

# 勞工退休基金運用情形

## 一、勞工退休基金整體績效

### (一) 114 年截至 11 月底績效

| 基金與指標   | 新制基金    | 舊制基金    | 臺灣 10 年期<br>公債殖利率 | 臺灣加權<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 | 13. 70% | 20. 07% | 1. 48%            | 19. 93%      | 21. 07%         | 7. 89%              |

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(113 年)績效

| 基金與指標   | 新制基金    | 舊制基金    | 臺灣 10 年期<br>公債殖利率 | 臺灣加權<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 | 16. 16% | 19. 36% | 1. 51%            | 28. 47%      | 17. 49%         | -1. 69%             |

### (三) 近三年(111~113 年)平均績效

| 基金與指標   | 新制基金   | 舊制基金   | 臺灣 10 年期<br>公債殖利率 | 臺灣加權<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 | 8. 23% | 8. 73% | 1. 10%            | 8. 13%       | 5. 44%          | -4. 52%             |

### (四) 近五年(109~113 年)平均績效

| 基金與指標   | 新制基金   | 舊制基金   | 臺灣 10 年期<br>公債殖利率 | 臺灣加權<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 | 8. 28% | 9. 16% | 0. 96%            | 13. 94%      | 10. 06%         | -1. 96%             |

## 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

| 114 年 11 月底止基金規模與收益          |      |                      |                            |
|------------------------------|------|----------------------|----------------------------|
| 基金運用規模                       |      | 5 兆 1,006 億 4,276 萬元 |                            |
| 114 年 截至 11 月底止<br>運用收益數及收益率 | 自行運用 | 國內固定收益               | 145 億 3,713 萬元<br>1.82%    |
|                              |      | 國內權益證券<br>及國外投資      | 1,476 億 6,210 萬元<br>14.37% |
|                              | 委託經營 |                      | 4,889 億 6,940 萬元<br>17.12% |
|                              | 合計   |                      | 6,511 億 6,864 萬元<br>13.70% |

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 3：114 年 11 月之保證收益率為 1.7108%。

#### 2. 舊制勞工退休基金

| 114 年 11 月底止基金規模與收益          |      |                   |                            |
|------------------------------|------|-------------------|----------------------------|
| 基金運用規模                       |      | 10,584 億 9,843 萬元 |                            |
| 114 年 截至 11 月底止<br>運用收益數及收益率 | 自行運用 | 國內固定收益            | 41 億 4,112 萬元<br>1.69%     |
|                              |      | 國內權益證券<br>及國外投資   | 745 億 8,023 萬元<br>35.82%   |
|                              | 委託經營 |                   | 1,046 億 6,299 萬元<br>17.93% |
|                              | 合計   |                   | 1,833 億 8,434 萬元<br>20.07% |

註：評價後報酬率係以當期報酬率（即收益÷114 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

114年11月30日

單位：新臺幣元

| 項 目             | 餘 額               | 占基金運用比率(%) |
|-----------------|-------------------|------------|
| 自行運用            | 1,949,123,637,130 | 38.21      |
| 轉存金融機構          | 542,328,272,601   | 10.63      |
| 短期票券            | 100,253,447,079   | 1.97       |
| 公債、公司債、金融債券及特別股 | 236,467,578,193   | 4.64       |
| 股票及受益憑證投資(含期貨)  | 256,518,389,678   | 5.03       |
| 國外投資            | 813,555,949,579   | 15.94      |
| 固定收益            | 715,933,602,964   | 14.03      |
| 權益證券            | 49,448,499,127    | 0.97       |
| 另類投資            | 48,173,847,488    | 0.94       |
| 委託經營            | 3,151,519,121,344 | 61.79      |
| 國內委託經營          | 760,343,497,298   | 14.91      |
| 國外委託經營          | 2,391,175,624,046 | 46.88      |
| 固定收益            | 579,345,517,055   | 11.36      |
| 權益證券            | 1,309,995,540,036 | 25.68      |
| 另類投資            | 501,834,566,955   | 9.84       |
| 合 計             | 5,100,642,758,474 | 100.00     |

## 2. 舊制勞工退休基金

114 年 11 月 30 日

單位：新臺幣元

| 項 目               | 餘 額               | 占基金運用比率(%) |
|-------------------|-------------------|------------|
| 自行運用              | 462,036,430,086   | 43.65      |
| 轉存金融機構            | 130,068,499,260   | 12.29      |
| 短期票券              | 36,524,773,048    | 3.45       |
| 公債、金融債券、公司債及證券化商品 | 88,611,573,788    | 8.37       |
| 股票及受益憑證投資(含期貨)    | 123,737,866,461   | 11.69      |
| 國外投資              | 83,093,717,529    | 7.85       |
| 固定收益              | 44,331,349,152    | 4.19       |
| 權益證券              | 31,645,160,176    | 2.99       |
| 另類投資              | 7,117,208,201     | 0.67       |
| 委託經營              | 596,461,995,239   | 56.35      |
| 國內委託經營            | 146,147,802,674   | 13.81      |
| 國外委託經營            | 450,314,192,565   | 42.54      |
| 固定收益              | 102,170,551,929   | 9.65       |
| 權益證券              | 238,835,090,223   | 22.56      |
| 另類投資              | 109,308,550,413   | 10.33      |
| 合 計               | 1,058,498,425,325 | 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

114 年 11 月 30 日

單位：新臺幣元

| 項 目  | 金 領               | 占基金運用比率 (%) |
|------|-------------------|-------------|
| 自行運用 | 1,949,123,637,130 | 38.21       |
| 委託經營 | 3,151,519,121,344 | 61.79       |

#### 2. 舊制勞工退休基金

114 年 11 月 30 日

單位：新臺幣元

| 項 目  | 金 領             | 占基金運用比率 (%) |
|------|-----------------|-------------|
| 自行運用 | 462,036,430,086 | 43.65       |
| 委託經營 | 596,461,995,239 | 56.35       |

## (四)基金國內投資與國外投資比率

### 1. 新制勞工退休基金

114 年 11 月 30 日

單位：新臺幣元

| 項 目     | 金 頭               | 占基金運用比率 (%) |
|---------|-------------------|-------------|
| 國 內 投 資 | 1,895,911,184,849 | 37.18       |
| 國 外 投 資 | 3,204,731,573,625 | 62.82       |

### 2. 舊制勞工退休基金

114 年 11 月 30 日

單位：新臺幣元

| 項 目     | 金 頭             | 占基金運用比率 (%) |
|---------|-----------------|-------------|
| 國 內 投 資 | 525,090,515,231 | 49.61       |
| 國 外 投 資 | 533,407,910,094 | 50.39       |

## 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

114 年 截至 11 月底

| 項 目    | 收 益 率 (%) |
|--------|-----------|
| 國內權益證券 | 50.07     |

#### 2. 舊制勞工退休基金

114 年 截至 11 月底

| 項 目    | 收 益 率 (%) |
|--------|-----------|
| 國內權益證券 | 50.28     |

## (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

114 年 11 月 30 日 單位：新臺幣元

| 項 目    | 金 領             | 比 率 (%) |
|--------|-----------------|---------|
| 國內權益證券 | 256,518,389,678 | 5.03    |

### 2. 舊制勞工退休基金

114 年 11 月 30 日 單位：新臺幣元

| 項 目    | 金 領             | 比 率 (%) |
|--------|-----------------|---------|
| 國內權益證券 | 123,737,866,461 | 11.69   |

## 四、基金國內外委外投資概況表

### (一)基金國內外委外投資績效、績效指標及排名表

#### 1. 新制勞工退休基金

96 年第一次委託經營(續約 6)

單位：新臺幣元

| 投信<br>名稱 | 委託金額           | 目前淨資產          | 114 年截至 11 月<br>累積投資報酬<br>(%) | 委任迄今<br>(114.9.27~114.11.30) |    |              |
|----------|----------------|----------------|-------------------------------|------------------------------|----|--------------|
|          |                |                |                               | 投資報酬率<br>(%)                 | 排名 | 目標報酬率<br>(%) |
| 野村       | 53,037,175,831 | 61,604,633,961 | 16.15                         | 16.15                        | —  | 1.13         |

註：本批次為絕對報酬型，契約目標報酬率係以臺灣證交所公告之最近 5 年年底股票集中市場平均殖利率加計 300 個基本點為基準。

97 年第一次委託經營(續約 5)

單位：新臺幣元

| 投信<br>名稱 | 委託金額          | 目前淨資產          | 114 年截至 11 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(112.1.30~114.11.30) |    |              |
|----------|---------------|----------------|---------------------------|------------------------------|----|--------------|
|          |               |                |                           | 投資報酬率<br>(%)                 | 排名 | 目標報酬率<br>(%) |
| 野村       | 6,829,066,771 | 14,018,035,215 | 33.25                     | 105.27                       | —  | 17.32        |

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          | 114 年截至 11 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今         |    |              |
|----------|----------------|----------------|---------------------------|--------------|----|--------------|
|          |                |                |                           | 投資報酬率<br>(%) | 排名 | 目標報酬率<br>(%) |
| 野村       | 25,455,695,879 | 34,948,175,435 | 39.10                     | 37.29        | 1  | 8.16         |
| 玉山       | 7,430,070,832  | 9,011,475,622  | 16.54                     | 21.28        | 2  |              |
| 合計       | 32,885,766,711 | 43,959,651,057 | 33.79                     | 33.67        | —  |              |

註：1.本批次為絕對報酬型，契約目標報酬率係以臺灣證交所公告之最近 5 年年底股票集中市場平均殖利率加計 250 個基本點為基準。

2.保德信投信於 114.10.1 正式更名為玉山投信。

## 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          | 114 年截至 11 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今         |    |              |
|----------|----------------|----------------|---------------------------|--------------|----|--------------|
|          |                |                |                           | 投資報酬率<br>(%) | 排名 | 目標報酬率<br>(%) |
| 國泰       | 10,445,113,310 | 16,197,168,416 | 23.73                     | 55.07        | —  | 18.28        |

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。

## 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          | 114 年截至 11 月<br>累積投資報酬<br>(%) | 委任迄今         |    |              |
|----------|----------------|----------------|-------------------------------|--------------|----|--------------|
|          |                |                |                               | 投資報酬率<br>(%) | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| 復華       | 29,101,525,086 | 45,691,399,837 | 24.50                         | 57.01        | —  | 50.10        |

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          | 114 年截至 11 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今         |    |              |
|----------|----------------|----------------|---------------------------|--------------|----|--------------|
|          |                |                |                           | 投資報酬率<br>(%) | 排名 | 目標報酬率<br>(%) |
| 野村       | 15,198,354,580 | 23,174,273,220 | 42.91                     | 52.48        | 1  | 8.10         |
| 統一       | 20,913,151,881 | 26,852,684,314 | 26.62                     | 28.40        | 2  |              |
| 合計       | 36,111,506,461 | 50,026,957,534 | 33.68                     | 38.53        | —  |              |

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。

## 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          | 114 年截至 11 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今         |    |              |
|----------|----------------|----------------|---------------------------|--------------|----|--------------|
|          |                |                |                           | 投資報酬率<br>(%) | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| 統一       | 14,437,134,744 | 29,316,413,162 | 30.77                     | 103.06       | 1  | 76.78        |
| 復華       | 18,009,802,076 | 32,878,703,172 | 32.06                     | 80.82        | 2  |              |
| 合計       | 32,446,936,820 | 62,195,116,334 | 31.45                     | 90.48        | —  |              |

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          | 114 年截至 11 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今         |    |              |
|----------|----------------|----------------|---------------------------|--------------|----|--------------|
|          |                |                |                           | 投資報酬率<br>(%) | 排名 | 目標報酬率<br>(%) |
| 台新       | 15,841,461,125 | 27,291,417,152 | 15.65                     | 72.28        | —  | 19.20        |

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

## 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           | 114 年截至 11 月<br>累積投資報酬<br>(%) | 委任迄今<br>(110.12.1~114.11.30) |    |              |
|----------|----------------|-----------------|-------------------------------|------------------------------|----|--------------|
|          |                |                 |                               | 投資報酬率<br>(%)                 | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| 國泰       | 14,836,482,661 | 25,658,255,796  | 16.43                         | 74.98                        | 4  | 78.21        |
| 統一       | 11,353,734,691 | 20,210,724,588  | 16.25                         | 78.01                        | 2  |              |
| 復華       | 10,890,868,617 | 19,554,752,074  | 18.09                         | 79.55                        | 1  |              |
| 匯豐       | 10,790,827,015 | 18,812,903,049  | 15.59                         | 74.34                        | 5  |              |
| 安聯       | 15,017,345,063 | 26,098,049,298  | 17.03                         | 75.63                        | 3  |              |
| 合計       | 62,889,258,047 | 110,334,684,805 | 16.68                         | 76.38                        | —  |              |

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          | 114 年截至 11 月<br>累積投資報酬<br>(%) | 委任迄今<br>(112.4.6~114.11.30) |    |              |
|----------|---------------|----------------|-------------------------------|-----------------------------|----|--------------|
|          |               |                |                               | 投資報酬率<br>(%)                | 排名 | 目標報酬率<br>(%) |
| 復華       | 4,799,121,512 | 8,198,540,559  | 24.97                         | 70.83                       | 1  | 16.17        |
| 安聯       | 3,601,238,896 | 5,705,877,377  | 20.39                         | 58.44                       | 2  |              |
| 合計       | 8,400,360,408 | 13,904,417,936 | 23.05                         | 65.52                       | —  |              |

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          | 114 年截至 11 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(112.2.7~114.11.30) |    |              |
|----------|----------------|----------------|---------------------------|-----------------------------|----|--------------|
|          |                |                |                           | 投資報酬率<br>(%)                | 排名 | 目標報酬率<br>(%) |
| 安聯       | 15,088,712,403 | 28,998,827,753 | 37.77                     | 95.98                       | 1  | 17.18        |
| 國泰       | 5,018,453,600  | 8,093,460,401  | 15.66                     | 48.83                       | 4  |              |
| 群益       | 6,382,621,945  | 9,548,276,417  | 14.86                     | 49.60                       | 2  |              |
| 匯豐       | 7,096,535,878  | 10,579,924,305 | 15.45                     | 49.09                       | 3  |              |
| 合計       | 33,586,323,826 | 57,220,488,876 | 25.51                     | 69.06                       | —  |              |

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           | 114 年截至 11 月<br>累積投資報酬<br>(%) | 委任迄今<br>(112.10.24~114.11.30) |    |              |
|----------|----------------|-----------------|-------------------------------|-------------------------------|----|--------------|
|          |                |                 |                               | 投資報酬率<br>(%)                  | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| 台新       | 8,254,694,051  | 15,558,301,815  | 23.75                         | 88.48                         | 4  | 87.08        |
| 安聯       | 12,775,472,416 | 24,045,465,996  | 24.87                         | 88.22                         | 6  |              |
| 玉山       | 9,403,481,285  | 18,117,465,861  | 26.86                         | 92.67                         | 2  |              |
| 統一       | 12,635,490,783 | 23,517,334,804  | 23.81                         | 86.12                         | 7  |              |
| 國泰       | 10,445,956,159 | 19,960,086,586  | 27.15                         | 91.08                         | 3  |              |
| 復華       | 7,235,716,436  | 13,623,605,616  | 25.28                         | 88.28                         | 5  |              |
| 群益       | 4,439,275,178  | 8,565,286,298   | 26.93                         | 92.94                         | 1  |              |
| 合計       | 65,190,086,308 | 123,387,546,976 | 25.36                         | 89.27                         | —  |              |

註：1.本批次為相對報酬型，以臺灣永續報酬指數為指定指標。

2.保德信投信於 114.10.1 正式更名為玉山投信。

## 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           | 114 年截至 11 月<br>累積投資報酬<br>(%) | 委任迄今<br>(113.5.24~114.11.30) |    |              |
|----------|----------------|-----------------|-------------------------------|------------------------------|----|--------------|
|          |                |                 |                               | 投資報酬率<br>(%)                 | 排名 | 目標報酬率<br>(%) |
| 安聯       | 13,613,817,760 | 19,842,878,612  | 37.43                         | 46.42                        | 3  | 9.05         |
| 施羅德      | 11,400,361,947 | 17,755,016,453  | 42.77                         | 55.74                        | 2  |              |
| 統一       | 13,638,402,860 | 18,636,927,658  | 27.70                         | 37.07                        | 5  |              |
| 野村       | 20,601,693,072 | 32,687,734,375  | 41.80                         | 59.53                        | 1  |              |
| 國泰       | 19,457,627,824 | 25,085,507,880  | 14.99                         | 28.92                        | 6  |              |
| 復華       | 9,724,896,734  | 13,439,524,505  | 25.17                         | 38.20                        | 4  |              |
| 合計       | 88,436,800,197 | 127,447,589,483 | 31.36                         | 44.66                        | —  |              |

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          | 114 年截至 11 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(110.5.13~114.11.30) |    |              |
|----------|----------------|----------------|---------------------------|------------------------------|----|--------------|
|          |                |                |                           | 投資報酬率<br>(%)                 | 排名 | 目標報酬率<br>(%) |
| 台新       | 8,000,000,000  | 12,749,898,501 | 12.26                     | 59.37                        | 4  | 25.83        |
| 安聯       | 8,000,000,000  | 13,871,254,640 | 24.99                     | 73.39                        | 2  |              |
| 玉山       | 8,000,000,000  | 12,528,738,499 | 21.62                     | 56.61                        | 5  |              |
| 國泰       | 8,000,000,000  | 13,569,595,537 | 9.55                      | 69.62                        | 3  |              |
| 野村       | 8,000,000,000  | 16,252,062,239 | 42.94                     | 103.15                       | 1  |              |
| 合計       | 40,000,000,000 | 68,971,549,416 | 22.04                     | 72.43                        | —  |              |

註：1.本批次為絕對報酬型，契約目標報酬率係以臺灣證交所公告之最近 5 年年底股票集中市場平均殖利率加計 200 個基本點為基準。  
 2.保德信投信於 114.10.1 正式更名為玉山投信。

## 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          | 114 年截至 11 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(111.5.13~114.11.30) |    |              |
|----------|----------------|----------------|---------------------------|------------------------------|----|--------------|
|          |                |                |                           | 投資報酬率<br>(%)                 | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| 安聯       | 3,000,000,000  | 4,930,963,436  | 2.30                      | 58.55                        | 5  | 68.10        |
| 玉山       | 3,000,000,000  | 5,044,369,131  | 2.68                      | 63.48                        | 3  |              |
| 野村       | 3,000,000,000  | 5,189,540,184  | 4.28                      | 64.50                        | 2  |              |
| 國泰       | 3,000,000,000  | 5,222,504,470  | 6.50                      | 67.15                        | 1  |              |
| 富邦       | 3,000,000,000  | 5,021,289,201  | 5.87                      | 59.61                        | 4  |              |
| 合計       | 15,000,000,000 | 25,408,666,422 | 4.32                      | 62.67                        | —  |              |

註：1.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。  
 2.保德信投信於 114.10.1 正式更名為玉山投信。

## 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          | 114 年截至 11 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今                  |              |              |
|----------|----------------|----------------|---------------------------|-----------------------|--------------|--------------|
|          |                |                |                           | (110.12.15~114.11.30) | 投資報酬率<br>(%) | 目標報酬率<br>(%) |
| 安聯       | 8,000,000,000  | 13,854,617,734 | 37.64                     | 78.34                 | 2            | 24.27        |
| 玉山       | 8,000,000,000  | 11,658,329,173 | 15.92                     | 48.60                 | 5            |              |
| 國泰       | 8,000,000,000  | 12,295,881,282 | 14.59                     | 61.29                 | 4            |              |
| 第一金      | 8,000,000,000  | 10,354,886,109 | 20.59                     | 29.18                 | 6            |              |
| 野村       | 8,000,000,000  | 14,720,977,113 | 43.88                     | 85.74                 | 1            |              |
| 富邦       | 8,000,000,000  | 13,751,765,875 | 32.35                     | 75.25                 | 3            |              |
| 合計       | 48,000,000,000 | 76,636,457,286 | 27.60                     | 63.08                 | —            |              |

註：1.本批次為絕對報酬型，契約目標報酬率係以臺灣證交所公告之最近 5 年年底股票集中市場平均殖利率加計 250 個基本點為基準。

2.保德信投信於 114.10.1 正式更名為玉山投信。

## 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          | 114 年截至 11 月<br>累積投資報酬<br>(%) | 委任迄今                 |                  |              |
|----------|----------------|----------------|-------------------------------|----------------------|------------------|--------------|
|          |                |                |                               | (112.10.5~114.11.30) | 投資<br>報酬率<br>(%) | 指標報酬率<br>(%) |
| 安聯       | 7,000,000,000  | 9,236,377,565  | 20.97                         | 50.61                | 4                | 12.99        |
| 施羅德      | 7,000,000,000  | 11,082,841,564 | 42.14                         | 82.46                | 1                |              |
| 國泰       | 7,000,000,000  | 9,633,987,088  | 21.76                         | 63.81                | 3                |              |
| 第一金      | 7,000,000,000  | 9,295,917,123  | 26.24                         | 30.94                | 6                |              |
| 野村       | 7,000,000,000  | 11,173,309,741 | 43.43                         | 80.21                | 2                |              |
| 華南<br>永昌 | 7,000,000,000  | 7,202,548,103  | -1.55                         | 10.65                | 7                |              |
| 匯豐       | 7,000,000,000  | 8,956,007,085  | 20.57                         | 42.27                | 5                |              |
| 合計       | 49,000,000,000 | 66,580,988,269 | 25.09                         | 51.37                | —                |              |

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

## 112 年第一次委託經營 (相對報酬)

單位：新臺幣元

| 投信<br>名稱 | 委託金額           | 目前淨資產          | 114 年截至 11 月<br>累積投資報酬<br>(%) | 委任迄今<br>(114. 4. 1~114. 11. 30) |    |              |
|----------|----------------|----------------|-------------------------------|---------------------------------|----|--------------|
|          |                |                |                               | 投資<br>報酬率(%)                    | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| 安聯       | 4,000,000,000  | 5,131,316,363  | 51.87                         | 51.87                           | 1  | 36.86        |
| 兆豐<br>國際 | 4,000,000,000  | 4,960,151,567  | 44.60                         | 44.60                           | 2  |              |
| 宏利       | 4,000,000,000  | 4,860,191,414  | 38.71                         | 38.71                           | 4  |              |
| 施羅德      | 4,000,000,000  | 4,843,339,348  | 37.80                         | 37.80                           | 6  |              |
| 野村       | 4,000,000,000  | 4,845,865,217  | 37.92                         | 37.92                           | 5  |              |
| 摩根       | 4,000,000,000  | 4,870,437,903  | 39.00                         | 39.00                           | 3  |              |
| 合計       | 24,000,000,000 | 29,511,301,812 | 41.65                         | 41.65                           | —  |              |

註：本批次為相對報酬型，以臺灣加權股價報酬指數為指定指標。

## 113 年第一次委託經營

單位：新臺幣元

| 投信<br>名稱 | 委託金額           | 目前淨資產          | 114 年截至 11 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(114. 11. 14~114. 11. 30) |    |              |
|----------|----------------|----------------|---------------------------|-----------------------------------|----|--------------|
|          |                |                |                           | 投資<br>報酬率(%)                      | 排名 | 目標報酬率<br>(%) |
| 安聯       | 4,500,000,000  | 4,567,934,419  | 0.99                      | 0.99                              | 2  | 0.29         |
| 貝萊德      | 4,500,000,000  | 4,551,294,042  | 0.15                      | 0.15                              | 4  |              |
| 施羅德      | 4,500,000,000  | 4,607,799,743  | 0.86                      | 0.86                              | 3  |              |
| 野村       | 4,500,000,000  | 4,640,122,235  | 2.44                      | 2.44                              | 1  |              |
| 摩根       | 4,500,000,000  | 4,566,049,460  | -0.74                     | -0.74                             | 5  |              |
| 合計       | 22,500,000,000 | 22,933,199,899 | 0.74                      | 0.74                              | —  |              |

註：本批次為絕對報酬型，契約目標報酬率係以臺灣證交所公告之最近 5 年年底股票集中市場平均殖利率加計 300 個基本點為基準。

## 2. 舊制勞工退休基金

### 國內 98 年第二次委託經營(續約 5)

單位：新臺幣元

| 投信<br>名稱 | 委託金額              | 目前淨資產             | 114 年截至 11 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今                                     |    |              |
|----------|-------------------|-------------------|---------------------------|--|----|--------------|
|          |                   |                   |                           | (114. 1. 28~114. 11. 30)<br>投資報酬率<br>(%) | 排名 | 目標報酬率<br>(%) |
| 富邦       | 15, 603, 507, 854 | 20, 683, 406, 750 | 32. 56                    | 32. 56                                   | 1  | 5. 32        |
| 統一       | 13, 492, 877, 440 | 17, 304, 729, 279 | 28. 25                    | 28. 25                                   | 2  |              |
| 合計       | 29, 096, 385, 294 | 37, 988, 136, 029 | 30. 56                    | 30. 56                                   | —  |              |

註：本批次為絕對報酬型，契約目標報酬率係以臺灣證交所公告之最近 5 年年底股票集中市場平均殖利率加計 300 個基本點為基準。

### 國內 101 年第一次委託經營(相對報酬)(續約 3) 單位：新臺幣元

| 投信<br>名稱 | 委託金額             | 目前淨資產            | 114 年截至 11 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今                                     |    |              |
|----------|------------------|------------------|---------------------------|--|----|--------------|
|          |                  |                  |                           | (113. 11. 2~114. 11. 30)<br>投資報酬率<br>(%) | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| 滙豐       | 6, 530, 798, 735 | 8, 333, 059, 325 | 24. 04                    | 27. 60                                   | —  | 24. 89       |

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             | 114 年截至 11 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今                                      |    |              |
|----------|-------------------|-------------------|---------------------------|---|----|--------------|
|          |                   |                   |                           | (113. 05. 04~114. 11. 30)<br>投資報酬率<br>(%) | 排名 | 目標報酬率<br>(%) |
| 野村       | 27, 357, 530, 009 | 45, 412, 595, 636 | 41. 26                    | 66. 00                                    | —  | 9. 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。

## 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          | 114 年截至 11 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今                    |              |       |
|----------|---------------|----------------|---------------------------|-------------------------|--------------|-------|
|          |               |                |                           | (112. 4. 6~114. 11. 30) | 投資報酬率<br>(%) | 排名    |
| 復華       | 4,800,107,976 | 8,200,230,378  | 24.97                     | 70.83                   | 1            |       |
| 安聯       | 3,601,947,821 | 5,706,969,178  | 20.39                     | 58.44                   | 2            |       |
| 合計       | 8,402,055,797 | 13,907,199,556 | 23.05                     | 65.52                   | —            | 16.17 |

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          | 114 年截至 11 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今                    |              |       |
|----------|----------------|----------------|---------------------------|-------------------------|--------------|-------|
|          |                |                |                           | (112. 2. 7~114. 11. 30) | 投資報酬率<br>(%) | 排名    |
| 安聯       | 15,089,937,312 | 29,002,076,052 | 37.76                     | 95.99                   | 1            |       |
| 國泰       | 5,019,107,110  | 8,094,914,386  | 15.66                     | 48.84                   | 4            |       |
| 群益       | 6,384,957,618  | 9,554,872,571  | 14.82                     | 49.65                   | 2            |       |
| 匯豐       | 7,097,524,598  | 10,581,798,310 | 15.45                     | 49.09                   | 3            |       |
| 合計       | 33,591,526,638 | 57,233,661,319 | 25.50                     | 69.07                   | —            | 17.18 |

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<br>名稱 | 委託金額          | 目前淨資產         | 114 年截至 11 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今                     |              |              |
|----------|---------------|---------------|---------------------------|--------------------------|--------------|--------------|
|          |               |               |                           | (111. 5. 13~114. 11. 30) | 投資報酬率<br>(%) | 指標報酬率<br>(%) |
| 安聯       | 1,000,000,000 | 1,643,926,570 | 2.30                      | 58.62                    | 5            |              |
| 玉山       | 1,000,000,000 | 1,681,666,416 | 2.69                      | 63.49                    | 3            |              |
| 野村       | 1,000,000,000 | 1,730,072,525 | 4.29                      | 64.52                    | 2            |              |
| 國泰       | 1,000,000,000 | 1,741,095,075 | 6.50                      | 67.21                    | 1            |              |
| 富邦       | 1,000,000,000 | 1,673,999,867 | 5.88                      | 59.73                    | 4            |              |
| 合計       | 5,000,000,000 | 8,470,760,453 | 4.33                      | 62.73                    | —            | 68.10        |

註：1. 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。

2. 保德信投信於 114.10.1 正式更名為玉山投信。

## 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          | 114 年截至 11 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今                 |              |              |
|----------|----------------|----------------|---------------------------|----------------------|--------------|--------------|
|          |                |                |                           | (112.10.5~114.11.30) | 投資報酬率<br>(%) | 目標報酬率<br>(%) |
| 安聯       | 3,000,000,000  | 3,901,919,289  | 22.32                     | 51.50                | 4            | 12.99        |
| 施羅德      | 3,000,000,000  | 4,663,645,497  | 42.75                     | 83.29                | 1            |              |
| 國泰       | 3,000,000,000  | 4,098,564,522  | 23.81                     | 66.68                | 3            |              |
| 第一金      | 3,000,000,000  | 4,071,532,792  | 26.88                     | 31.60                | 6            |              |
| 野村       | 3,000,000,000  | 4,699,839,323  | 42.83                     | 79.50                | 2            |              |
| 華南<br>永昌 | 3,000,000,000  | 3,132,079,321  | 0.85                      | 13.36                | 7            |              |
| 匯豐       | 3,000,000,000  | 3,791,258,659  | 21.43                     | 43.29                | 5            |              |
| 合計       | 21,000,000,000 | 28,358,839,403 | 26.13                     | 52.53                | —            |              |

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。

## (二) 114 年 11 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. 受託機構經營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<br>機構    | 委託金額             | 目前淨資產            | 114 年截至 11 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(110. 6. 7~114. 11. 30) |    |              |
|-------------|------------------|------------------|---------------------------|---------------------------------|----|--------------|
|             |                  |                  |                           | 投資報酬率<br>(%)                    | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| 聯博          | 987, 613, 021    | 905, 380, 760    | 8. 91                     | -9. 29                          | 2  | -9. 64       |
| 富蘭克林<br>坦伯頓 | 1, 351, 737, 838 | 1, 348, 746, 729 | 8. 86                     | -6. 23                          | 1  |              |
| 合計          | 2, 339, 350, 859 | 2, 254, 127, 489 | 8. 89                     | -7. 86                          | —  |              |

##### 97-2 全球增值債券型（續約 3）

單位：美元

| 受託<br>機構 | 委託金額             | 目前淨資產            | 114 年截至 11 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(111. 1. 6~114. 11. 30) |    |              |
|----------|------------------|------------------|---------------------------|---------------------------------|----|--------------|
|          |                  |                  |                           | 投資報酬率<br>(%)                    | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| PIMCO    | 2, 408, 967, 886 | 2, 411, 755, 709 | 9. 77                     | -3. 06                          | —  | -6. 24       |

##### 97-2 全球增值股票型（續約 3）

單位：美元

| 受託<br>機構 | 委託金額             | 目前淨資產            | 114 年截至 11 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(111. 2. 6~114. 11. 30) |    |              |
|----------|------------------|------------------|---------------------------|---------------------------------|----|--------------|
|          |                  |                  |                           | 投資報酬率<br>(%)                    | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| 貝萊德      | 1, 834, 805, 538 | 2, 866, 056, 318 | 23. 74                    | 58. 07                          | 1  | 48. 93       |
| JPMorgan | 1, 585, 120, 883 | 2, 360, 978, 520 | 20. 27                    | 50. 82                          | 2  |              |
| 合計       | 3, 419, 926, 421 | 5, 227, 034, 838 | 22. 15                    | 54. 72                          | —  |              |

98-1 亞太（日本除外）主動股票型（續約 3） 單位：美元

| 受託<br>機構 | 委託金額        | 目前淨資產         | 114 年截至 11 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今         |    |              |
|----------|-------------|---------------|---------------------------|--------------|----|--------------|
|          |             |               |                           | 投資報酬率<br>(%) | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| 景順       | 656,507,639 | 1,077,823,059 | 34.74                     | 64.18        | —  | 51.23        |

98-1 全球被動股票型（續約 3）

單位：美元

| 受託<br>機構 | 委託金額          | 目前淨資產         | 114 年截至 11 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今         |    |              |
|----------|---------------|---------------|---------------------------|--------------|----|--------------|
|          |               |               |                           | 投資報酬率<br>(%) | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| 貝萊德      | 1,241,092,316 | 2,000,621,332 | 21.26                     | 66.89        | 2  | 66.27        |
| 道富       | 1,663,655,177 | 2,693,488,446 | 21.34                     | 68.22        | 1  |              |
| 合計       | 2,904,747,493 | 4,694,109,778 | 21.31                     | 67.65        | —  |              |

100-1 全球基本面指數被動股票型（續約 2）

單位：美元

| 受託<br>機構 | 委託金額          | 目前淨資產         | 114 年截至 11 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今         |    |              |
|----------|---------------|---------------|---------------------------|--------------|----|--------------|
|          |               |               |                           | 投資報酬率<br>(%) | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| 道富       | 934,565,605   | 1,461,821,414 | 25.13                     | 56.42        | 1  | 53.21        |
| 貝萊德      | 939,726,931   | 1,465,913,133 | 25.52                     | 55.99        | 2  |              |
| 合計       | 1,874,292,536 | 2,927,734,547 | 25.32                     | 56.20        | —  |              |

100-1 全球不動產有價證券型（續約 2）

單位：美元

| 受託<br>機構       | 委託金額          | 目前淨資產         | 114 年截至 11 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今         |    |              |
|----------------|---------------|---------------|---------------------------|--------------|----|--------------|
|                |               |               |                           | 投資報酬率<br>(%) | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| Cohen & Steers | 2,555,932,432 | 2,678,906,674 | 12.90                     | 2.96         | 1  | -0.71        |
| 景順             | 1,567,127,452 | 1,531,801,630 | 10.05                     | -3.06        | 2  |              |
| 合計             | 4,123,059,884 | 4,210,708,304 | 11.85                     | 0.68         | —  |              |

### 101-1 全球新興市場主動債券型（續約 2）

單位：美元

| 受託<br>機構 | 委託金額        | 目前淨資產       | 114 年截至 11 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今         |    |              |
|----------|-------------|-------------|---------------------------|--------------|----|--------------|
|          |             |             |                           | 投資報酬率<br>(%) | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| Pictet   | 618,843,493 | 775,908,179 | 12.49                     | 25.96        | —  | 27.29        |

### 101-1 全球低波動指數被動股票型（續約 2）

單位：美元

| 受託<br>機構 | 委託金額          | 目前淨資產         | 114 年截至 11 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今         |    |              |
|----------|---------------|---------------|---------------------------|--------------|----|--------------|
|          |               |               |                           | 投資報酬率<br>(%) | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| 道富       | 1,163,392,347 | 1,490,218,391 | 12.37                     | 28.48        | 2  | 27.54        |
| 貝萊德      | 1,252,011,599 | 1,600,414,802 | 12.40                     | 28.72        | 1  |              |
| 合計       | 2,415,403,946 | 3,090,633,193 | 12.39                     | 28.60        | —  |              |

### 102-1 全球高股利增值股票型（續約 2）

單位：美元

| 受託<br>機構 | 委託金額          | 目前淨資產         | 114 年截至 11 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今         |    |              |
|----------|---------------|---------------|---------------------------|--------------|----|--------------|
|          |               |               |                           | 投資報酬率<br>(%) | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| 瑞萬通博     | 1,796,000,834 | 2,081,100,866 | 6.41                      | 16.49        | 3  | 29.09        |
| MFS      | 1,164,480,846 | 1,493,609,187 | 18.75                     | 28.86        | 2  |              |
| 威靈頓      | 1,507,914,919 | 1,970,064,751 | 21.26                     | 31.39        | 1  |              |
| 合計       | 4,468,396,599 | 5,544,774,804 | 14.60                     | 24.74        | —  |              |

## 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            | 114 年截至 11 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(113. 4. 25~114. 11. 30) |    |              |
|------|------------------|------------------|---------------------------|----------------------------------|----|--------------|
|      |                  |                  |                           | 投資報酬率<br>(%)                     | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| RBC  | 1, 186, 559, 371 | 1, 364, 309, 435 | 10. 07                    | 15. 60                           | 1  | 14. 48       |
| 貝萊德  | 670, 392, 768    | 766, 412, 666    | 9. 80                     | 14. 32                           | 2  |              |
| 盧米斯  | 941, 561, 542    | 1, 072, 931, 187 | 10. 00                    | 14. 30                           | 3  |              |
| 合計   | 2, 798, 513, 681 | 3, 203, 653, 288 | 9. 98                     | 14. 84                           | —  |              |

## 104-1 全球高品質被動股票型 (續約 2)

單位：美元

| 受託機構  | 委託金額             | 目前淨資產             | 114 年截至 11 月<br>累積投資報酬<br>(%) | 委任迄今<br>(114. 8. 11~114. 11. 30) |    |              |
|-------|------------------|-------------------|-------------------------------|----------------------------------|----|--------------|
|       |                  |                   |                               | 投資報酬率<br>(%)                     | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| 北美信託  | 3, 222, 313, 413 | 3, 512, 182, 817  | 9. 05                         | 9. 05                            | 1  | 8. 92        |
| LGIM  | 3, 208, 355, 339 | 3, 494, 989, 829  | 8. 99                         | 8. 99                            | 3  |              |
| Geode | 3, 189, 006, 741 | 3, 475, 553, 266  | 9. 04                         | 9. 04                            | 2  |              |
| 合計    | 9, 619, 675, 493 | 10, 482, 725, 912 | 9. 02                         | 9. 02                            | —  |              |

## 104-2 全球基礎建設有價證券型 (續約 2)

單位：美元

| 受託機構     | 委託金額             | 目前淨資產            | 114 年截至 11 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(114. 9. 25~114. 11. 30) |    |              |
|----------|------------------|------------------|---------------------------|----------------------------------|----|--------------|
|          |                  |                  |                           | 投資報酬率<br>(%)                     | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| Magellan | 1, 159, 305, 130 | 1, 216, 395, 914 | 4. 92                     | 4. 92                            | 1  | 2. 26        |
| RREEF    | 1, 668, 471, 152 | 1, 706, 442, 268 | 2. 28                     | 2. 28                            | 2  |              |
| 合計       | 2, 827, 776, 282 | 2, 922, 838, 182 | 3. 36                     | 3. 36                            | —  |              |

### 104-1 全球主權信用增值債券型（續約）

單位：美元

| 受託<br>機構 | 委託金額          | 目前淨資產         | 114 年截至 11 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(114. 11. 13~114. 11. 30) |    |              |
|----------|---------------|---------------|---------------------------|-----------------------------------|----|--------------|
|          |               |               |                           | 投資報<br>酬率<br>(%)                  | 排名 | 指標報<br>酬率(%) |
| 盧米斯      | 819, 799, 803 | 819, 274, 309 | -0. 06                    | -0. 06                            | —  | -0. 001      |

### 105-1 全球多元資產型（續約）

單位：美元

| 受託<br>機構 | 委託金額             | 目前淨資產            | 114 年截至 11 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(110. 7. 20~114. 11. 30) |    |                   |
|----------|------------------|------------------|---------------------------|----------------------------------|----|-------------------|
|          |                  |                  |                           | 投資報酬率<br>(%)                     | 排名 | 指標/目標<br>報酬率(%)   |
| Allianz  | 678, 698, 278    | 965, 243, 465    | 34. 67                    | 40. 44                           | 1  | 16. 68/38. 5<br>3 |
| JPMorgan | 1, 645, 715, 430 | 1, 958, 375, 173 | 11. 45                    | 19. 00                           | 3  |                   |
| DWS      | 1, 025, 711, 371 | 1, 298, 964, 970 | 18. 52                    | 26. 60                           | 2  |                   |
| 柏瑞       | 465, 326, 657    | 538, 602, 188    | 12. 34                    | 9. 37                            | 4  |                   |
| 合計       | 3, 815, 451, 736 | 4, 761, 185, 796 | 17. 33                    | 22. 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。

### 105-1 亞太混合指數增值股票型（續約）

單位：美元

| 受託<br>機構 | 委託金額          | 目前淨資產            | 114 年截至 11 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(110. 8. 24~114. 11. 30) |    |              |
|----------|---------------|------------------|---------------------------|----------------------------------|----|--------------|
|          |               |                  |                           | 投資報酬率<br>(%)                     | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| 貝萊德      | 949, 175, 052 | 1, 272, 802, 407 | 23. 90                    | 34. 10                           | —  | 29. 54       |

## 106-1 全球 ESG 混合指數被動股票型(續約)

單位：美元

| 受託<br>機構 | 委託金額             | 目前淨資產            | 114 年截至 11 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(111. 6. 22~114. 11. 30) |    |              |
|----------|------------------|------------------|---------------------------|----------------------------------|----|--------------|
|          |                  |                  |                           | 投資報酬率<br>(%)                     | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| 貝萊德      | 601, 552, 002    | 944, 394, 241    | 20. 81                    | 59. 64                           | 4  | 59. 22       |
| DWS      | 748, 715, 051    | 1, 170, 802, 629 | 20. 70                    | 63. 15                           | 1  |              |
| 道富       | 749, 045, 562    | 1, 187, 096, 994 | 20. 60                    | 63. 05                           | 2  |              |
| 北美信託     | 702, 047, 560    | 1, 115, 712, 781 | 21. 18                    | 61. 26                           | 3  |              |
| 合計       | 2, 801, 360, 175 | 4, 418, 006, 645 | 20. 82                    | 61. 85                           | —  |              |

## 106-1 絶對報酬債券型(續約)

單位：美元

| 受託<br>機構            | 委託金額             | 目前淨資產            | 114 年截至 11 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(111. 7. 25~114. 11. 30) |    |                 |
|---------------------|------------------|------------------|---------------------------|----------------------------------|----|-----------------|
|                     |                  |                  |                           | 投資報酬<br>率(%)                     | 排名 | 指標/目標<br>報酬率(%) |
| American<br>Century | 427, 360, 620    | 510, 961, 403    | 6. 76                     | 19. 56                           | 3  | 16. 14/24. 53   |
| 富達                  | 905, 211, 657    | 1, 143, 059, 823 | 5. 51                     | 24. 96                           | 1  |                 |
| TCW                 | 1, 039, 618, 153 | 1, 263, 518, 845 | 7. 60                     | 21. 52                           | 2  |                 |
| 合計                  | 2, 372, 190, 430 | 2, 917, 540, 071 | 6. 62                     | 22. 62                           | —  |                 |

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 絶對報酬股票型 (續約)

單位：美元

| 受託<br>機構 | 委託金額          | 目前淨資產         | 114 年截至 11 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(113.1.23~114.11.30) |    |                 |
|----------|---------------|---------------|---------------------------|------------------------------|----|-----------------|
|          |               |               |                           | 投資報酬率<br>(%)                 | 排名 | 指標/目標<br>報酬率(%) |
| 景順       | 906,698,949   | 1,215,094,234 | 17.69                     | 37.03                        | 1  | 8.61/17.90      |
| 威靈頓      | 787,219,463   | 1,006,451,494 | 14.54                     | 27.85                        | 4  |                 |
| CPR      | 858,885,217   | 1,087,962,916 | 13.69                     | 28.44                        | 3  |                 |
| 道富       | 706,462,703   | 958,541,198   | 21.30                     | 35.68                        | 2  |                 |
| 合計       | 3,259,266,332 | 4,268,049,842 | 16.67                     | 32.15                        | —  |                 |

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

## 108-1 全球新興市場動態多元因子指數增值股票型 (續約)

單位：美元

| 受託<br>機構 | 委託金額          | 目前淨資產         | 114 年截至 11 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(113.12.18~114.11.30) |    |              |
|----------|---------------|---------------|---------------------------|-------------------------------|----|--------------|
|          |               |               |                           | 投資報<br>酬率(%)                  | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| Nomura   | 559,865,985   | 698,018,740   | 26.83                     | 25.29                         | 2  | 27.43        |
| 荷寶       | 506,416,368   | 624,548,835   | 25.20                     | 24.33                         | 3  |              |
| 道富       | 441,937,598   | 554,559,726   | 26.94                     | 25.48                         | 1  |              |
| 合計       | 1,508,219,951 | 1,877,127,301 | 26.33                     | 25.03                         | —  |              |

## 109-1 全球美元公司增值債券型

單位：美元

| 受託<br>機構 | 委託金額             | 目前淨資產            | 114 年截至 11 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(110. 1. 13~114. 11. 30) |    |              |
|----------|------------------|------------------|---------------------------|----------------------------------|----|--------------|
|          |                  |                  |                           | 投資報酬率<br>(%)                     | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| DWS      | 600, 000, 000    | 646, 156, 726    | 7. 65                     | 1. 17                            | 5  | 2. 47        |
| Insight  | 700, 000, 000    | 779, 582, 661    | 8. 10                     | 3. 68                            | 1  |              |
| JPMorgan | 400, 000, 000    | 419, 277, 278    | 8. 30                     | 2. 77                            | 3  |              |
| PIMCO    | 480, 000, 000    | 515, 202, 739    | 8. 65                     | 3. 01                            | 2  |              |
| Western  | 400, 000, 000    | 413, 037, 740    | 8. 53                     | 1. 61                            | 4  |              |
| 合計       | 2, 580, 000, 000 | 2, 773, 257, 144 | 8. 19                     | 2. 38                            | —  |              |

## 110-1 全球基礎建設有價證券型

單位：美元

| 受託<br>機構    | 委託金額             | 目前淨資產            | 114 年截至 11 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(110. 9. 8~114. 11. 30) |    |              |
|-------------|------------------|------------------|---------------------------|---------------------------------|----|--------------|
|             |                  |                  |                           | 投資報酬率<br>(%)                    | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| CBRE        | 430, 000, 000    | 536, 018, 506    | 17. 70                    | 28. 44                          | 3  | 27. 95       |
| Clearbridge | 550, 000, 000    | 722, 735, 767    | 28. 33                    | 37. 17                          | 1  |              |
| Magellan    | 350, 000, 000    | 456, 910, 087    | 25. 26                    | 28. 58                          | 2  |              |
| RREEF       | 430, 000, 000    | 532, 768, 599    | 16. 14                    | 27. 30                          | 4  |              |
| 合計          | 1, 760, 000, 000 | 2, 248, 432, 959 | 22. 10                    | 30. 53                          | —  |              |

## 110-1 全球多元資產型

單位：美元

| 受託<br>機構         | 委託金額          | 目前淨資產         | 114 年截至 11 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(110.10.15~114.11.30) |    |                 |
|------------------|---------------|---------------|---------------------------|-------------------------------|----|-----------------|
|                  |               |               |                           | 投資報酬率<br>(%)                  | 排名 | 指標/目標<br>報酬率(%) |
| 富達               | 400,000,000   | 455,510,162   | 13.52                     | 13.41                         | 5  | 16.67/37.33     |
| JPMorgan         | 400,000,000   | 468,378,277   | 11.46                     | 16.88                         | 3  |                 |
| Ninety One       | 400,000,000   | 477,156,835   | 13.25                     | 18.66                         | 2  |                 |
| Schroders        | 400,000,000   | 496,249,828   | 14.69                     | 23.55                         | 1  |                 |
| T. Rowe<br>Price | 400,000,000   | 469,381,329   | 9.68                      | 15.96                         | 4  |                 |
| 合計               | 2,000,000,000 | 2,366,676,431 | 12.51                     | 17.70                         | —  |                 |

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<br>機構  | 委託金額          | 目前淨資產         | 114 年截至 11 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(112.4.28~114.11.30) |    |              |
|-----------|---------------|---------------|---------------------------|------------------------------|----|--------------|
|           |               |               |                           | 投資報酬率<br>(%)                 | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| 滙豐        | 400,000,000   | 546,138,842   | 19.54                     | 60.88                        | 2  | 58.20        |
| LGIM      | 400,000,000   | 543,449,373   | 19.75                     | 58.29                        | 3  |              |
| 摩根士<br>丹利 | 400,000,000   | 548,128,251   | 20.64                     | 58.01                        | 4  |              |
| Schroders | 400,000,000   | 534,270,532   | 16.24                     | 56.50                        | 5  |              |
| 威靈頓       | 400,000,000   | 556,587,576   | 20.59                     | 64.29                        | 1  |              |
| 合計        | 2,000,000,000 | 2,728,574,574 | 19.35                     | 59.60                        | —  |              |

## 111-2 絶對報酬債券型

單位：美元

| 受託<br>機構         | 委託金額          | 目前淨資產         | 114 年截至 11 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(112. 7. 19~114. 11. 30) |    |             |
|------------------|---------------|---------------|---------------------------|----------------------------------|----|-------------|
|                  |               |               |                           | 投資報酬率<br>(%)                     | 排名 |             |
| 盧米斯              | 600,000,000   | 679,245,629   | 7.01                      | 19.48                            | 1  | 11.54/17.48 |
| Ninety<br>One    | 500,000,000   | 575,510,913   | 6.34                      | 17.64                            | 3  |             |
| PIMCO            | 500,000,000   | 582,526,098   | 8.22                      | 18.71                            | 2  |             |
| PGIM             | 600,000,000   | 667,022,475   | 5.13                      | 17.51                            | 4  |             |
| T. Rowe<br>Price | 500,000,000   | 542,407,858   | 5.04                      | 9.49                             | 6  |             |
| 威靈頓              | 500,000,000   | 550,260,400   | 4.21                      | 12.71                            | 5  |             |
| 合計               | 3,200,000,000 | 3,596,973,373 | 6.01                      | 15.95                            | —  |             |

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<br>機構 | 委託金額          | 目前淨資產         | 114 年截至 11 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(113. 6. 27~114. 11. 30) |    |              |
|----------|---------------|---------------|---------------------------|----------------------------------|----|--------------|
|          |               |               |                           | 投資報<br>酬率(%)                     | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| Amundi   | 400,000,000   | 473,106,667   | 17.23                     | 23.38                            | 4  | 27.57        |
| LGIM     | 400,000,000   | 483,420,177   | 20.82                     | 27.30                            | 3  |              |
| 道富       | 400,000,000   | 484,759,265   | 21.31                     | 27.87                            | 1  |              |
| 北美信託     | 400,000,000   | 484,651,918   | 21.21                     | 27.65                            | 2  |              |
| 合計       | 1,600,000,000 | 1,925,938,027 | 20.14                     | 26.55                            | —  |              |

### 113-1 全球永續不動產有價證券型

單位：美元

| 受託<br>機構         | 委託金額          | 目前淨資產         | 114 年截至 11 月<br>累積投資報酬<br>(%) | 委任迄今<br>(114. 6. 18~114. 11. 30) |    |              |
|------------------|---------------|---------------|-------------------------------|----------------------------------|----|--------------|
|                  |               |               |                               | 投資報<br>酬率(%)                     | 排名 | 指標報<br>酬率(%) |
| 貝萊德              | 300,000,000   | 306,027,628   | 3.63                          | 3.63                             | 1  | 3.96         |
| Center<br>Square | 300,000,000   | 305,184,595   | 3.28                          | 3.28                             | 3  |              |
| 富達               | 300,000,000   | 305,481,069   | 3.30                          | 3.30                             | 2  |              |
| RREEF            | 300,000,000   | 305,080,301   | 3.22                          | 3.22                             | 4  |              |
| 合計               | 1,200,000,000 | 1,221,773,593 | 3.36                          | 3.36                             | —  |              |

### 114-1 全球氣候轉型被動股票型

單位：美元

| 受託<br>機構 | 委託金額        | 目前淨資產       | 114 年截至 11 月<br>累積投資報酬<br>(%) | 委任迄今<br>(114. 11. 25~114. 11. 30) |    |              |
|----------|-------------|-------------|-------------------------------|-----------------------------------|----|--------------|
|          |             |             |                               | 投資報<br>酬率(%)                      | 排名 | 指標報<br>酬率(%) |
| 貝萊德      | 100,000,000 | 102,412,707 | 2.41                          | 2.41                              | 2  | 2.44         |
| HSBC     | 100,000,000 | 102,216,313 | 2.22                          | 2.22                              | 4  |              |
| 道富       | 100,000,000 | 102,501,098 | 2.50                          | 2.50                              | 1  |              |
| UBS      | 100,000,000 | 102,407,863 | 2.41                          | 2.41                              | 3  |              |
| 合計       | 400,000,000 | 409,537,981 | 2.38                          | 2.38                              | —  |              |

## 2. 舊制勞工退休基金

### 96 國際平衡型(續約 4)

單位：美元

| 受託<br>機構 | 委託金額        | 目前淨資產       | 114 年截至 11 月<br>累積投資報酬率(%) | 委任迄今         |    |              |
|----------|-------------|-------------|----------------------------|--------------|----|--------------|
|          |             |             |                            | 投資報酬率<br>(%) | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| 富達       | 753,144,454 | 911,416,956 | 14.90                      | 21.01        | —  | 19.07        |

### 97-1 全球增值債券型(續約 3)

單位：美元

| 受託<br>機構 | 委託金額          | 目前淨資產         | 114 年截至 11 月<br>累積投資報酬率(%) | 委任迄今         |    |              |
|----------|---------------|---------------|----------------------------|--------------|----|--------------|
|          |               |               |                            | 投資報酬率<br>(%) | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| PIMCO    | 1,003,724,736 | 974,406,211   | 10.01                      | -2.92        | 1  | -6.24        |
| 盧米斯      | 1,018,693,762 | 964,097,341   | 8.31                       | -6.57        | 2  |              |
| 合計       | 2,022,418,498 | 1,938,503,552 | 9.16                       | -4.72        | —  |              |

### 97-1 全球增值股票型(續約 3)

單位：美元

| 受託<br>機構 | 委託金額          | 目前淨資產         | 114 年截至 11 月<br>累積投資報酬率(%) | 委任迄今         |    |              |
|----------|---------------|---------------|----------------------------|--------------|----|--------------|
|          |               |               |                            | 投資報酬率<br>(%) | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| 貝萊德      | 1,256,987,544 | 1,957,754,053 | 23.64                      | 57.90        | —  | 48.93        |

### 98-1 亞太(日本除外)主動股票型(續約 3)

單位：美元

| 受託<br>機構 | 委託金額        | 目前淨資產       | 114 年截至 11 月<br>累積投資報酬率(%) | 委任迄今         |    |                  |
|----------|-------------|-------------|----------------------------|--------------|----|------------------|
|          |             |             |                            | 投資報酬率<br>(%) | 排名 | 指標報<br>酬率<br>(%) |
| 景順       | 181,124,998 | 321,347,276 | 34.48                      | 63.18        | —  | 51.23            |

## 100-1 全球基本面指數被動股票型(續約 2)

單位：美元

| 受託<br>機構 | 委託金額          | 目前淨資產         | 114 年截至 11 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(111.3.6~114.11.30) |    |              |
|----------|---------------|---------------|---------------------------|-----------------------------|----|--------------|
|          |               |               |                           | 投資報酬率<br>(%)                | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| 貝萊德      | 304,997,166   | 479,456,211   | 24.99                     | 57.20                       | 3  | 55.10        |
| 道富       | 360,436,214   | 569,914,903   | 25.14                     | 58.12                       | 1  |              |
| 瑞銀       | 308,879,836   | 487,387,150   | 25.14                     | 57.79                       | 2  |              |
| Nomura   | 360,147,608   | 565,782,534   | 25.04                     | 57.10                       | 4  |              |
| 合計       | 1,334,460,824 | 2,102,540,798 | 25.08                     | 57.56                       | —  |              |

## 101-1 全球低波動指數被動股票型(續約 2)

單位：美元

| 受託<br>機構 | 委託金額        | 目前淨資產       | 114 年截至 11 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(112.4.18~114.11.30) |    |              |
|----------|-------------|-------------|---------------------------|------------------------------|----|--------------|
|          |             |             |                           | 投資報酬率<br>(%)                 | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| 貝萊德      | 751,993,706 | 968,416,685 | 12.40                     | 28.78                        | —  | 27.54        |

## 102-1 年全球高股利增值股票型(續約 2)

單位：美元

| 受託<br>機構 | 委託金額          | 目前淨資產         | 114 年截至 11 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(113.1.22~114.11.30) |    |              |
|----------|---------------|---------------|---------------------------|------------------------------|----|--------------|
|          |               |               |                           | 投資報酬率<br>(%)                 | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| 瑞萬通博     | 414,056,068   | 482,061,431   | 6.36                      | 16.42                        | 3  | 29.09        |
| MFS      | 315,296,707   | 406,062,799   | 18.81                     | 28.79                        | 2  |              |
| 威靈頓      | 704,502,354   | 925,635,659   | 21.26                     | 31.39                        | 1  |              |
| 合計       | 1,433,855,129 | 1,813,759,889 | 16.39                     | 26.50                        | —  |              |

## 102-2 全球基礎建設有價證券型(續約 2)

單位：美元

| 受託<br>機構 | 委託金額          | 目前淨資產            | 114 年截至 11 月<br>累積投資報酬<br>(%) | 委任迄今         |    |              |
|----------|---------------|------------------|-------------------------------|--------------|----|--------------|
|          |               |                  |                               | 投資報酬率<br>(%) | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| Lazard   | 954, 418, 976 | 1, 314, 451, 237 | 34. 47                        | 37. 72       | —  | 27. 31       |

## 102-2 全球不動產有價證券型 (續約 2)

單位：美元

| 受託<br>機構  | 委託金額          | 目前淨資產         | 114 年截至 11 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今         |    |              |
|-----------|---------------|---------------|---------------------------|--------------|----|--------------|
|           |               |               |                           | 投資報酬率<br>(%) | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| 信安<br>環球  | 708, 888, 643 | 724, 684, 133 | 9. 64                     | 2. 23        | 2  | 3. 58        |
| Macquarie | 144, 937, 350 | 154, 909, 009 | 12. 68                    | 6. 88        | 1  |              |
| 合計        | 853, 825, 993 | 879, 593, 142 | 10. 17                    | 3. 02        | —  |              |

## 105-1 全球多元資產型 (續約)

單位：美元

| 受託<br>機構 | 委託金額             | 目前淨資產            | 114 年截至 11 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今         |    |                 |
|----------|------------------|------------------|---------------------------|--------------|----|-----------------|
|          |                  |                  |                           | 投資報酬率<br>(%) | 排名 | 指標/目標<br>報酬率(%) |
| Allianz  | 155, 447, 975    | 218, 444, 897    | 34. 60                    | 40. 53       | 1  | 16. 68/38. 53   |
| 摩根       | 594, 592, 070    | 711, 332, 433    | 11. 51                    | 19. 63       | 3  |                 |
| DWS      | 311, 387, 682    | 394, 372, 140    | 18. 52                    | 26. 65       | 2  |                 |
| 柏瑞       | 174, 823, 294    | 198, 984, 804    | 12. 35                    | 9. 32        | 4  |                 |
| 合計       | 1, 236, 251, 021 | 1, 523, 134, 274 | 16. 12                    | 21. 82       | —  |                 |

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<br>機構 | 委託金額          | 目前淨資產         | 114 年截至 11 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(111. 6. 22~114. 11. 30) |    |              |
|----------|---------------|---------------|---------------------------|----------------------------------|----|--------------|
|          |               |               |                           | 投資報酬率<br>(%)                     | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| 貝萊德      | 127, 303, 524 | 202, 735, 814 | 20. 90                    | 59. 25                           | 4  |              |
| DWS      | 147, 528, 441 | 240, 536, 362 | 20. 76                    | 63. 04                           | 1  |              |
| 道富       | 157, 982, 595 | 257, 354, 965 | 20. 63                    | 62. 90                           | 2  | 59. 22       |
| 北美信託     | 158, 484, 700 | 255, 276, 737 | 21. 19                    | 61. 07                           | 3  |              |
| 合計       | 591, 299, 260 | 955, 903, 878 | 20. 87                    | 61. 66                           | —  |              |

## 106-1 絶對報酬債券型（續約）

單位：美元

| 受託<br>機構            | 委託金額          | 目前淨資產            | 114 年截至 11 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(111. 7. 25~114. 11. 30) |    |                 |
|---------------------|---------------|------------------|---------------------------|----------------------------------|----|-----------------|
|                     |               |                  |                           | 投資報酬率<br>(%)                     | 排名 | 指標/目標<br>報酬率(%) |
| American<br>Century | 319, 635, 794 | 382, 036, 259    | 6. 74                     | 19. 52                           | 3  |                 |
| 富達                  | 279, 785, 344 | 355, 074, 027    | 5. 50                     | 25. 45                           | 1  | 16. 14/24. 53   |
| TCW                 | 328, 000, 470 | 401, 116, 506    | 7. 85                     | 22. 29                           | 2  |                 |
| 合計                  | 927, 421, 608 | 1, 138, 226, 792 | 6. 73                     | 22. 38                           | —  |                 |

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 絶對報酬股票型（續約）

單位：美元

| 受託<br>機構 | 委託金額          | 目前淨資產         | 114 年截至 11 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(113. 1. 23~114. 11. 30) |    |                 |
|----------|---------------|---------------|---------------------------|----------------------------------|----|-----------------|
|          |               |               |                           | 投資報酬率<br>(%)                     | 排名 | 指標/目標<br>報酬率(%) |
| 景順       | 116, 977, 839 | 160, 207, 026 | 17. 61                    | 36. 96                           | 1  |                 |
| 威靈頓      | 107, 476, 614 | 137, 396, 672 | 14. 51                    | 27. 84                           | 3  |                 |
| CPR      | 115, 110, 097 | 147, 825, 912 | 13. 65                    | 28. 42                           | 2  |                 |
| 合計       | 339, 564, 550 | 445, 429, 610 | 15. 31                    | 31. 18                           | —  |                 |

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<br>機構    | 委託金額          | 目前淨資產         | 114 年截至 11 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(110. 9. 8~114. 11. 30) |    |              |
|-------------|---------------|---------------|---------------------------|---------------------------------|----|--------------|
|             |               |               |                           | 投資報酬率<br>(%)                    | 排名 | 指標報酬率<br>(%) |
| CBRE        | 60, 000, 000  | 76, 340, 436  | 17. 69                    | 28. 74                          | 3  | 27. 95       |
| ClearBridge | 60, 000, 000  | 81, 178, 972  | 28. 51                    | 38. 84                          | 1  |              |
| Magellan    | 60, 000, 000  | 69, 256, 179  | 25. 45                    | 29. 47                          | 2  |              |
| RREEF       | 60, 000, 000  | 75, 944, 720  | 16. 15                    | 28. 10                          | 4  |              |
| 合計          | 240, 000, 000 | 302, 720, 307 | 21. 35                    | 30. 86                          | —  |              |

### (二)114 年 11 月被提前收回之國外委外投資帳戶

新制勞工退休基金：無

舊制勞工退休基金：無

## 六、基金投資衍生性金融商品概況表

### (一)新制勞工退休基金自營部位

(依交易目的)

114年11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)

114年11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

|          | 餘紳             | 收入              | 支出             |
|----------|----------------|-----------------|----------------|
| 114年11月份 | 92,368,317,796 | 124,084,231,144 | 31,715,913,348 |

### (二)舊制勞工退休基金

單位：新臺幣元

|          | 餘紳             | 收入            | 支出              |
|----------|----------------|---------------|-----------------|
| 114年11月份 | 13,726,211,496 | 3,433,649,841 | -10,292,561,655 |

## 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

114年11月份

單位：新臺幣元

| 項 目     | 金 領             |
|---------|-----------------|
| 現金收入    | 222,320,216,505 |
| 現金支出    | 220,658,432,186 |
| 現金增(減)數 | 1,661,784,319   |

### (二)舊制勞工退休基金

114年11月份

單位：新臺幣元

| 項 目     | 金 領            |
|---------|----------------|
| 現金收入    | 25,366,511,962 |
| 現金支出    | 25,366,230,814 |
| 現金增(減)數 | 281,148        |