多元資產型（續約）

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	112 年截至 6 月累積投資報酬（%）	委任迄今（110.7.20~112.6.30）		
				投資報酬率(%)	排名	指標/目標報酬率(%)
Allianz	578,698,278	554,094,308	3.00	-5.81	2	4.34/14.08
摩根	1,645,715,430	1,501,087,764	3.56	-8.79	3	
DWS	975,711,371	974,600,779	6.82	-0.33	1	
柏瑞	765,326,657	682,209,655	2.52	-10.86	4	
合計	3,965,451,736	3,711,992,506	4.14	-6.75	—	

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

105-1 亞太混合指數增值股票型（續約）

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	112 年截至 6 月累積投資報酬（%）	委任迄今（110.8.24~112.6.30）		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率（%）
貝萊德	949,175,052	880,731,677	8.15	-7.21	—	-7.91

106-1 全球 ESG 混合指數被動股票型(續約)

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	112 年截至 6 月累積投資報酬（%）	委任迄今（111.6.22~112.6.30）		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率（%）
貝萊德	551,552,002	625,108,903	11.52	13.47	3	13.09
DWS	648,715,051	741,668,189	11.79	14.59	2	
道富	649,045,562	742,103,942	11.75	14.59	1	
北美信託	652,047,560	738,274,855	11.55	13.37	4	
合計	2,501,360,175	2,847,155,889	11.66	14.02	—	

106-1 絕對報酬債券型(續約)

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	112 年截至 6 月累積投資報酬(%)	委任迄今(111.7.25~112.6.30)		
				投資報酬率(%)	排名	指標/目標報酬率(%)
American Century	427,360,620	436,024,280	2.27	2.03	2	3.86/6.19
富達	965,211,657	1,061,805,739	4.25	10.01	1	
TCW	1,039,618,153	1,060,088,461	2.68	1.95	3	
合計	2,432,190,430	2,557,918,480	3.25	5.21	—	

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

107-1 絕對報酬股票型

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	112 年截至 6 月累積投資報酬(%)	委任迄今(108.1.23~112.6.30)		
				投資報酬率(%)	排名	指標/目標報酬率(%)
Nomura	300,000,000	303,017,479	0.91	4.84	5	7.45/29.64
景順	580,000,000	739,629,125	3.49	42.70	1	
威靈頓	600,000,000	748,356,500	6.12	35.21	3	
CPR	580,000,000	741,316,396	12.87	39.73	2	
道富	580,000,000	679,847,202	3.39	23.87	4	
合計	2,640,000,000	3,212,166,702	5.86	29.21	—	

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

108-1 全球新興市場動態多元因子指數增值股票型

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	112 年截至 6 月累積投資報酬（%）	委任迄今（108.12.18~112.6.30）		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率（%）
Amundi	400,000,000	437,105,102	5.71	0.37	4	1.97
DWS	400,000,000	407,137,034	4.32	-4.43	5	
Nomura	400,000,000	480,495,940	6.98	10.95	2	
荷寶	300,000,000	379,770,217	8.32	11.18	1	
道富	300,000,000	376,357,973	8.24	9.31	3	
合計	1,800,000,000	2,080,866,266	6.64	5.05	—	

109-1 全球美元公司增值債券型

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	112 年截至 6 月累積投資報酬（%）	委任迄今（110.1.13~112.6.30）		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率（%）
DWS	600,000,000	558,030,992	3.24	-12.63	2	-12.02
INSIGHT	600,000,000	561,748,268	3.23	-11.86	1	
摩根	400,000,000	355,839,742	3.19	-12.78	4	
PIMCO	400,000,000	355,826,508	2.93	-12.69	3	
WESTERN	400,000,000	352,203,238	3.24	-13.36	5	
合計	2,400,000,000	2,183,648,748	3.18	-12.67	—	

110-1 全球基礎建設有價證券型

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	112 年截至 6 月累積投資報酬（%）	委任迄今（110.9.8~112.6.30）		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率（%）
CBRE	350,000,000	342,898,320	2.16	-1.50	2	-1.58
Clearbridge	450,000,000	450,266,428	3.08	2.21	1	
Magellan	350,000,000	343,809,667	3.51	-3.25	3	
RREEF	350,000,000	335,537,637	1.09	-3.81	4	
合計	1,500,000,000	1,472,512,052	2.53	-1.48	—	

110-1 全球多元資產型

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	112 年截至 6 月累積投資報酬（%）	委任迄今（110.10.15~112.6.30）		
				投資報酬率(%)	排名	指標/目標報酬率(%)
富達	400,000,000	347,641,505	4.81	-13.44	5	4.34/12.88
摩根	400,000,000	358,437,440	3.55	-10.55	4	
Ninety One	400,000,000	392,293,217	0.50	-2.44	1	
Schroders	400,000,000	375,428,603	5.79	-6.53	2	
T. Rowe Price	400,000,000	369,742,645	6.33	-8.65	3	
合計	2,000,000,000	1,843,543,410	4.11	-8.32	—	

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型

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	112 年截至 6 月累積投資報酬(%)	委任迄今(112.4.28~112.6.30)		
				投資報酬率(%)	排名	指標/目標報酬率(%)
匯豐	100,000,000	104,645,351	4.65	4.65	4	5.36
LGIM	100,000,000	104,655,637	4.66	4.66	3	
摩根士坦利	100,000,000	104,385,428	4.39	4.39	5	
Schroders	100,000,000	105,764,986	5.76	5.76	1	
威靈頓	100,000,000	105,410,788	5.41	5.41	2	
合計	500,000,000	524,862,190	4.97	4.97	—	

2.舊制勞工退休基金

96 國際平衡型(續約 3)

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	112 年截至 6 月累積投資報酬率(%)	委任迄今(108.6.24~112.6.30)		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率(%)
富達	786,579,222	962,312,670	7.42	19.66	—	21.28

97-1 全球增值債券型(續約 3)

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	112 年截至 6 月累積投資報酬率(%)	委任迄今(111.1.6~112.6.30)		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率(%)
PIMCO	1,003,724,736	859,181,024	1.59	-14.40	1	-14.94
盧米斯	948,693,762	805,257,455	1.25	-15.12	2	
合計	1,952,418,498	1,664,438,479	1.42	-14.75	—	

97-1 全球增值股票型(續約 3)

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	112 年截至 6 月累積投資報酬(%)	委任迄今(111.2.6~112.6.30)		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率(%)
貝萊德	1,156,987,544	1,156,329,960	14.11	-0.06	—	-2.38

98-1 亞太(日本除外)主動股票型(續約 3)

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	112 年截至 6 月累積投資報酬(%)	委任迄今(111.11.17~112.6.30)		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率(%)
景順	281,124,998	308,321,661	6.19	9.67	—	4.55

100-1 全球基本面指數被動股票型(續約 2)

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	112 年截至 6 月累積投資報酬率(%)	委任迄今(111.3.6~112.6.30)		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率(%)
貝萊德	304,997,166	318,920,372	8.27	4.57	4	3.63
道富	360,436,214	378,123,747	8.06	4.91	1	
瑞銀	308,879,836	323,648,652	8.19	4.78	2	
Nomura	360,147,608	377,116,762	8.21	4.71	3	
合計	1,334,460,824	1,397,809,533	8.18	4.75	—	

101-1 全球低波動指數被動股票型(續約 2)

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	112 年截至 6 月累積投資報酬率(%)	委任迄今(112.4.18~112.6.30)		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率(%)
貝萊德	751,993,706	748,118,174	-0.52	-0.52	—	-0.63

102-1 年全球高股利增值股票型(續約)

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	112 年截至 6 月累積投資報酬率(%)	委任迄今(108.1.22~112.6.30)		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率(%)
瑞萬通博	287,169,673	445,050,721	14.69	54.98	1	32.40
MFS	246,618,331	353,942,638	3.28	43.52	3	
威靈頓	503,548,464	733,721,307	3.65	45.71	2	
合計	1,037,336,468	1,532,714,666	6.54	47.75	—	

102-2 全球基礎建設有價證券型(續約)

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	112 年截至 6 月累積投資報酬率(%)	委任迄今(108.5.29~112.6.30)		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率(%)
Lazard	713,987,040	908,188,081	8.81	28.17	—	16.69

102-2 全球不動產有價證券型（續約）

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	112 年截至 6 月累積投資報酬率(%)	委任迄今(108.8.27~112.6.30)		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率(%)
信安環球	610,886,182	597,902,594	2.22	-5.32	2	-8.74
Macquarie	126,937,100	125,214,525	1.34	-1.36	1	
合計	737,823,282	723,117,119	2.07	-4.59	—	

105-1 全球多元資產型（續約）

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	112 年截至 6 月累積投資報酬率（%）	委任迄今（110.7.20~112.6.30）		
				投資報酬率(%)	排名	指標/目標報酬率(%)
Allianz	155,447,975	146,677,665	3.07	-5.64	2	4.34/14.08
摩根	594,592,070	543,623,942	3.54	-8.57	3	
DWS	311,387,682	310,552,063	6.77	-0.27	1	
柏瑞	254,823,294	226,764,752	2.52	-11.01	4	
合計	1,316,251,021	1,227,618,422	4.09	-6.73	—	

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

106-1 全球 ESG 混合指數被動股票型（續約）

單位:美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	112 年截至 6 月累積投資報酬率（%）	委任迄今（111.6.22~112.6.30）		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率（%）
貝萊德	127,303,524	144,292,905	11.48	13.35	3	13.09
DWS	147,528,441	168,959,674	11.77	14.53	2	
道富	157,982,595	181,124,593	11.76	14.65	1	
北美信託	158,484,700	179,402,884	11.47	13.20	4	
合計	591,299,260	673,780,056	11.63	13.95	—	

106-1 絕對報酬債券型(續約)

單位:美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	112 年截至 6 月累積投資報酬率（%）	委任迄今（111.7.25~112.6.30）		
				投資報酬率(%)	排名	指標/目標報酬率(%)
American Century	319,635,794	326,105,202	2.25	2.02	3	3.86/6.19
富達	299,785,344	330,563,551	4.17	10.27	1	
TCW	328,000,470	334,730,954	2.78	2.05	2	
合計	947,421,608	991,399,707	3.06	4.64	—	

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

107-1 絕對報酬股票型

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	112 年截至 6 月累積投資報酬率（%）	委任迄今（108.1.23~112.6.30）		
				投資報酬率(%)	排名	指標/目標報酬率(%)
Nomura	40,000,000	36,460,434	1.01	4.97	5	7.45/29.64
景順	80,000,000	109,990,062	3.52	41.89	1	
威靈頓	80,000,000	102,223,195	6.19	35.46	3	
CPR	80,000,000	109,543,887	13.08	40.09	2	
道富	80,000,000	93,650,869	3.38	23.66	4	
合計	360,000,000	451,868,447	6.05	30.04	—	

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

110-1 全球基礎建設有價證券型

單位:美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	112 年截至 6 月累積投資報酬率（%）	委任迄今（110.9.8~112.6.30）		
				投資報酬率(%)	排名	指標/目標報酬率(%)
CBRE	30,000,000	29,572,436	2.18	-1.43	2	-1.58
ClearBridge	30,000,000	30,725,157	2.84	2.42	1	
Magellan	30,000,000	29,208,340	3.53	-2.64	3	
RREEF	30,000,000	29,052,233	1.09	-3.16	4	
合計	120,000,000	118,558,166	2.41	-1.20	—	

(二)112 年度被提前收回之國外委外投資帳戶

新制勞工退休基金： 無

舊制勞工退休基金：無

六、基金投資衍生性金融商品概況表

(一)新制勞工退休基金自營部位

（依交易目的）

112 年 6 月 30 日

1. 避險：

種類	避險比率
權益證券避險	0%
匯率避險	0%

2. 投資：無

(二)舊制勞工退休基金自營部位

（依交易目的）

112 年 6 月 30 日

1. 避險：

種類	避險比率
權益證券避險	0%
匯率避險	0%

2. 投資：無

七、勞工退休基金財務收支表

(一)新制勞工退休基金

單位：新臺幣元

	餘絀	收入	支出
112 年 6 月份	120,735,231,029	126,058,965,927	5,323,734,898

(二)舊制勞工退休基金

單位：新臺幣元

	餘絀	收入	支出
112 年 6 月份	30,612,186,525	33,083,444,454	2,471,257,929

八、勞工退休基金投資運用現金收支表

(一)新制勞工退休基金

112 年 6 月份　　單位：新臺幣元

項　　目	金　　額
現金收入	217,164,377,738
現金支出	213,108,231,840
現金增(減)數	4,056,145,898

(二)舊制勞工退休基金

112 年 6 月份　　單位：新臺幣元

項　　目	金　　額
現金收入	25,359,074,904
現金支出	25,359,147,656
現金增(減)數	-72,752