

勞工退休基金運用情形報告（101年截至10月底止）

綜觀10月全球各國經濟指標仍顯疲弱，其中美國10月製造業指數較上月微幅上升0.2至51.7，另非製造業指數則下降0.9至54.2，反映服務業活動增長放緩，失業率則是略為上升0.1至7.9%，仍屬近3年多來之低點。而歐元區則持續萎縮，製造業指數雖較上月下降0.7至45.4，已持續15個月處於萎縮階段，服務業指數則持續下降0.4至45.7，且過去帶動歐元區經濟發展之德國，萎縮速度有加快跡象，近期公布的9月失業率則持續攀升至11.6%高水位；另中國10月製造業指數則重返景氣榮枯界值之上至50.2，非製造業指數亦彈升至55.5，緩和對景氣的疑慮。

10月金融市場受到美國大型企業財報不如預期、西班牙央行警告第3季經濟萎縮情況嚴重及美國財政懸崖疑慮升高而震盪小幅下跌，而台股更在市場信心不足及證所稅即將課徵、健保補充保費確定開徵影響下而擴大跌幅。10月單月MSCI世界、新興市場及台股指數表現分別為-0.66%、-0.70%及-7.12%。累計今年表現則分別上漲12.13%、11.68%及1.33%。

觀諸勞工退休基金截至101年10月底止，整體新、舊制基金規模為1兆4,357億629萬元，其中舊制基金規模為5,765億6,084萬元，新制基金規模為8,591億4,545萬元。101年截至10月底止整體基金評價後收益數為406億8,486萬元，收益率為3%，新、舊制基金均優於法定最低保證收益率。

美國總統歐巴馬成功連任，市場雖預期可維持寬鬆貨幣政策，然高失業率、財政懸崖及國會僵局等問題亦將持續挑戰未來經濟復甦。另歐盟執委會於11月7日下修歐元區今年及明年經濟成長預測，由5月預估的-0.3%及1%，分別下修至-0.1%及0.1%，並表示歐洲經濟仍在經歷金融危機後的痛苦修正，較弱國家的困境已開始影響其他成員國，明年歐洲失業率將再攀升。另日本公布第3季國內生產毛額(GDP)比去年同期銳減3.5%，為311大地震以來最大跌幅。而國內部分，近期主計處及台經院亦分別將經濟成長率預估值下修至1.05%及1.16%。依各項情勢顯示，未來全球景氣復甦之路仍困難重重。

勞退基金未來仍將密切掌握金融情勢，秉持長期投資策略，在既定之資產配置下，以多元布局分散投資風險，並加強委外績效及風險之監管，以維護基金收益之穩定性。

勞退基金101年截至10月底止運用情形分述如次：

一、舊制勞工退休基金規模與運用情形

(一)、基金規模與收益

單位：新台幣萬元；%

| 至 101 年 10 月底止基金規模與收益 | | |
|-------------------------------|------|-------------------------|
| 基金運用規模 | | 5,765 億 6,084 萬元 |
| 101 年截至 10 月底止運用總損益 評價後報酬率 | 自行運用 | 106 億 8,227 萬元 3.10% |
| | 委託經營 | 55 億 2,933 萬元 2.56% |
| | 合計 | 162 億 1,160 萬元 2.89% |

註：評價後報酬率係以當期報酬率（即收益÷101年之日平均餘額）列示

(二)、截至 101 年 10 月底資產配置

單位：新台幣元；%

| 項 目 | 餘 額 | 占基金運用比例 |
|-------------------|------------------------|----------------|
| 自行運用 | 378,366,027,245 | 65.62% |
| 轉存金融機構 | 134,883,745,043 | 23.39% |
| 短期票券 | 60,234,405,162 | 10.45% |
| 公債、金融債券、公司債及證券化商品 | 63,448,024,706 | 11.00% |
| 政府機關及公營事業經建貸款 | 375,000,000 | 0.07% |
| 股票及受益憑證投資(含期貨) | 52,401,551,712 | 9.09% |
| 國外投資 | 67,023,300,622 | 11.62% |
| 固定收益類 | 45,956,356,481 | 7.97% |
| 權益證券 | 16,757,362,079 | 2.91% |
| 另類投資 | 4,309,582,062 | 0.74% |
| 國內委託經營 | 109,128,510,903 | 18.93% |
| 國外委託經營 | 89,066,305,922 | 15.45% |
| 固定收益類 | 46,634,098,225 | 8.09% |
| 權益證券 | 42,432,207,697 | 7.36% |
| 合 計 | 576,560,844,070 | 100.00% |

(三)、國內股票投資比率表(市價法)

類股持股比率(截至 101.10.31)

| 自行運用 | | 委託經營 | |
|--------|---------|--------|---------|
| 類股 | 市值/餘額 | 類股 | 市值/餘額 |
| 水泥工業 | 3.03% | 水泥工業 | 2.02% |
| 食品工業 | 3.87% | 食品工業 | 1.37% |
| 塑膠工業 | 10.65% | 塑膠工業 | 1.44% |
| 紡織纖維 | 1.47% | 紡織纖維業 | 1.48% |
| 電機機械 | 0.00% | 電機機械 | 0.63% |
| 電器電纜股 | 0.00% | 電器電纜股 | 0.00% |
| 化學工業 | 1.85% | 化學工業 | 0.97% |
| 生技醫療業 | 0.03% | 生技醫療業 | 0.76% |
| 玻璃陶瓷 | 0.00% | 玻璃陶瓷 | 0.00% |
| 造紙工業 | 0.01% | 造紙工業 | 0.04% |
| 鋼鐵工業 | 3.00% | 鋼鐵工業 | 0.22% |
| 橡膠工業 | 3.07% | 橡膠工業 | 6.73% |
| 汽車工業 | 0.00% | 汽車工業 | 2.39% |
| 半導體業 | 17.84% | 半導體業 | 23.12% |
| 電腦及週邊 | 7.24% | 電腦及週邊 | 7.45% |
| 光電業 | 0.63% | 光電業 | 9.18% |
| 通信網路業 | 8.29% | 通信網路業 | 5.57% |
| 電子零組件業 | 3.52% | 電子零組件業 | 5.36% |
| 電子通路業 | 2.69% | 電子通路業 | 1.26% |
| 資訊服務業 | 0.00% | 資訊服務業 | 0.24% |
| 其他電子業 | 6.47% | 其他電子業 | 10.24% |
| 建材營造 | 0.00% | 建材營造 | 0.57% |
| 航運業 | 0.00% | 航運業 | 1.99% |
| 觀光事業 | 0.00% | 觀光事業 | 0.98% |
| 金融保險 | 5.56% | 金融保險 | 8.52% |
| 貿易百貨 | 0.55% | 貿易百貨 | 1.28% |
| 油電燃氣業 | 2.35% | 油電燃氣業 | 0.21% |
| 其他 | 0.55% | 其他 | 5.94% |
| ETF | 17.33% | 存託憑證 | 0.04% |
| | | | |
| 合計 | 100.00% | 合計 | 100.00% |

註：社會責任投資(SRI)：本基金投資於遠見雜誌與天下雜誌等機構所評比遴選出之企業社會責任(CSR)得獎名單，計有 95.12%。

(四)、國內委託經營各受託投信績效統計

國內委託經營

單位：新台幣 億元

| 委託批次 (委託日期) | 原委託金額 | 目前委託金額 | 說明 |
|----------------------------|------------|-------------|---|
| 97年續約 (100.3.17) | 101.80 億元 | 84.83 億元 | 101年7月收回委託資產 16.97 億元 |
| 98年第二次委託經營 (99.1.26) | 300 億元 | 210 億元 | 100年11月收回委託資產 30 億元；101年3月收回委託資產 30 億元；101年7月收回委託資產 30 億元 |
| 99年第一次委託經營 (99.8.13) | 320 億元 | 280 億元 | 101年9月收回委託資產 40 億元 |
| 100年第一次委託經營 (100.3.17) | 300 億元 | 250 億元 | 101年9月收回委託資產 50 億元 |
| 101年第一次委託經營 (101.10.30) | 10 億元 | 10 億元 | |
| 101年第二次委託經營 (101.4.30) | 300 億元 | 300 億元 | |
| 合計 | 1,331.8 億元 | 1,134.83 億元 | |

97年續約

單位：新台幣元；%

| 投 信 名 稱 | 目 前 淨 資 產 | 投資報酬率 (%) | |
|---------|---------------|----------------------------------|------------------------------|
| | | 本年截至 10 月 (101.1.1~101.10.31) | 委任迄今 (100.3.17~101.10.31) |
| 保德信投信 | 3,111,411,381 | 2.18% | -6.11% |
| 群益投信 | 3,170,969,064 | -0.71% | -8.67% |
| 元大寶來投信 | 1,340,041,056 | -1.91% | -21.04% |
| 合計 | 7,622,421,501 | 0.23% | -10.15% |

註：三家委託金額分別為 33.14 億元、34.72 億元、16.97 億元，總委託投資金額 84.83 億元。

98 年第二次委託經營

單位：新台幣元；%

| 投 信 名 稱 | 目 前 淨 資 產 | 投 資 報 酬 率 (%) | |
|---------|----------------|-------------------------------------|--------------------------------|
| | | 本 年 截 至 10 月 (101.1.1~101.10.31) | 委 任 迄 今 (99.1.26~101.10.31) |
| 保德信投信 | 3,258,971,581 | 1.71% | 8.63% |
| 群益投信 | 2,973,785,632 | -0.70% | -0.87% |
| 安泰投信 | 2,818,273,306 | 3.56% | -6.06% |
| 國泰投信 | 2,782,486,206 | 3.82% | -7.25% |
| 富邦投信 | 3,165,065,774 | 1.77% | 5.50% |
| 摩根投信 | 2,958,942,388 | -1.66% | -1.37% |
| 統一投信 | 3,426,803,389 | 2.88% | 14.23% |
| 合 計 | 21,384,328,276 | 1.59% | 1.83% |

註：各家委託金額均 30 億元，總委託投資金額 300 億元。

99 年第一次委託經營

單位：新台幣元；%

| 投 信 名 稱 | 目 前 淨 資 產 | 投 資 報 酬 率 (%) | |
|---------|----------------|-------------------------------------|--------------------------------|
| | | 本 年 截 至 10 月 (101.1.1~101.10.31) | 委 任 迄 今 (99.8.13~101.10.31) |
| 保德信投信 | 3,612,372,071 | 0.70% | -9.69% |
| 群益投信 | 3,575,485,848 | -2.46% | -10.61% |
| 復華投信 | 3,442,069,640 | 2.56% | -13.95% |
| 國泰投信 | 3,889,998,142 | 2.41% | -2.75% |
| 元大寶來投信 | 3,365,781,234 | -2.16% | -15.86% |
| 永豐投信 | 3,710,310,623 | 3.04% | -7.24% |
| 日盛投信 | 3,719,093,766 | 5.13% | -7.02% |
| 合 計 | 25,315,111,324 | 1.32% | -9.59% |

註：各家委託金額均 40 億元，總委託投資金額 280 億元。

100 年第一次委託經營

單位：新台幣元；%

| 投 信 名 稱 | 目 前 淨 資 產 | 投 資 報 酬 率 (%) | |
|---------|----------------|-------------------------------------|---------------------------------|
| | | 本 年 截 至 10 月 (101.1.1~101.10.31) | 委 任 迄 今 (100.3.17~101.10.31) |
| 保德信投信 | 4,663,106,467 | 2.06% | -6.74% |
| 群益投信 | 4,741,284,698 | 1.52% | -5.17% |
| 復華投信 | 4,552,667,573 | 1.13% | -8.95% |
| 國泰投信 | 4,770,365,526 | 2.36% | -4.59% |
| 統一投信 | 4,774,104,426 | 2.89% | -4.52% |
| 合 計 | 23,501,528,690 | 2.00% | -5.99% |

註：各家委託金額均 50 億元，總委託投資金額 250 億元。

101 年第一次委託經營

單位：新台幣元；%

| 投 信 名 稱 | 目 前 淨 資 產 | 投 資 報 酬 率 (%) | |
|---------|-------------|---------------------------------------|----------------------------------|
| | | 本 年 截 至 10 月 (101.10.30~101.10.31) | 委 任 迄 今 (101.10.30~101.10.31) |
| 匯豐中華投信 | 497,349,066 | -0.53% | -0.53% |
| 元大寶來投信 | 498,670,797 | -0.27% | -0.27% |
| 合 計 | 996,019,863 | -0.40% | -0.40% |

註：各家委託金額均 5 億元，總委託投資金額 10 億元。

101 年第二次委託經營

單位：新台幣元；%

| 投 信 名 稱 | 目 前 淨 資 產 | 投 資 報 酬 率 (%) | |
|---------|----------------|--------------------------------------|---------------------------------|
| | | 本 年 截 至 10 月 (101.4.30~101.10.31) | 委 任 迄 今 (101.4.30~101.10.31) |
| 保德信投信 | 4,947,266,950 | -1.05% | -1.05% |
| 群益投信 | 5,048,342,105 | 0.97% | 0.97% |
| 匯豐中華投信 | 5,097,646,714 | 1.95% | 1.95% |
| 安泰投信 | 5,000,179,889 | 0.004% | 0.004% |
| 國泰投信 | 4,962,076,519 | -0.76% | -0.76% |
| 統一投信 | 4,904,257,057 | -1.91% | -1.91% |
| 合 計 | 29,959,769,234 | -0.13% | -0.13% |

註：各家委託金額均 50 億元，總委託投資金額 300 億元。

(五)、國內委託投資績效統計

單位：新台幣元；%

| 項 目 委託批次 | 基 金 委 託 金 額 | 委 託 資 產 淨 值 | 損 益 金 額 | | 投 資 報 酬 率 (%) | |
|-----------------------------|----------------|----------------|-------------------------------------|----------------|-------------------------------------|---------|
| | | | 本 年 截 至 10 月 (101.1.1~101.10.31) | 委 任 迄 今 | 本 年 截 至 10 月 (101.1.1~101.10.31) | 委 任 迄 今 |
| 97 年委託續約 (100.3.17委託) | 8,483,110,399 | 7,622,421,501 | 17,836,819 | -860,688,898 | 0.23% | -10.15% |
| 98 年第二次委託 (99.1.26委託) | 21,000,000,000 | 21,384,328,276 | 333,763,876 | 384,328,276 | 1.59% | 1.83% |
| 99 年第一次委託 (99.8.13委託) | 28,000,000,000 | 25,315,111,324 | 329,277,630 | -2,684,888,676 | 1.32% | -9.59% |
| 100 年第一次委託 (100.3.17委託) | 25,000,000,000 | 23,501,528,690 | 460,324,568 | -1,498,471,310 | 2.00% | -5.99% |
| 101 年第一次委託 (101.10.30委託) | 1,000,000,000 | 996,019,863 | -3,980,137 | -3,980,137 | -0.40% | -0.40% |
| 101 年第二次委託 (101.4.30委託) | 30,000,000,000 | 29,959,769,234 | -40,230,766 | -40,230,766 | -0.13% | -0.13% |

註：同期間台股報酬率 101 年 1 月 1 日至 101 年 10 月 31 日止為 1.33%；100 年 3 月 17 日至 101 年 10 月 31 日止為 -13.92%；99 年 1 月 26 日至 101 年 10 月 31 日止為 -8.98%；99 年 8 月 13 日至 101 年 10 月 31 日止為 -8.48%；101 年 10 月 30 日至 101 年 10 月 31 日止為 1.05%；101 年 4 月 30 日至 101 年 10 月 31 日止為 -4.2%。

(六)、國外委託經營各受託投信績效統計

國外委託經營

單位：美元

| 委託批次 (委託日期) | 委託金額 |
|--|----------|
| 96年續國外委託經營 平衡型 (100.6.21) | 4.26億美元 |
| 97年國外委託經營 全球增值債券型 (98.1.6) | 12億美元 |
| 97年國外委託經營 全球增值股票型 (98.2.5) | 4億美元 |
| 98年國外委託經營 亞太(日本除外)股票型 (98.11.17) | 2億美元 |
| 100年國外委託經營 全球基本面指數股票型 (101.3.6) | 4億美元 |
| 合計 | 26.26億美元 |

96年續約國外委託經營(平衡型) 單位：美元；%

| 受託機構名稱 | 目前淨資產 | 投資報酬率(%) | |
|--------|-----------------|--------------------------------|------------------------------|
| | | 本年截至10月 (101.1.1~101.10.31) | 委任迄今 (100.6.21~101.10.31) |
| 富達國際 | 467,808,037.35元 | 9.28% | 8.03% |
| 合計 | 467,808,037.35元 | 9.28% | 8.03% |

註：委託金額為4.26億美元。

97年國外委託經營(全球增值債券型) 單位：美元；%

| 受託機構名稱 | 目前淨資產 | 投資報酬率(%) | |
|--------|-------------------|--------------------------------|----------------------------|
| | | 本年截至10月 (101.1.1~101.10.31) | 委任迄今 (98.1.6~101.10.31) |
| 太平洋 | 739,438,804.93元 | 6.91% | 34.33% |
| 盧米斯 | 721,456,070.33元 | 5.66% | 30.87% |
| 合計 | 1,460,894,875.26元 | 6.29% | 32.60% |

註：各家委託金額均6億美元，總委託投資金額12億美元。

97 年國外委託經營(全球增值股票型) 單位：美元；%

| 受託機構名稱 | 目前淨資產 | 投資報酬率(%) | |
|--------|------------------|----------------------------------|----------------------------|
| | | 本年截至 10 月 (101.1.1~101.10.31) | 委任迄今 (98.2.5~101.10.31) |
| 貝萊德 | 353,706,279.26 元 | 15.72% | 76.85% |
| 德意志資產 | 331,442,073.38 元 | 9.00% | 65.72% |
| 合 計 | 685,148,352.64 元 | 12.37% | 71.29% |

註：各家委託金額均 2 億美元，總委託投資金額 4 億美元。

98 年國外委託經營(亞太(日本除外)股票型) 單位：美元；%

| 受託機構名稱 | 目前淨資產 | 投資報酬率(%) | |
|--------|------------------|----------------------------------|------------------------------|
| | | 本年截至 10 月 (101.1.1~101.10.31) | 委任迄今 (98.11.17~101.10.31) |
| 景順 | 235,110,371.51 元 | 15.75% | 17.56% |
| 合 計 | 235,110,371.51 元 | 15.75% | 17.56% |

註：委託金額為 2 億美元。

100 年國外委託經營(全球基本面指數股票型) 單位：美元；%

| 受託機構名稱 | 目前淨資產 | 投資報酬率(%) | |
|--------|------------------|----------------------------------|-----------------------------|
| | | 本年截至 10 月 (101.3.6~101.10.31) | 委任迄今 (101.3.6~101.10.31) |
| 貝萊德 | 100,147,062.87 元 | 0.15% | 0.15% |
| 道富 | 100,147,347.35 元 | 0.15% | 0.15% |
| 瑞銀環球 | 100,701,561.60 元 | 0.70% | 0.70% |
| 野村 | 100,354,895.99 元 | 0.35% | 0.35% |
| 合 計 | 401,350,867.81 元 | 0.34% | 0.34% |

註：各家委託金額均 1 億美元，總委託投資金額 4 億美元。

(七)、國外委託投資績效

單位：美元；%

| 項 目 委託批次 | 基金委託金額 | 委託資產淨值 | 損益金額 | | 投資報酬率(%) | |
|--|------------------|------------------|--------------------------------|----------------|--------------------------------|----------|
| | | | 本年截至10月 (101.1.1~101.10.31) | 委任 迄今 | 本年截至10月 (101.1.1~101.10.31) | 委任 迄今 |
| 96年續國外委託 平衡型 (100.6.21委託) | 425,533,349.13 | 467,808,037.35 | 39,725,582.40 | 42,274,688.22 | 9.28% | 8.03% |
| 97年國外委託 全球增值債券型 (98.1.6委託) | 1,200,000,000.00 | 1,460,894,875.26 | 86,462,937.69 | 260,894,875.26 | 6.29% | 32.60% |
| 97年國外委託 全球增值股票型 (98.2.5委託) | 400,000,000.00 | 685,148,352.64 | 75,434,808.95 | 285,148,352.64 | 12.37% | 71.29% |
| 98年國外委託 亞太(日本除外) 股票型 (98.11.17委託) | 200,000,000.00 | 235,110,371.51 | 31,984,858.60 | 35,110,371.51 | 15.75% | 17.56% |
| 100年國外委託 全球基本面指數 股票型 (101.3.6委託) | 400,000,000.00 | 401,350,867.81 | 1,350,867.81 | 1,350,867.81 | 0.34% | 0.34% |

- 註：1. 同期間指標報酬率101年1月1日至101年10月31日；96續約國際平衡型為8.96%；97年全球增值債券型為4.67%；97年全球增值股票型為12.12%；98年亞太(日本除外)股票型為15.95%；100年全球基本面指數股票型為0.10%。
2. 委託至今同期間指標報酬率100年6月21日至101年10月31日96續國際平衡型為5.86%；98年1月6日至101年10月31日97年全球增值債券型為26.37%；98年2月5日至101年10月31日97年全球增值股票型為70.31%；98年11月17日至101年10月31日98年亞太(日本除外)股票型為16.11%；101年3月6日至101年10月31日100年全球基本面指數股票型為0.10%。
3. 未含美元兌新台幣之兌換損益。

二、新制勞工退休基金規模與運用情形

勞工退休金新制於 94 年 7 月 1 日開辦，截至 101 年 10 月開單之提繳事業單位家數達 443,537 家，提繳勞退新制勞工人數達 5,651,526 人。

(一)、基金規模與收益

單位：新台幣萬元；%

| 至 101 年 10 月底止基金規模與收益 | | |
|-------------------------------|------|-------------------------|
| 基金運用規模 | | 8,591 億 4,545 萬元 |
| 101 年截至 10 月底止 運用總損益評價後報酬率 | 自行運用 | 62 億 8,246 萬元 1.67% |
| | 委託經營 | 181 億 9,081 萬元 4.31% |
| | 合 計 | 244 億 7,327 萬元 3.07% |

註 1：評價後報酬率係以當期報酬率（即收益÷101 年之日平均餘額）列示。

註 2：101 年 10 月之保證收益率為 1.3916%。

(二)、截至 101 年 10 月底資產配置

單位：新台幣元；%

| 項 目 | 餘 額 | 占基金運用比例 |
|----------------|------------------------|---------------|
| 自行運用 | 404,455,434,102 | 47.08% |
| 轉存金融機構 | 183,893,151,535 | 21.41% |
| 短期票券 | 60,500,500,896 | 7.04% |
| 公債、公司債及金融債券 | 91,484,980,674 | 10.65% |
| 貨幣型基金 | 2,085,357,330 | 0.24% |
| 股票及受益憑證投資（含期貨） | 7,195,543,221 | 0.84% |
| 國外投資 | 59,295,900,446 | 6.90% |
| 固定收益類 | 55,771,029,816 | 6.49% |
| 權益證券 | 3,149,960,773 | 0.37% |
| 另類投資 | 374,909,857 | 0.04% |
| 國內委託經營 | 202,351,473,605 | 23.55% |

| | | |
|--------|-----------------|---------|
| 國外委託經營 | 252,338,540,136 | 29.37% |
| 固定收益類 | 108,336,327,499 | 12.61% |
| 權益證券 | 117,254,367,221 | 13.65% |
| 另類投資 | 26,747,845,416 | 3.11% |
| 合計 | 859,145,447,843 | 100.00% |

(三)、國內股票投資比率表(市價法)
類股持股比率(截至 101.10.31 止)

| 委託經營 | |
|-----------|----------|
| 類股 | 市值/餘額(%) |
| 水泥工業股 | 1.45 |
| 食品工業股 | 1.42 |
| 塑膠工業股 | 2.49 |
| 紡織纖維股 | 1.59 |
| 電機機械股 | 1.04 |
| 電器電纜股 | 0.00 |
| 化學工業股 | 0.86 |
| 玻璃陶瓷股 | 0.17 |
| 造紙工業股 | 0.17 |
| 鋼鐵工業股 | 0.60 |
| 橡膠工業股 | 4.55 |
| 汽車工業股 | 1.44 |
| 建材營造股 | 0.85 |
| 航運業股 | 1.46 |
| 觀光股 | 0.59 |
| 金融保險股 | 15.15 |
| 貿易百貨股 | 1.42 |
| 生技醫療業股 | 0.58 |
| 半導體業股 | 22.24 |
| 電腦及週邊設備業股 | 8.87 |
| 光電業股 | 6.47 |
| 通信網路業股 | 6.16 |
| 電子零組件業股 | 5.44 |
| 電子通路業股 | 0.82 |
| 資訊服務業股 | 0.12 |
| 其他電子業股 | 9.06 |
| 上市油電燃氣業股 | 0.40 |
| 存託憑證 | 0.02 |
| 其他 | 4.57 |
| 合計 | 100.00 |

註：社會責任投資(SRI)：本基金投資於遠見雜誌與天下雜誌等機構所評比遴選出之企業社會責任(CSR)得獎名單，計有 95.12%。

(四)、國內委託經營各受託投信績效統計

國內委託經營

單位：新台幣億元

| 委託批次 (委託日期) | 原委託金額 | 目前委託金額 | 說明 |
|-------------------------|------------|------------|--|
| 96年第一次委託安泰續約(99.9.27) | 70億元 | 70億元 | 96年第一次委託及安泰A帳戶於99年9月到期收回後，續約績效較佳之安泰。 |
| 97年第一次委託續約(100.1.18) | 274.92億元 | 207.61億元 | 97年第一次委託及寶來A、日盛A帳戶於100年1月到期收回，績效較佳之七帳戶採現況續約接續操作(2個A帳戶個別併入原委託帳戶)；101年4月收回29.04億元；101年7月收回38.27億元。 |
| 97年第一次委託續約A帳戶(100.3.17) | 40億元 | 40億元 | 97年第一次委託續約於100年3月增額提撥安泰A帳戶及保德信A帳戶各20億元。 |
| 97年第二次委託續約(100.10.8) | 140.04億元 | 140.04億元 | 97年第二次委託於100年10月到期收回，並就績效較佳之二帳戶採現況續約接續操作。 |
| 98年第一次委託續約(101.7.14) | 68.45億元 | 68.45億元 | 98年第一次委託於101年7月到期收回，並就績效較佳之二帳戶採現況續約接續操作。 |
| 99年第一次委託(99.3.9) | 280億元 | 280億元 | 100年5月收回40億元，並採現況移轉至保德信A帳戶接續操作。 |
| 99年第一次委託A帳戶(100.5.12) | 39.69億元 | 39.69億元 | 100年5月收回40億元，並採現況移轉至保德信A帳戶接續操作。 |
| 99年第二次委託(99.11.30) | 350億元 | 300億元 | 101年2月收回50億元。 |
| 100年第一次委託(100.7.15) | 360億元 | 320億元 | 100年7月及10月各提撥120億元，12月1、9日各撥款30億元，101年1月增額提撥60億元，101年2月及3月各收回20億元。 |
| 100年第二次第一期委託(100.8.10) | 180億元 | 150億元 | 101年8月收回30億元。 |
| 100年第二次第二期委託(100.11.23) | 120億元 | 120億元 | |
| 101年第一次委託(101.4.18) | 40億元 | 40億元 | 101年4月及10月各撥款20億元。 |
| 101年第二次委託(101.7.16) | 300億元 | 300億元 | |
| 合計 | 2,263.10億元 | 2,075.78億元 | |

96 年第一次委託經營安泰（續約）

單位：新台幣元；%

| 投信名稱 | 目前淨資產 | 投資報酬率(%) | |
|------|---------------|----------------------------------|-----------------------------|
| | | 本年截至 10 月 (101.1.1~101.10.31) | 委任迄今 (99.9.27~101.10.31) |
| 安泰 | 7,202,288,313 | 2.55 | 2.89 |
| 合計 | 7,202,288,313 | 2.55 | 2.89 |

註：委託投資金額為 70 億元。

97 年第一次委託經營（續約）

單位：新台幣元；%

| 投信名稱 | 目前淨資產 | 投資報酬率(%) | |
|-----------|----------------|----------------------------------|------------------------------|
| | | 本年截至 10 月 (101.1.1~101.10.31) | 委任迄今 (100.1.18~101.10.31) |
| 日盛 | 4,531,873,850 | 5.16 | -8.79 |
| 安泰 | 3,229,867,009 | 2.14 | -2.07 |
| 保德信 | 2,640,052,640 | 1.99 | -10.18 |
| 國泰 | 2,575,470,456 | 5.64 | -12.54 |
| 群益 | 2,614,287,747 | -0.74 | -6.05 |
| 元大寶來(原寶來) | 3,062,503,792 | -5.65 | -19.98 |
| 合計 | 18,654,055,494 | 1.50 | -10.15 |

註：97 年第 1 次委託經營 9 帳戶於 100 年 1 月 17 日到期，原 7 帳戶自到期翌日採現況續約接續操作(寶來 A、日盛 A 帳戶個別併入原委託帳戶)；101 年 4 月 25 日收回元大帳戶，委託金額為 245.88 億餘元；101 年 7 月 10 日收回 1/2 元大寶來(原寶來)帳戶，委託金額為 207.61 億餘元。

97 年第一次委託經營（續約）A 帳戶

單位：新台幣元；%

| 投信名稱 | 目前淨資產 | 投資報酬率(%) | |
|------|---------------|----------------------------------|------------------------------|
| | | 本年截至 10 月 (101.1.1~101.10.31) | 委任迄今 (100.3.17~101.10.31) |
| 安泰 | 1,962,773,705 | 2.13 | -1.86 |
| 保德信 | 1,905,731,110 | 1.18 | -4.71 |
| 合計 | 3,868,504,815 | 1.66 | -3.29 |

註：97 年第 1 次委託經營(續約)於 100 年 3 月 17 日增額提撥安泰 A、保德信 A 帳戶各 20 億元，總委託金額為 40 億元。

97 年第二次委託經營（續約）

單位：新台幣元；%

| 投信名稱 | 目前淨資產 | 投資報酬率(%) | |
|------|----------------|----------------------------------|------------------------------|
| | | 本年截至 10 月 (101.1.1~101.10.31) | 委任迄今 (100.10.8~101.10.31) |
| 富邦 | 6,565,765,663 | -0.11 | -2.70 |
| 群益 | 7,208,579,846 | -0.29 | -0.66 |
| 合計 | 13,774,345,509 | -0.20 | -1.64 |

註：97 年第 2 次委託經營 10 帳戶於 100 年 10 月 7 日到期，其中績效較佳 2 帳戶自到期翌日採現況續約接續操作(合併原績效較差 2 帳戶)，委託金額為 140.04 億餘元。

98 年第一次委託經營（續約）

單位：新台幣元；%

| 投信名稱 | 目前淨資產 | 投資報酬率(%) | |
|------|---------------|-----------------------------------|------------------------------|
| | | 本年截至 10 月 (101.7.14~101.10.31) | 委任迄今 (101.7.14~101.10.31) |
| 安泰 | 3,504,311,888 | 2.42 | 2.42 |
| 保德信 | 3,478,638,185 | 1.62 | 1.62 |
| 合計 | 6,982,950,073 | 2.02 | 2.02 |

註：98 年第 1 次委託經營 10 帳戶於 101 年 7 月 13 日到期，其中績效較佳 2 帳戶自到期翌日採現況續約接續操作，委託金額為 68.45 億餘元。

99 年第一次委託經營

單位：新台幣元；%

| 投信名稱 | 目前淨資產 | 投資報酬率(%) | |
|------|----------------|----------------------------------|----------------------------|
| | | 本年截至 10 月 (101.1.1~101.10.31) | 委任迄今 (99.3.9~101.10.31) |
| 安泰 | 4,363,057,299 | 2.51 | 9.08 |
| 保德信 | 4,420,889,675 | 1.50 | 10.52 |
| 國泰 | 3,737,086,115 | 5.76 | -6.57 |
| 富邦 | 3,932,003,668 | 0.30 | -1.70 |
| 復華 | 3,842,758,912 | -0.17 | -3.93 |
| 群益 | 4,185,368,821 | 2.20 | 4.63 |
| 摩根 | 3,883,071,542 | -1.69 | -2.92 |
| 合計 | 28,364,236,032 | 1.45 | 1.30 |

註：各家委託金額均 40 億元，原總委託投資金額 320 億元，100 年 5 月 11 日收回寶來帳戶並現況移轉至保德信 A 帳戶接續操作，委託金額為 280 億元。

99 年第一次委託經營 A 帳戶

單位：新台幣元；%

| 投信名稱 | 目前淨資產 | 投資報酬率(%) | |
|------|---------------|----------------------------------|------------------------------|
| | | 本年截至 10 月 (101.1.1~101.10.31) | 委任迄今 (100.5.12~101.10.31) |
| 保德信 | 3,466,254,862 | 1.20 | -12.66 |
| 合計 | 3,466,254,862 | 1.20 | -12.66 |

註：100 年 5 月 11 日收回寶來帳戶並現況移轉至保德信 A 帳戶接續操作，委託投資金額為 39.69 億元。

99 年第二次委託經營

單位：新台幣元；%

| 投信名稱 | 目前淨資產 | 投資報酬率(%) | |
|-----------|----------------|----------------------------------|------------------------------|
| | | 本年截至 10 月 (101.1.1~101.10.31) | 委任迄今 (99.11.30~101.10.31) |
| 日盛 | 4,237,646,871 | 2.44 | -15.25 |
| 永豐 | 4,345,442,225 | 3.04 | -13.09 |
| 國泰 | 5,044,519,450 | 6.39 | 0.89 |
| 富邦 | 4,909,142,020 | 1.92 | -1.82 |
| 滙豐中華 | 4,214,400,190 | 0.42 | -15.71 |
| 元大寶來(原寶來) | 4,222,151,504 | -2.49 | -15.56 |
| 合計 | 26,973,302,260 | 2.02 | -10.09 |

註：101 年 2 月 20 日收回復華帳戶，餘各家委託金額均 50 億元，總委託投資金額 300 億元。

100 年第一次委託經營

單位：新台幣元；%

| 投信名稱 | 目前淨資產 | 投資報酬率(%) | |
|-----------|----------------|----------------------------------|------------------------------|
| | | 本年截至 10 月 (101.1.1~101.10.31) | 委任迄今 (100.7.15~101.10.31) |
| 元大寶來(原元大) | 4,759,112,530 | 4.35 | -4.82 |
| 國泰 | 4,741,875,705 | 3.17 | -5.16 |
| 富邦 | 5,616,721,198 | -0.38 | -6.39 |
| 復華 | 4,761,096,981 | 5.00 | -4.78 |
| 滙豐中華 | 5,670,673,137 | 0.68 | -5.49 |
| 元大寶來(原寶來) | 4,736,017,824 | 3.18 | -5.28 |
| 合計 | 30,285,497,375 | 2.48 | -5.36 |

註：100 年 7 月 15 日及 10 月 11 日各撥款 120 億元，100 年 12 月 1 日及 9 日各提撥 30 億元，101 年 1 月 3 日各提撥 60 億元；101 年 2 月 15、23 日獲利了結收回元大、復華帳戶各 10 億元（委託金額更為 50 億元），101 年 3 月 6、21 日獲利了結收回寶來、國泰帳戶各 10 億元（委託金額更為 50 億元），餘各家委託金額均 60 億元，總委託投資金額 320 億元。

100 年第二次委託經營第一期

單位：新台幣元；%

| 投信名稱 | 目前淨資產 | 投資報酬率(%) | |
|------|----------------|----------------------------------|------------------------------|
| | | 本年截至 10 月 (101.1.1~101.10.31) | 委任迄今 (100.8.10~101.10.31) |
| 保德信 | 2,941,164,343 | 0.12 | -1.96 |
| 統一 | 2,723,482,142 | 0.20 | -9.22 |
| 富邦 | 2,745,104,843 | -0.72 | -8.50 |
| 復華 | 2,877,746,051 | 2.97 | -4.08 |
| 摩根 | 2,887,585,677 | -2.86 | -3.75 |
| 合計 | 14,175,083,056 | -0.09 | -5.50 |

註：101 年 8 月 13 日收回滙豐中華帳戶，餘各家委託金額均 30 億元，總委託投資金額 150 億元。

100 年第二次委託經營第二期

單位：新台幣元；%

| 投信名稱 | 目前淨資產 | 投資報酬率(%) | |
|------|----------------|----------------------------------|-------------------------------|
| | | 本年截至 10 月 (101.1.1~101.10.31) | 委任迄今 (100.11.23~101.10.31) |
| 保德信 | 1,990,957,193 | -0.65 | -0.45 |
| 統一 | 1,949,405,421 | -2.53 | -2.53 |
| 富邦 | 1,957,779,059 | -0.96 | -2.11 |
| 復華 | 2,040,630,767 | 1.98 | 2.03 |
| 滙豐中華 | 1,985,051,571 | -1.12 | -0.75 |
| 摩根 | 1,935,777,145 | -3.12 | -3.21 |
| 合計 | 11,859,601,156 | -1.07 | -1.17 |

註：各家委託金額均 20 億元，總委託投資金額 120 億元。

101 年第一次委託

單位：新台幣元；%

| 投信名稱 | 目前淨資產 | 投資報酬率(%) | |
|-----------|---------------|-----------------------------------|------------------------------|
| | | 本年截至 10 月 (101.4.18~101.10.31) | 委任迄今 (101.4.18~101.10.31) |
| 國泰 | 991,469,912 | -0.85 | -0.85 |
| 富邦 | 982,458,907 | -1.75 | -1.75 |
| 滙豐中華 | 985,057,247 | -1.49 | -1.49 |
| 元大寶來(原寶來) | 990,929,517 | -0.91 | -0.91 |
| 合計 | 3,949,915,583 | -1.25 | -1.25 |

註：101 年 4 月 18 日及 10 月 30 日各撥款 20 億元，各家委託金額均 5 億元，總委託投資金額 40 億元。

101 年第二次委託經營

單位：新台幣元；%

| 投信名稱 | 目前淨資產 | 投資報酬率(%) | |
|------|----------------|-----------------------------------|------------------------------|
| | | 本年截至 10 月 (101.7.16~101.10.31) | 委任迄今 (101.7.16~101.10.31) |
| 安泰 | 5,053,080,687 | 1.06 | 1.06 |
| 保德信 | 4,959,353,471 | -0.81 | -0.81 |
| 國泰 | 4,974,341,389 | -0.51 | -0.51 |
| 統一 | 4,955,387,262 | -0.89 | -0.89 |
| 富邦 | 5,037,266,669 | 0.75 | 0.75 |
| 滙豐中華 | 4,982,384,487 | -0.35 | -0.35 |
| 合計 | 29,961,813,965 | -0.13 | -0.13 |

註：各家委託金額均 50 億元，總委託投資金額 300 億元。

(五)、國內委託經營績效統計

單位：新台幣元；%

| 委託批次 | 項目 | 基金委託金額 | 委託資產淨值 | 損益金額 | | 投資報酬率(%) | |
|------|----------------------------------|----------------|----------------|----------------------------------|----------------|--------------------------------------|----------|
| | | | | 本年截至 10 月 (101.1.1~101.10.31) | 委任迄今 | 本年截至 10 月 (101.1.1~ 101.10.31) | 委任 迄今 |
| | 96 年第一次委託安泰 (續)(99.9.27 委託) | 7,000,000,000 | 7,202,288,313 | 179,373,154 | 202,288,313 | 2.55 | 2.89 |
| | 97 年第一次委託 (續)(100.1.18 委託) | 20,760,903,183 | 18,654,055,494 | 276,344,842 | -2,106,847,689 | 1.50 | -10.15 |
| | 97 年第一次委託(續)A 帳戶(100.3.17 委託) | 4,000,000,000 | 3,868,504,815 | 63,220,319 | -131,495,185 | 1.66 | -3.29 |
| | 97 年第二次委託 (續)(100.10.8 委託) | 14,004,067,313 | 13,774,345,509 | -28,159,849 | -229,721,804 | -0.20 | -1.64 |
| | 98 年第一次委託(續) (101.7.14 委託) | 6,844,528,232 | 6,982,950,073 | 138,421,841 | 138,421,841 | 2.02 | 2.02 |
| | 99 年第一次委託 (99.3.9 委託) | 28,000,000,000 | 28,364,236,032 | 404,421,778 | 364,236,032 | 1.45 | 1.30 |
| | 99 年第一次委託 A 帳 戶(100.5.12 委託) | 3,968,544,959 | 3,466,254,862 | 41,220,399 | -502,290,097 | 1.20 | -12.66 |
| | 99 年第二次委託 (99.11.30 委託) | 30,000,000,000 | 26,973,302,260 | 534,804,744 | -3,026,697,740 | 2.02 | -10.09 |
| | 100 年第一次委託 (100.7.15 委託) | 32,000,000,000 | 30,285,497,375 | 733,605,958 | -1,714,502,625 | 2.48 | -5.36 |
| | 100 年第二次第一期 委託(100.8.10 委託) | 15,000,000,000 | 14,175,083,056 | -13,047,914 | -824,916,944 | -0.09 | -5.50 |
| | 100 年第二次第二期 委託(100.11.23 委託) | 12,000,000,000 | 11,859,601,156 | -127,830,977 | -140,398,844 | -1.07 | -1.17 |
| | 101 年第一次委託 (101.4.18 委託) | 4,000,000,000 | 3,949,915,583 | -50,084,417 | -50,084,417 | -1.25 | -1.25 |
| | 101 年第二次委託 (101.7.16 委託) | 30,000,000,000 | 29,961,813,965 | -38,186,035 | -38,186,035 | -0.13 | -0.13 |

註：1.同期間台股報酬率 101 年 1 月 1 日至 101 年 10 月 31 日為 1.33%。

2.委託迄今台股報酬率，99 年 9 月 27 日至 101 年 10 月 31 日為-12.25%，100 年 1 月 18 日至 101 年 10 月 31 日為-19.71%，100 年 3 月 17 日至 101 年 10 月 31 日為-13.92%，100 年 10 月 8 日至 101 年 10 月 31 日為-0.64%，101 年 7 月 14 日至 101 年 10 月 31 日為 0.87%，99 年 3 月 9 日至 101 年 10 月 31 日為-7.68%，100 年 5 月 12 日至 101 年 10 月 31 日為-20.56%，99 年 11 月 30 日至 101 年 10 月 31 日為-14.36%，100 年 7 月 15 日至 101 年 10 月 31 日為-15.51%（如採就業 99 指數則同期間報酬率為-14.71%），100 年 8 月 10 日至 101 年 10 月 31 日為-4.36%，100 年 11 月 23 日至 101 年 10 月 31 日為 2.37%，101 年 4 月 18 日至 101 年 10 月 31 日為-5.53%（如採加權股價報酬指數則同期間報酬率為-2.00%），101 年 7 月 16 日至 101 年 10 月 31 日為 0.87%。

(六)、國外委託經營各受託機構績效統計

國外委託經營

單位：美元

| 委託批次 (委託日期) | 委託金額 | 說明 |
|--|----------|---|
| 97-1 全球股票型續約 (101.5.21) | 4 億美元 | 本批次於 101 年 5 月 19 日到期，就原坦伯頓帳戶資產淨值 4 億美元額度內於 101 年 5 月 21 日續約，超過部分現金收回。 |
| 97-1 全球債券型續約 (101.6.4) | 18 億美元 | 本批次於 101 年 6 月 1 日到期，就原坦伯頓帳戶資產淨值 6.5 億美元、高盛帳戶資產淨值 4 億美元額度內，超過部分現金收回；聯博帳戶資產淨值增額委任至 7.5 億美元，共計 18 億美元於 101 年 6 月 4 日續約。 |
| 97-2 全球增值債券型 (98.1.6) | 9 億美元 | |
| 97-2 全球增值股票型 (98.2.5) | 6 億美元 | |
| 98-1 亞太（日本除外）股票型 (98.11.17) | 8 億美元 | |
| 98-1 全球被動股票型 (98.11.30) | 4 億美元 | |
| 99-1 全球新興市場股票型 (99.8.24) | 9.5 億美元 | |
| 100-1 全球基本面指數股票型 (100.7.1 及 100.7.13) | 6 億美元 | |
| 100-1 全球不動產股票型 (101.3.6) | 9 億美元 | 101 年 3 月 6 日、5 月 16 日及 9 月 25 日每家各撥款 1 億美元，各家委託金額 3 億美元。 |
| 101-1 新興市場債券型 (101.7.31) | 8 億美元 | 101 年 7 月 31 日及 10 月 9 日每家各撥款 1 億美元，各家委託金額 2 億美元。 |
| 合 計 | 81.5 億美元 | |

97 -1 全球股票型續約

單位：美元；%

| 受託機構名稱 | 目前淨資產 | 投資報酬率(%) | |
|--------|----------------|-----------------------------------|------------------------------|
| | | 本年截至 10 月 (101.5.21~101.10.31) | 委任迄今 (101.5.21~101.10.31) |
| 坦伯頓 | 462,706,640.21 | 15.68 | 15.68 |
| 合 計 | 462,706,640.21 | 15.68 | 15.68 |

97-1 全球債券型續約

單位：美元；%

| 受託機構名稱 | 目前淨資產 | 投資報酬率(%) | |
|--------|------------------|----------------------------------|-----------------------------|
| | | 本年截至 10 月 (101.6.4~101.10.31) | 委任迄今 (101.6.4~101.10.31) |
| 聯博 | 780,062,645.81 | 4.01 | 4.01 |
| 高盛 | 415,521,902.77 | 3.88 | 3.88 |
| 坦伯頓 | 701,354,145.15 | 7.90 | 7.90 |
| 合 計 | 1,896,938,693.73 | 5.39 | 5.39 |

97-2 全球增值債券型

單位：美元；%

| 受託機構名稱 | 目前淨資產 | 投資報酬率(%) | |
|--------|------------------|----------------------------------|----------------------------|
| | | 本年截至 10 月 (101.1.1~101.10.31) | 委任迄今 (98.1.6~101.10.31) |
| 太平洋 | 621,729,908.28 | 7.11 | 35.84 |
| 高盛 | 486,298,619.99 | 5.20 | 27.52 |
| 合 計 | 1,108,028,528.27 | 6.23 | 31.84 |

註：太平洋帳戶於 100.11.1 及 101.1.12 各增額委任 1 億美元，委任金額 5 億美元，高盛帳戶 101 年 6 月 6 日增額委任 1 億元，委任金額 4 億美元，總委託投資金額 9 億美元。

97-2 全球增值股票型

單位：美元；%

| 受託機構名稱 | 目前淨資產 | 投資報酬率(%) | |
|--------|----------------|----------------------------------|----------------------------|
| | | 本年截至 10 月 (101.1.1~101.10.31) | 委任迄今 (98.2.5~101.10.31) |
| 貝萊德 | 353,262,238.53 | 15.71 | 76.63 |
| 摩根 | 544,440,450.34 | 13.63 | 73.32 |
| 合 計 | 897,702,688.87 | 14.44 | 74.35 |

註：摩根帳戶於 100.5.12 增額委任 2 億美元，委任金額 4 億美元，貝萊德帳戶委託金額 2 億美元，總委託投資金額 6 億美元。

98-1 亞太（日本除外）股票型

單位：美元；%

| 受託機構名稱 | 目前淨資產 | 投資報酬率(%) | |
|--------|----------------|----------------------------------|------------------------------|
| | | 本年截至 10 月 (101.1.1~101.10.31) | 委任迄今 (98.11.17~101.10.31) |
| 德盛安聯 | 320,283,276.53 | 12.88 | 12.79 |
| 景順 | 332,870,711.64 | 15.68 | 17.44 |
| 摩根士丹利 | 218,077,061.42 | 16.26 | 9.04 |
| 合 計 | 871,231,049.59 | 14.78 | 13.29 |

註：德盛安聯及景順帳戶於 100.1.27 各增額委任 1 億美元，委任金額各 3 億美元，摩根士丹利帳戶委託金額為 2 億美元，總委託投資金額 8 億美元。

98-1 全球被動股票型

單位：美元；%

| 受託機構名稱 | 目前淨資產 | 投資報酬率(%) | |
|--------|----------------|----------------------------------|------------------------------|
| | | 本年截至 10 月 (101.1.1~101.10.31) | 委任迄今 (98.11.30~101.10.31) |
| 貝萊德 | 239,119,589.32 | 12.13 | 19.56 |
| 道富 | 239,044,042.25 | 12.15 | 19.52 |
| 合 計 | 478,163,631.57 | 12.14 | 19.54 |

註：各家委託金額均 2 億美元，總委託投資金額 4 億美元

99-1 全球新興市場股票型

單位：美元；%

| 受託機構名稱 | 目前淨資產 | 投資報酬率(%) | |
|--------|------------------|----------------------------------|-----------------------------|
| | | 本年截至 10 月 (101.1.1~101.10.31) | 委任迄今 (99.8.24~101.10.31) |
| 摩根士丹利 | 260,057,515.70 | 14.34 | 9.19 |
| 美盛 | 230,547,251.81 | 10.18 | -3.46 |
| 瑞萬通博 | 511,418,061.60 | 15.39 | 24.01 |
| 合 計 | 1,002,022,829.11 | 13.88 | 12.21 |

註：99.8.24 及 99.12.1 各撥款 3.75 億美元均分至每一帳戶，瑞萬通博帳戶於 100.6.30 增額委任 2 億美元，委任金額計 4.5 億美元；餘各家委託金額均 2.5 億美元，總委託投資金額 9.5 億美元。

100-1 全球基本面指數股票型

單位：美元；%

| 受託機構名稱 | 目前淨資產 | 投資報酬率(%) | |
|--------|----------------|----------------------------------|--|
| | | 本年截至 10 月 (101.1.1~101.10.31) | 委任迄今 (100.7.1~101.10.31、 100.7.13~101.10.31) |
| 道富 | 286,006,512.52 | 10.56 | -4.66 |
| 貝萊德 | 293,574,475.21 | 10.64 | -2.15 |
| 合 計 | 579,580,987.73 | 10.60 | -4.84 |

註：道富帳戶於 100.7.1 撥款 3 億美元；貝萊德帳戶於 100.7.13 撥款 3 億美元，總委託投資金額 6 億美元。

100-1 全球不動產股票型

單位：美元；%

| 受託機構名稱 | 目前淨資產 | 投資報酬率(%) | |
|----------------|----------------|----------------------------------|-----------------------------|
| | | 本年截至 10 月 (101.3.6~101.10.31) | 委任迄今 (101.3.6~101.10.31) |
| Cohen & Steers | 319,312,291.06 | 8.30 | 8.30 |
| 景順 | 323,491,693.60 | 11.88 | 11.88 |
| EII | 318,545,881.13 | 9.14 | 9.14 |
| 合 計 | 961,349,865.79 | 9.77 | 9.77 |

101-1 新興市場債券型

單位：美元；%

| 受託機構名稱 | 目前淨資產 | 投資報酬率(%) | |
|---------------|----------------|-----------------------------------|------------------------------|
| | | 本年截至 10 月 (101.7.31~101.10.31) | 委任迄今 (101.7.31~101.10.31) |
| Ashmore | 203,742,294.44 | 3.32 | 3.32 |
| Bluebay | 202,183,190.92 | 1.91 | 1.91 |
| Stone Harbour | 202,157,451.29 | 1.76 | 1.76 |
| Pictet | 201,835,869.21 | 1.63 | 1.63 |
| 合 計 | 809,918,805.86 | 2.16 | 2.16 |

(七)、國外委託投資績效

單位：美元；%

| 項 目 委託批次 | 基金委託金額 | 委託資產淨值 | 損益金額 | | 投資報酬率(%) | |
|--|------------------|------------------|----------------------------------|----------------|--------------------------------------|----------|
| | | | 本年截至 10 月 (101.1.1~101.10.31) | 委任迄今 | 本年截至 10 月 (101.1.1~ 101.10.31) | 委任 迄今 |
| 97-1 全球股票型續約 (101.5.21 委託) | 400,000,000.00 | 462,706,640.21 | 62,706,640.21 | 62,706,640.21 | 15.68 | 15.68 |
| 97-1 全球債券型續約 (101.6.4 委託) | 1,800,000,000.00 | 1,896,938,693.73 | 96,938,693.73 | 96,938,693.73 | 5.39 | 5.39 |
| 97-2 全球增值債券型 (98.1.6 委託) | 900,000,000.00 | 1,108,028,528.27 | 64,129,052.99 | 208,028,528.27 | 6.23 | 31.84 |
| 97-2 全球增值股票型 (98.2.5 委託) | 600,000,000.00 | 897,702,688.87 | 113,274,163.91 | 297,702,688.87 | 14.44 | 74.35 |
| 98-1 亞太(日本除 外)股票型 (98.11.17 委託) | 800,000,000.00 | 871,231,049.59 | 112,166,924.79 | 71,231,049.59 | 14.78 | 13.29 |
| 98-1 全球被動股票型 (98.11.30 委託) | 400,000,000.00 | 478,163,631.57 | 51,751,000.51 | 78,163,631.57 | 12.14 | 19.54 |
| 99-1 全球新興 市場股票型 (99.8.24 委託) | 950,000,000.00 | 1,002,022,829.11 | 122,120,184.97 | 52,022,829.11 | 13.88 | 12.21 |
| 100-1 全球基本 面指數股票型 (100.7.1 及 100.7.13 委託) | 600,000,000.00 | 579,580,987.73 | 55,569,843.46 | -20,419,012.27 | 10.60 | -4.84 |
| 100-1 全球 不動產股票型 (101.3.6 委託) | 900,000,000.00 | 961,349,865.79 | 61,349,865.79 | 61,349,865.79 | 9.77 | 9.77 |
| 101-1 新興市場債券型 (101.7.31 委託) | 800,000,000.00 | 809,918,805.86 | 9,918,805.86 | 9,918,805.86 | 2.16 | 2.16 |

註：1. 同期間指標報酬率 101 年 5 月 21 日至 101 年 10 月 31 日 97-1 全球股票型續約為 11.56%；101 年 6 月 4 日至 101 年 10 月 31 日 97-1 全球債券型續約為 3.31%；101 年 1 月 1 日至 101 年 10 月 31 日 97-2 全球增值債券型為 4.67%、97-2 全球增值股票型為 12.12%、98-1 亞太(日本除外)股票型為 15.95%、98-1 全球被動股票型為 12.12%、99-1 全球新興市場股票型為 11.68%、100-1 全球基本面指數股票型為 10.45%；101 年 3 月 6 日至 101 年 10 月 31 日 100-1 全球不動產股票型為 8.59%；101 年 7 月 31 日至 101 年 10 月 31 日 101-1 新興市場債券型為 2.99%。

2. 委託迄今同期間指標報酬率 101 年 5 月 21 日至 101 年 10 月 31 日 97-1 全球股票型續約為 11.56%；101 年 6 月 4 日至 101 年 10 月 31 日 97-1 全球債券型續約為 3.31%；98 年 1 月 6 日至 101 年 10 月 31 日 97-2 全球增值債券型為 26.37%；98 年 2 月 5 日至 101 年 10 月 31 日 97-2 全球增值股票型為 70.31%；98 年 11 月 17 日至 101 年 10 月 31 日 98-1 亞太(日本除外)股票型為 16.11%；98 年 11 月 30 日至 101 年 10 月 31 日 98-1 全球被動股票型為 20.07%；99 年 8 月 24 日至 101 年 10 月 31 日 99-1 全球新興市場股票型為 5.59%；100 年 7 月 1 日至 101 年 10 月 31 日 100-1 全球基本面指數股票型為 -4.91%、100 年 7 月 13 日至 101 年 10 月 31 日 100-1 全球基本面指數股票型為 -2.21%、101 年 3 月 6 日至 101 年 10 月 31 日 100-1 全球不動產股票型為 8.59%；101 年 7 月 31 日至 101 年 10 月 31 日 101-1 新興市場債券型為 2.99%。

3. 損益金額未含美元兌新台幣之兌換損益。

