

勞工退休基金運用情形

一、勞工退休基金整體績效

(一) 111 年截至 2 月底績效

| 基金與指標 | 新制基金 | 舊制基金 | 台灣 10 年期 公債殖利率 | 台灣加權 股價指數 | MSCI 全球 股票指數 | Barclays 全球債券指數 |
|---------|--------|--------|-------------------|--------------|-----------------|--------------------|
| 收益率/報酬率 | -3.13% | -3.43% | 0.73% | -3.11% | -7.37% | -3.21% |

註 1：股、債指數係依據勞動部 103 年 12 月 15 日勞動福 4 字第 1030136646 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(110 年)績效

| 基金與指標 | 新制基金 | 舊制基金 | 台灣 10 年期 公債殖利率 | 台灣加權 股價指數 | MSCI 全球 股票指數 | Barclays 全球債券指數 |
|---------|-------|--------|-------------------|--------------|-----------------|--------------------|
| 收益率/報酬率 | 9.66% | 11.22% | 0.44% | 23.66% | 18.54% | -4.71% |

(三) 近三年(108~110 年)平均績效

| 基金與指標 | 新制基金 | 舊制基金 | 台灣 10 年期 公債殖利率 | 台灣加權 股價指數 | MSCI 全球 股票指數 | Barclays 全球債券指數 |
|---------|-------|--------|-------------------|--------------|-----------------|--------------------|
| 收益率/報酬率 | 9.30% | 11.06% | 0.53% | 23.27% | 20.38% | 3.59% |

(四) 近五年(106~110 年)平均績效

| 基金與指標 | 新制基金 | 舊制基金 | 台灣 10 年期 公債殖利率 | 台灣加權 股價指數 | MSCI 全球 股票指數 | Barclays 全球債券指數 |
|---------|-------|-------|-------------------|--------------|-----------------|--------------------|
| 收益率/報酬率 | 7.09% | 7.80% | 0.72% | 14.51% | 14.40% | 3.36% |

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

| 111 年 2 月底止基金規模與收益 | | | |
|----------------------------|------|----------------------|---------------------------|
| 基金運用規模 | | 3 兆 2,408 億 5,541 萬元 | |
| 111 年截至 2 月底止 運用收益數及收益率 | 自行運用 | 國內固定收益 | 7 億 7,419 萬元 0.55% |
| | | 國內權益證券 及國外投資 | -105 億 6,605 萬元 -2.41% |
| | 委託經營 | | -900 億 2,844 萬元 -4.82% |
| | 合 計 | | -998 億 2,030 萬元 -3.13% |

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 3：111 年 2 月之保證收益率為 0.7858%。

2. 舊制勞工退休基金

| 111 年 2 月底止基金規模與收益 | | | |
|----------------------------|------|-----------------|---------------------------|
| 基金運用規模 | | 9,591 億 939 萬元 | |
| 111 年截至 2 月底止 運用收益數及收益率 | 自行運用 | 國內固定收益 | 2 億 5,656 萬元 0.56% |
| | | 國內權益證券 及國外投資 | -84 億 5,238 萬元 -4.25% |
| | 委託經營 | | -196 億 4,359 萬元 -4.14% |
| | 合 計 | | -278 億 3,941 萬元 -3.43% |

註：評價後報酬率係以當期報酬率（即收益÷111 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

111年2月28日

單位：新臺幣元

| 項 目 | 餘 額 | 占基金運用比率 (%) |
|-----------------|--------------------------|----------------|
| 自行運用 | 1,326,070,194,507 | 40.92 |
| 轉存金融機構 | 625,449,730,392 | 19.30 |
| 短期票券 | 55,876,544,748 | 1.72 |
| 公債、公司債、金融債券及特別股 | 201,064,246,680 | 6.21 |
| 股票及受益憑證投資(含期貨) | 182,695,674,301 | 5.64 |
| 國外投資 | 260,983,998,386 | 8.05 |
| 固定收益 | 157,961,162,797 | 4.87 |
| 權益證券 | 54,802,511,876 | 1.69 |
| 另類投資 | 48,220,323,713 | 1.49 |
| 委託經營 | 1,914,785,214,777 | 59.08 |
| 國內委託經營 | 469,230,562,759 | 14.48 |
| 國外委託經營 | 1,445,554,652,018 | 44.60 |
| 固定收益 | 360,164,713,083 | 11.11 |
| 權益證券 | 727,005,873,148 | 22.43 |
| 另類投資 | 358,384,065,787 | 11.06 |
| 合 計 | 3,240,855,409,284 | 100.00 |

2. 舊制勞工退休基金

111年2月28日

單位：新臺幣元

| 項 目 | 餘 額 | 占基金運用比率 (%) |
|-------------------|------------------------|----------------|
| 自行運用 | 485,959,134,564 | 50.67 |
| 轉存金融機構 | 181,550,035,673 | 18.93 |
| 短期票券 | 41,987,571,956 | 4.38 |
| 公債、金融債券、公司債及證券化商品 | 58,620,455,977 | 6.11 |
| 股票及受益憑證投資(含期貨) | 90,395,870,445 | 9.42 |
| 國外投資 | 113,405,200,513 | 11.83 |
| 固定收益 | 59,978,002,462 | 6.26 |
| 權益證券 | 37,575,213,780 | 3.92 |
| 另類投資 | 15,851,984,271 | 1.65 |
| 委託經營 | 473,150,253,429 | 49.33 |
| 國內委託經營 | 100,849,839,162 | 10.51 |
| 國外委託經營 | 372,300,414,267 | 38.82 |
| 固定收益 | 104,194,468,782 | 10.86 |
| 權益證券 | 182,396,732,345 | 19.02 |
| 另類投資 | 85,709,213,140 | 8.94 |
| 合 計 | 959,109,387,993 | 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

111年2月28日

單位：新臺幣元

| 項 目 | 金 額 | 占基金運用比率 (%) |
|------|-------------------|-------------|
| 自行運用 | 1,326,070,194,507 | 40.92 |
| 委託經營 | 1,914,785,214,777 | 59.08 |

2. 舊制勞工退休基金

111年2月28日

單位：新臺幣元

| 項 目 | 金 額 | 占基金運用比率 (%) |
|------|-----------------|-------------|
| 自行運用 | 485,959,134,564 | 50.67 |
| 委託經營 | 473,150,253,429 | 49.33 |

(四)基金國內投資與國外投資比率

1. 新制勞工退休基金

111年2月28日

單位：新臺幣元

| 項 目 | 金 額 | 占基金運用比率(%) |
|------|-------------------|------------|
| 國內投資 | 1,534,316,758,880 | 47.35 |
| 國外投資 | 1,706,538,650,404 | 52.65 |

2. 舊制勞工退休基金

111年2月28日

單位：新臺幣元

| 項 目 | 金 額 | 占基金運用比率(%) |
|------|-----------------|------------|
| 國內投資 | 473,403,773,213 | 49.35 |
| 國外投資 | 485,705,614,780 | 50.65 |

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

111年截至2月底

| 項 目 | 收益率(%) |
|--------|--------|
| 國內權益證券 | -2.03 |

2. 舊制勞工退休基金

111年截至2月底

| 項 目 | 收益率(%) |
|--------|--------|
| 國內權益證券 | -2.49 |

(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

111年2月28日 單位：新臺幣元

| 項 目 | 金 額 | 比 率 (%) |
|--------|-----------------|---------|
| 國內權益證券 | 182,695,674,301 | 5.64 |

2. 舊制勞工退休基金

111年2月28日 單位：新臺幣元

| 項 目 | 金 額 | 比 率 (%) |
|--------|----------------|---------|
| 國內權益證券 | 90,395,870,445 | 9.42 |

四、基金國內委外投資概況表

(一)基金國內委外投資績效、績效指標及排名表

1. 新制勞工退休基金

96年第一次委託經營(續約4)

單位：新臺幣元

| 投信 名稱 | 委託金額 | 目前淨資產 | 111年截至2月 累積投資報酬 (%) | 委任迄今 (108.9.27~111.2.28) | | |
|----------|----------------|----------------|---------------------------|-----------------------------|------------|--------------|
| | | | | 投資報酬 率(%) | 委託經 營排名 | 目標報酬率 (%) |
| 野村 | 23,580,874,211 | 35,537,850,803 | -5.92 | 56.62 | — | 14.71 |

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

97 年第一次委託經營(續約 4)

單位：新臺幣元

| 投信名稱 | 委託金額 | 目前淨資產 | 111 年截至 2 月 累積投資報酬 (%) | 委任迄今 (109.1.20~111.2.28) | | |
|------|---------------|----------------|------------------------------|-----------------------------|------------|--------------|
| | | | | 投資報酬 率(%) | 委託經 營排名 | 目標 報酬率(%) |
| 野村 | 9,193,179,186 | 13,075,137,350 | -5.96 | 42.23 | — | 12.69 |

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

98 年第一次委託經營(續約 4)

單位：新臺幣元

| 投信名稱 | 委託金額 | 目前淨資產 | 111 年截至 2 月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (110.7.16~111.2.28) | | |
|------|----------------|----------------|--------------------------|-----------------------------|------------|--------------|
| | | | | 投資報酬 率(%) | 委託經 營排名 | 目標報酬率 (%) |
| 野村 | 19,093,323,980 | 20,131,176,386 | -6.08 | 5.44 | 1 | 3.63 |
| 保德信 | 6,277,574,114 | 6,033,235,250 | -3.76 | -3.89 | 2 | |
| 合計 | 25,370,898,094 | 26,164,411,636 | -5.56 | 3.13 | — | |

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 4 年年底股票集中市場平均殖利率加計 200 個基本點為基準。

99 年第二次委託經營(續約 2)

單位：新臺幣元

| 投信名稱 | 委託金額 | 目前淨資產 | 111 年截至 2 月 累積投資報酬 (%) | 委任迄今 (107.12.3~111.2.28) | | |
|------|---------------|----------------|------------------------------|-----------------------------|------------|--------------|
| | | | | 投資報酬 率(%) | 委託經 營排名 | 目標報酬率 (%) |
| 國泰 | 7,441,043,825 | 10,015,080,569 | 0.49 | 36.79 | — | 19.92 |

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

100 年第一次委託經營(續約 2)(相對報酬)

單位：新臺幣元

| 投信名稱 | 委託金額 | 目前淨資產 | 111 年截至 2 月 累積投資報酬 (%) | 委任迄今 (108.7.15~111.2.28) | | |
|------|----------------|----------------|------------------------------|-----------------------------|------------|--------------|
| | | | | 投資報酬 率(%) | 委託經 營排名 | 指標報酬率 (%) |
| 復華 | 11,295,508,988 | 26,420,366,671 | -2.69 | 81.27 | — | 80.55 |

註：本批次為相對報酬型，以臺灣就業 99 指數為指定指標。

101 年第一次委託經營(續約 2)(相對報酬)

單位：新臺幣元

| 投信名稱 | 委託金額 | 目前淨資產 | 111 年截至 2 月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (109.4.20~111.2.28) | | |
|------|----------------|----------------|--------------------------|-----------------------------|--------|----------|
| | | | | 投資報酬率(%) | 委託經營排名 | 指標報酬率(%) |
| 國泰 | 8,014,871,501 | 14,469,153,725 | -3.38 | 80.53 | 1 | 76.73 |
| 滙豐中華 | 10,927,481,593 | 19,002,284,991 | -2.68 | 73.89 | 2 | |
| 合計 | 18,942,353,094 | 33,471,438,716 | -2.98 | 76.70 | — | |

註：本批次為相對報酬型，以臺灣加權股價報酬指數為指定指標。

101 年第二次委託經營(續約 2)

單位：新臺幣元

| 投信名稱 | 委託金額 | 目前淨資產 | 111 年截至 2 月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (109.7.20~111.2.28) | | |
|------|----------------|----------------|--------------------------|-----------------------------|--------|----------|
| | | | | 投資報酬率(%) | 委託經營排名 | 目標報酬率(%) |
| 野村 | 9,057,257,704 | 12,403,468,830 | -5.94 | 36.95 | 1 | 9.60 |
| 統一 | 12,294,643,442 | 16,442,957,047 | -3.85 | 33.74 | 2 | |
| 合計 | 21,351,901,146 | 28,846,425,877 | -4.76 | 35.10 | — | |

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

102 年第二次委託經營(續約 2)(相對報酬)

單位：新臺幣元

| 投信名稱 | 委託金額 | 目前淨資產 | 111 年截至 2 月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (111.1.24~111.2.28) | | |
|------|----------------|----------------|--------------------------|-----------------------------|--------|----------|
| | | | | 投資報酬率(%) | 委託經營排名 | 指標報酬率(%) |
| 統一 | 14,437,134,744 | 14,447,305,762 | 0.07 | 0.07 | 1 | -1.37 |
| 復華 | 19,009,802,076 | 18,946,522,527 | -0.33 | -0.33 | 2 | |
| 合計 | 33,446,936,820 | 33,393,828,289 | -0.16 | -0.16 | — | |

註：本批次為相對報酬型，以臺灣加權股價報酬指數為指定指標。

103 年第一次委託經營第二期(續約)

單位：新臺幣元

| 投信名稱 | 委託金額 | 目前淨資產 | 111 年截至 2 月 累積投資報酬 (%) | 委任迄今 (107.10.8~111.2.28) | | |
|------|----------------|----------------|------------------------------|-----------------------------|------------|--------------|
| | | | | 投資報酬 率(%) | 委託經 營排名 | 目標報酬率 (%) |
| 台新 | 12,934,673,726 | 18,754,292,784 | -3.87 | 63.34 | — | 20.85 |

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

103 年第二次委託經營(續約)(相對報酬)

單位：新臺幣元

| 投信名稱 | 委託金額 | 目前淨資產 | 111 年截至 2 月 累積投資報酬 (%) | 委任迄今 (110.12.1~111.2.28) | | |
|------|----------------|----------------|------------------------------|-----------------------------|------------|--------------|
| | | | | 投資報酬 率(%) | 委託經 營排名 | 目標報酬率 (%) |
| 國泰 | 14,836,482,661 | 15,302,016,578 | -0.58 | 4.35 | 3 | 4.84 |
| 統一 | 11,353,734,691 | 11,781,976,666 | -0.98 | 3.77 | 5 | |
| 復華 | 10,890,868,617 | 11,427,423,458 | -0.40 | 4.93 | 1 | |
| 滙豐中華 | 10,790,827,015 | 11,265,584,529 | -0.71 | 4.40 | 2 | |
| 安聯 | 15,017,345,063 | 15,439,159,178 | -1.06 | 3.90 | 4 | |
| 合計 | 62,889,258,047 | 65,216,160,409 | -0.76 | 4.25 | — | |

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)

單位：新臺幣元

| 投信名稱 | 委託金額 | 目前淨資產 | 111 年截至 2 月 累積投資報酬 (%) | 委任迄今 (108.4.1~111.2.28) | | |
|------|---------------|---------------|------------------------------|----------------------------|------------|--------------|
| | | | | 投資報酬 率(%) | 委託經 營排名 | 目標報酬率 (%) |
| 復華 | 3,651,168,229 | 5,614,931,347 | -7.15 | 53.78 | 2 | 17.85 |
| 安聯 | 2,473,766,298 | 3,909,624,764 | -3.56 | 56.44 | 1 | |
| 合計 | 6,124,934,527 | 9,524,556,111 | -5.71 | 54.40 | — | |

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

106 年第一次委託經營

單位：新臺幣元

| 投信名稱 | 委託金額 | 目前淨資產 | 111 年截至 2 月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (107.2.7~111.2.28) | | |
|------|----------------|----------------|--------------------------|----------------------------|--------|----------|
| | | | | 投資報酬率(%) | 委託經營排名 | 目標報酬率(%) |
| 台新 | 4,500,000,000 | 6,781,295,274 | -4.47 | 44.47 | 4 | 24.78 |
| 安聯 | 7,500,000,000 | 12,212,842,341 | -3.88 | 86.86 | 1 | |
| 保德信 | 5,000,000,000 | 6,775,395,964 | -3.48 | 34.20 | 6 | |
| 國泰 | 4,500,000,000 | 6,193,709,447 | 0.56 | 36.63 | 5 | |
| 群益 | 4,750,000,000 | 6,902,680,337 | -5.11 | 46.16 | 3 | |
| 滙豐中華 | 5,000,000,000 | 7,326,440,568 | -0.42 | 48.09 | 2 | |
| 合計 | 31,250,000,000 | 46,192,363,931 | -2.99 | 49.61 | — | |

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

107 年第一次委託經營(相對報酬)

單位：新臺幣元

| 投信名稱 | 委託金額 | 目前淨資產 | 111 年截至 2 月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (107.10.24~111.2.28) | | |
|------|----------------|----------------|--------------------------|------------------------------|--------|----------|
| | | | | 投資報酬率(%) | 委託經營排名 | 指標報酬率(%) |
| 台新 | 6,000,000,000 | 10,259,789,600 | -3.10 | 102.40 | 5 | 107.16 |
| 安聯 | 6,000,000,000 | 10,824,067,223 | -2.73 | 113.68 | 2 | |
| 保德信 | 6,000,000,000 | 10,339,872,159 | -2.63 | 100.69 | 6 | |
| 統一 | 4,000,000,000 | 8,656,354,837 | -2.91 | 118.16 | 1 | |
| 國泰 | 6,000,000,000 | 10,615,993,651 | -2.63 | 107.06 | 3 | |
| 復華 | 4,000,000,000 | 8,337,170,686 | -2.53 | 105.70 | 4 | |
| 群益 | 2,500,000,000 | 6,425,323,744 | -2.43 | 97.84 | 7 | |
| 合計 | 34,500,000,000 | 65,458,571,900 | -2.72 | 106.41 | — | |

註：本批次為相對報酬型，以臺灣永續報酬指數為指定指標。

107 年第二次委託經營

單位：新臺幣元

| 投信名稱 | 委託金額 | 目前淨資產 | 111 年截至 2 月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (108.5.24~111.2.28) | | |
|------|----------------|----------------|--------------------------|-----------------------------|--------|----------|
| | | | | 投資報酬率(%) | 委託經營排名 | 目標報酬率(%) |
| 安聯 | 6,000,000,000 | 9,438,052,779 | -3.77 | 64.39 | 3 | 17.00 |
| 施羅德 | 6,000,000,000 | 9,128,201,047 | -5.63 | 57.47 | 5 | |
| 統一 | 6,000,000,000 | 9,528,720,606 | -3.27 | 65.23 | 2 | |
| 野村 | 11,000,000,000 | 16,428,612,936 | -5.91 | 78.59 | 1 | |
| 國泰 | 11,000,000,000 | 15,645,795,512 | -2.97 | 63.50 | 4 | |
| 復華 | 6,000,000,000 | 8,647,437,169 | -7.01 | 52.65 | 6 | |
| 合計 | 46,000,000,000 | 68,816,820,049 | -4.71 | 64.19 | — | |

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

109 年第一次委託經營

單位：新臺幣元

| 投信名稱 | 委託金額 | 目前淨資產 | 111 年截至 2 月 累積投資報酬 (%) | 委任迄今 (110.5.13~111.2.28) | | |
|------|----------------|----------------|------------------------------|-----------------------------|--------|----------|
| | | | | 投資報酬率(%) | 委託經營排名 | 目標報酬率(%) |
| 台新 | 8,000,000,000 | 8,431,279,009 | -1.92 | 5.39 | 4 | 4.74 |
| 安聯 | 8,000,000,000 | 8,479,314,417 | -2.75 | 5.99 | 3 | |
| 保德信 | 8,000,000,000 | 7,965,838,444 | -3.50 | -0.43 | 5 | |
| 國泰 | 8,000,000,000 | 8,911,057,352 | -4.01 | 11.39 | 1 | |
| 野村 | 8,000,000,000 | 8,866,716,379 | -4.99 | 10.83 | 2 | |
| 合計 | 40,000,000,000 | 42,654,205,601 | -3.47 | 6.64 | — | |

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

110 年第一次委託經營

單位：新臺幣元

| 投信名稱 | 委託金額 | 目前淨資產 | 111 年截至 2 月 累積投資報酬 (%) | 委任迄今 (110.12.15~111.2.28) | | |
|------|----------------|----------------|------------------------------|------------------------------|------------|--------------|
| | | | | 投資報酬 率(%) | 委託經 營排名 | 目標報酬率 (%) |
| 安聯 | 4,000,000,000 | 3,943,384,222 | -1.66 | -1.42 | 2 | 1.30 |
| 保德信 | 4,000,000,000 | 3,935,895,281 | -2.12 | -1.60 | 3 | |
| 國泰 | 4,000,000,000 | 3,977,396,242 | -1.41 | -0.57 | 1 | |
| 第一金 | 4,000,000,000 | 3,835,895,575 | -4.57 | -4.10 | 6 | |
| 野村 | 4,000,000,000 | 3,889,171,825 | -4.34 | -2.77 | 5 | |
| 富邦 | 4,000,000,000 | 3,905,516,565 | -3.14 | -2.36 | 4 | |
| 合計 | 24,000,000,000 | 23,487,259,710 | -2.88 | -2.14 | — | |

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

2. 舊制勞工退休基金

國內 98 年第二次委託經營(續約 4)

單位：新臺幣元

| 投信名稱 | 委託金額 | 目前淨資產 | 111 年截至 2 月 累積投資報酬率 (%) | 委任迄今 (111.1.28~111.2.28) | | |
|------|----------------|----------------|-------------------------------|-----------------------------|------------|--------------|
| | | | | 投資報酬 率(%) | 委託經 營排名 | 目標報酬率 (%) |
| 富邦 | 12,256,867,963 | 12,428,875,415 | 1.40 | 1.40 | 2 | 0.53 |
| 統一 | 10,364,185,361 | 10,586,530,803 | 2.15 | 2.15 | 1 | |
| 合計 | 22,621,053,324 | 23,015,406,218 | 1.74 | 1.74 | — | |

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 4 年年底股票集中市場平均殖利率加計 250 個基本點為基準。

國內 101 年第一次委託經營(相對報酬)(續約 2) 單位：新臺幣元

| 投信名稱 | 委託金額 | 目前淨資產 | 111 年截至 2 月 累積投資報酬率 (%) | 委任迄今 (109.11.2~111.2.28) | | |
|------|---------------|---------------|-------------------------------|-----------------------------|------------|--------------|
| | | | | 投資報酬 率(%) | 委託經 營排名 | 指標報酬率 (%) |
| 匯豐中華 | 5,685,000,000 | 8,166,430,831 | -2.60 | 43.65 | — | 44.81 |

註：本批次為相對報酬型，以臺灣加權股價報酬指數為指定指標。

國內 101 年第二次委託經營(續約 2) 單位：新臺幣元

| 投信名稱 | 委託金額 | 目前淨資產 | 111 年截至 2 月 累積投資報酬率 (%) | 委任迄今 (109.05.04~111.2.28) | | |
|------|----------------|----------------|-------------------------------|------------------------------|------------|--------------|
| | | | | 投資報酬 率(%) | 委託經營 排名 | 目標報酬率 (%) |
| 野村 | 19,272,822,959 | 30,028,105,516 | -5.87 | 55.81 | — | 10.91 |

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

國內 104 年第一次委託經營(續約) 單位：新臺幣元

| 投信名稱 | 委託金額 | 目前淨資產 | 111 年截至 2 月 累積投資報酬率 (%) | 委任迄今 (108.4.1~111.2.28) | | |
|------|---------------|---------------|-------------------------------|----------------------------|------------|--------------|
| | | | | 投資報酬 率(%) | 委託經 營排名 | 目標報酬率 (%) |
| 復華 | 3,651,419,951 | 5,615,698,186 | -7.15 | 53.79 | 2 | 17.85 |
| 安聯 | 2,474,008,140 | 3,910,238,895 | -3.55 | 56.45 | 1 | |
| 合計 | 6,125,428,091 | 9,525,937,081 | -5.71 | 54.41 | — | |

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

國內 106 年第一次委託經營

單位：新臺幣元

| 投信名稱 | 委託金額 | 目前淨資產 | 111 年截至 2 月 累積投資報酬率 (%) | 委任迄今 (107.2.7~111.2.28) | | |
|------|----------------|----------------|-------------------------------|----------------------------|------------|--------------|
| | | | | 投資報酬 率(%) | 委託經 營排名 | 目標報酬率 (%) |
| 台新 | 4,500,000,000 | 6,781,884,223 | -4.46 | 44.48 | 4 | 24.78 |
| 安聯 | 7,500,000,000 | 12,213,860,281 | -3.88 | 86.88 | 1 | |
| 保德信 | 5,000,000,000 | 6,776,107,545 | -3.48 | 34.21 | 6 | |
| 國泰 | 4,500,000,000 | 6,194,270,840 | 0.57 | 36.65 | 5 | |
| 群益 | 4,750,000,000 | 6,903,701,354 | -5.11 | 46.18 | 3 | |
| 匯豐中華 | 5,000,000,000 | 7,327,222,816 | -0.42 | 48.11 | 2 | |
| 合計 | 31,250,000,000 | 46,197,047,059 | -2.99 | 49.63 | — | |

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

(二) 111 年 2 月被提前收回之國內委外投資帳戶

1. 基金國內委外投資被提前收回帳戶經理人名單及收回原因

新制勞工退休基金：無

舊制勞工退休基金：無

2. 受託機構經管本基金帳戶被主管機關懲處之相關資訊

新制勞工退休基金：無

舊制勞工退休基金：無

五、基金國外委外投資概況表

(一) 基金國外委外投資績效、績效指標及排名表

1. 新制勞工退休基金

97-1 全球主動債券型 (續約 3)

單位：美元

| 受託機構 | 委託金額 | 目前淨資產 | 111年截至2月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (110.6.7~111.2.28) | | |
|-------------|---------------|---------------|-----------------------|----------------------------|----|----------|
| | | | | 投資報酬率(%) | 排名 | 指標報酬率(%) |
| 聯博 | 907,613,021 | 851,467,685 | -3.65 | -6.19 | 1 | -6.27 |
| 富蘭克林 坦伯頓 | 851,737,838 | 786,884,534 | -3.21 | -7.61 | 2 | |
| 合計 | 1,759,350,859 | 1,638,352,219 | -3.44 | -6.88 | — | |

97-2 全球增值債券型 (續約 3)

單位：美元

| 受託機構 | 委託金額 | 目前淨資產 | 111年截至2月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (111.1.6~111.2.28) | | |
|-------|---------------|---------------|-----------------------|----------------------------|----|----------|
| | | | | 投資報酬率(%) | 排名 | 指標報酬率(%) |
| PIMCO | 1,708,967,886 | 1,660,161,812 | -2.86 | -2.86 | — | -2.75 |

97-2 全球增值股票型 (續約 3)

單位：美元

| 受託機構 | 委託金額 | 目前淨資產 | 111年截至2月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (111.2.6~111.2.28) | | |
|------|---------------|---------------|-----------------------|----------------------------|----|----------|
| | | | | 投資報酬率(%) | 排名 | 指標報酬率(%) |
| 貝萊德 | 1,734,805,538 | 1,676,519,248 | -3.36 | -3.36 | 2 | -2.78 |
| 摩根 | 1,485,120,883 | 1,440,366,191 | -3.01 | -3.01 | 1 | |
| 合計 | 3,219,926,421 | 3,116,885,439 | -3.20 | -3.20 | — | |

98-1 亞太 (日本除外) 主動股票型 (續約 2)

單位：美元

| 受託機構 | 委託金額 | 目前淨資產 | 111年截至2月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (106.11.17~111.2.28) | | |
|------|-------------|-------------|-----------------------|------------------------------|----|----------|
| | | | | 投資報酬率(%) | 排名 | 指標報酬率(%) |
| 景順 | 602,621,073 | 733,433,317 | 0.94 | 26.02 | — | 18.78 |

98-1 全球被動股票型 (續約 2)

單位：美元

| 受託機構 | 委託金額 | 目前淨資產 | 111年截至2月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (106.12.4~111.2.28) | | |
|------|---------------|---------------|-----------------------|-----------------------------|----|----------|
| | | | | 投資報酬率(%) | 排名 | 指標報酬率(%) |
| 貝萊德 | 735,489,288 | 1,015,944,660 | -7.36 | 50.95 | 2 | 49.33 |
| 道富 | 928,826,441 | 1,309,331,135 | -7.38 | 51.18 | 1 | |
| 合計 | 1,664,315,729 | 2,325,275,795 | -7.37 | 51.08 | — | |

99-1 全球新興市場主動股票型 (續約 2)

單位：美元

| 受託機構 | 委託金額 | 目前淨資產 | 111年截至2月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (107.8.27~111.2.28) | | |
|------|-------------|-------------|-----------------------|-----------------------------|----|----------|
| | | | | 投資報酬率(%) | 排名 | 指標報酬率(%) |
| 瑞萬通博 | 657,229,489 | 752,830,041 | -5.09 | 11.69 | — | 21.79 |

100-1 全球基本面指數被動股票型 (續約 2)

單位：美元

| 受託機構 | 委託金額 | 目前淨資產 | 111年截至2月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (110.7.1~111.2.28) | | |
|------|---------------|---------------|-----------------------|----------------------------|----|----------|
| | | | | 投資報酬率(%) | 排名 | 指標報酬率(%) |
| 道富 | 934,565,605 | 950,252,350 | -2.62 | 1.68 | 2 | 1.68 |
| 貝萊德 | 939,726,931 | 956,340,855 | -2.36 | 1.77 | 1 | |
| 合計 | 1,874,292,536 | 1,906,593,205 | -2.49 | 1.72 | — | |

100-1 全球不動產有價證券型 (續約)

單位：美元

| 受託機構 | 委託金額 | 目前淨資產 | 111年截至2月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (106.3.6~111.2.28) | | |
|----------------|---------------|---------------|-----------------------|----------------------------|----|----------|
| | | | | 投資報酬率(%) | 排名 | 指標報酬率(%) |
| Cohen & Steers | 1,601,936,411 | 2,188,926,251 | -6.80 | 49.36 | 1 | 29.26 |
| 景順 | 1,164,104,927 | 1,484,451,360 | -7.96 | 29.72 | 2 | |
| 合計 | 2,766,041,338 | 3,673,377,611 | -7.27 | 40.08 | — | |

101-1 全球新興市場主動債券型 (續約)

單位：美元

| 受託機構 | 委託金額 | 目前淨資產 | 111年截至2月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (106.7.31~111.2.28) | | |
|---------|-------------|-------------|-----------------------|-----------------------------|----|----------|
| | | | | 投資報酬率(%) | 排名 | 指標報酬率(%) |
| Ashmore | 354,453,121 | 371,830,911 | -6.65 | 2.30 | 2 | 6.38 |
| Pictet | 534,291,634 | 569,823,800 | -5.61 | 9.43 | 1 | |
| 合計 | 888,744,755 | 941,654,711 | -6.02 | 5.88 | — | |

101-1 全球低波動指數被動股票型 (續約)

單位：美元

| 受託機構 | 委託金額 | 目前淨資產 | 111年截至2月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (107.4.18~111.2.28) | | |
|------|---------------|---------------|-----------------------|-----------------------------|----|----------|
| | | | | 投資報酬率(%) | 排名 | 指標報酬率(%) |
| 道富 | 798,231,848 | 960,288,406 | -4.77 | 20.47 | 2 | 20.05 |
| 貝萊德 | 794,293,722 | 958,141,907 | -4.68 | 20.78 | 1 | |
| 合計 | 1,592,525,570 | 1,918,430,313 | -4.73 | 20.63 | — | |

102-1 全球高股利增值股票型 (續約)

單位：美元

| 受託機構 | 委託金額 | 目前淨資產 | 111年截至2月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (108.1.22~111.2.28) | | |
|------|---------------|---------------|-----------------------|-----------------------------|----|----------|
| | | | | 投資報酬率(%) | 排名 | 指標報酬率(%) |
| 瑞萬通博 | 1,056,315,337 | 1,492,863,240 | -8.46 | 53.66 | 1 | 34.96 |
| MFS | 603,318,800 | 823,561,606 | -1.35 | 36.51 | 3 | |
| 威靈頓 | 831,647,315 | 1,171,019,246 | -3.22 | 46.80 | 2 | |
| 合計 | 2,491,281,452 | 3,487,444,092 | -5.12 | 46.09 | — | |

102-1 全球信用主動債券型 (續約)

單位：美元

| 受託機構 | 委託金額 | 目前淨資產 | 111年截至2月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (108.4.25~111.2.28) | | |
|---------|---------------|---------------|-----------------------|-----------------------------|----|----------|
| | | | | 投資報酬率(%) | 排名 | 指標報酬率(%) |
| Bluebay | 586,338,464 | 672,334,618 | -4.57 | 16.18 | 1 | 7.59 |
| 貝萊德 | 687,231,657 | 723,331,801 | -5.18 | 8.29 | 3 | |
| 盧米斯 | 692,703,100 | 744,819,599 | -5.04 | 10.71 | 2 | |
| 合計 | 1,966,273,221 | 2,140,486,018 | -4.94 | 11.55 | — | |

104-1 全球高品質被動股票型 (續約)

單位：美元

| 受託機構 | 委託金額 | 目前淨資產 | 111年截至2月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (109.8.11~111.2.28) | | |
|-------|---------------|---------------|-----------------------|-----------------------------|----|----------|
| | | | | 投資報酬率(%) | 排名 | 指標報酬率(%) |
| 北美信託 | 1,596,617,127 | 1,912,482,640 | -11.04 | 24.26 | 2 | 23.85 |
| LGIM | 1,605,083,447 | 1,916,374,568 | -11.05 | 23.96 | 3 | |
| Geode | 1,575,075,832 | 1,892,252,041 | -11.07 | 24.34 | 1 | |
| 合計 | 4,776,776,406 | 5,721,109,249 | -11.05 | 24.19 | — | |

104-2 全球基礎建設有價證券型 (續約)

單位：美元

| 受託機構 | 委託金額 | 目前淨資產 | 111年截至2月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (109.9.25~111.2.28) | | |
|----------|---------------|---------------|-----------------------|-----------------------------|----|----------|
| | | | | 投資報酬率(%) | 排名 | 指標報酬率(%) |
| Magellan | 1,437,520,518 | 1,670,863,603 | -4.46 | 16.23 | 2 | 26.52 |
| RREEF | 926,848,763 | 1,179,242,479 | -3.28 | 27.23 | 1 | |
| 合計 | 2,364,369,281 | 2,850,106,082 | -3.98 | 20.54 | — | |

104-1 全球主權信用增值債券型 (續約)

單位：美元

| 受託機構 | 委託金額 | 目前淨資產 | 111年截至2月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (109.11.13~111.2.28) | | |
|------------|---------------|-------------|-----------------------|------------------------------|----|----------|
| | | | | 投資報酬率(%) | 排名 | 指標報酬率(%) |
| Brandywine | 641,176,083 | 609,252,489 | -5.21 | -4.98 | 1 | -9.09 |
| 盧米斯 | 371,104,127 | 341,418,308 | -3.60 | -8.00 | 2 | |
| 合計 | 1,012,280,210 | 950,670,797 | -4.64 | -6.09 | — | |

105-1 全球多元資產型 (續約)

單位：美元

| 受託機構 | 委託金額 | 目前淨資產 | 111年截至2月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (110.7.20~111.2.28) | | |
|---------|---------------|---------------|-----------------------|-----------------------------|----|-----------------|
| | | | | 投資報酬率(%) | 排名 | 指標/目標 報酬率(%) |
| Allianz | 478,698,278 | 485,672,156 | -3.83 | 1.46 | 1 | 0.05/3.12 |
| 摩根 | 1,645,715,430 | 1,613,293,975 | -6.22 | -1.97 | 3 | |
| DWS | 925,711,371 | 911,415,213 | -2.95 | -1.54 | 2 | |
| 柏瑞 | 765,326,657 | 738,181,895 | -5.37 | -3.55 | 4 | |
| 合計 | 3,815,451,736 | 3,748,563,239 | -4.97 | -1.75 | — | |

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

105-1 亞太混合指數增值股票型 (續約)

單位：美元

| 受託機構 | 委託金額 | 目前淨資產 | 111年截至2月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (110.8.24~111.2.28) | | |
|------|-------------|-------------|-----------------------|-----------------------------|----|----------|
| | | | | 投資報酬率(%) | 排名 | 指標報酬率(%) |
| 貝萊德 | 949,175,052 | 920,346,052 | -3.93 | -3.04 | — | -2.94 |

106-1 全球 ESG 混合指數被動股票型

單位：美元

| 受託機構 | 委託金額 | 目前淨資產 | 111 年截至 2 月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (106.6.22~111.2.28) | | |
|------|---------------|---------------|--------------------------|-----------------------------|----|----------|
| | | | | 投資報酬率(%) | 排名 | 指標報酬率(%) |
| 貝萊德 | 400,000,000 | 551,285,914 | -6.53 | 56.83 | 4 | 56.57 |
| DWS | 470,000,000 | 640,236,582 | -6.59 | 57.34 | 3 | |
| 道富 | 470,000,000 | 640,428,606 | -6.51 | 57.45 | 2 | |
| 北美信託 | 470,000,000 | 642,145,677 | -6.54 | 57.87 | 1 | |
| 合計 | 1,810,000,000 | 2,474,096,779 | -6.54 | 57.39 | — | |

106-1 絕對報酬債券型

單位：美元

| 受託機構 | 委託金額 | 目前淨資產 | 111 年截至 2 月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (106.7.25~111.2.28) | | |
|------------------|---------------|---------------|--------------------------|-----------------------------|----|-----------------|
| | | | | 投資報酬率(%) | 排名 | 指標/目標 報酬率(%) |
| American Century | 400,000,000 | 441,427,790 | -1.90 | 10.51 | 3 | 4.92/16.43 |
| 富達 | 1,000,000,000 | 1,074,241,773 | -5.21 | 10.97 | 2 | |
| 富蘭克林 坦伯頓 | 400,000,000 | 423,638,041 | -1.20 | 6.50 | 4 | |
| TCW | 900,000,000 | 974,969,731 | -1.71 | 13.32 | 1 | |
| 合計 | 2,700,000,000 | 2,914,277,335 | -2.99 | 10.44 | — | |

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

107-1 絕對報酬股票型

單位：美元

| 受託機構 | 委託金額 | 目前淨資產 | 111年截至2月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (108.1.23~111.2.28) | | |
|--------|---------------|---------------|-----------------------|-----------------------------|----|-----------------|
| | | | | 投資報酬率(%) | 排名 | 指標/目標 報酬率(%) |
| Nomura | 300,000,000 | 302,794,838 | -1.16 | 4.77 | 5 | 3.02/18.55 |
| 景順 | 480,000,000 | 634,867,872 | -3.76 | 42.31 | 1 | |
| 威靈頓 | 600,000,000 | 722,632,697 | -3.61 | 30.57 | 3 | |
| CPR | 480,000,000 | 623,598,028 | -5.23 | 38.11 | 2 | |
| 道富 | 500,000,000 | 588,328,012 | -5.90 | 21.98 | 4 | |
| 合計 | 2,360,000,000 | 2,872,221,447 | -4.23 | 27.14 | — | |

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

108-1 全球新興市場動態多元因子指數增值股票型

單位：美元

| 受託機構 | 委託金額 | 目前淨資產 | 111年截至2月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (108.12.18~111.2.28) | | |
|--------|---------------|---------------|-----------------------|------------------------------|----|----------|
| | | | | 投資報酬率(%) | 排名 | 指標報酬率(%) |
| Amundi | 400,000,000 | 450,262,905 | -3.36 | 3.39 | 4 | 5.90 |
| DWS | 400,000,000 | 435,107,188 | -2.28 | 2.13 | 5 | |
| Nomura | 400,000,000 | 468,546,656 | -3.15 | 8.19 | 1 | |
| 荷寶 | 300,000,000 | 360,839,627 | -2.00 | 5.64 | 3 | |
| 道富 | 300,000,000 | 364,919,089 | -5.57 | 5.99 | 2 | |
| 合計 | 1,800,000,000 | 2,079,675,465 | -3.25 | 4.99 | — | |

109-1 全球美元公司增值債券型

單位：美元

| 受託機構 | 委託金額 | 目前淨資產 | 111年截至2月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (110.1.13~111.2.28) | | |
|---------|---------------|---------------|-----------------------|-----------------------------|----|----------|
| | | | | 投資報酬率(%) | 排名 | 指標報酬率(%) |
| DWS | 400,000,000 | 386,356,588 | -4.85 | -5.21 | 4 | -4.52 |
| INSIGHT | 400,000,000 | 386,523,630 | -4.86 | -4.95 | 1 | |
| 摩根 | 400,000,000 | 386,807,889 | -4.86 | -5.19 | 3 | |
| PIMCO | 400,000,000 | 386,458,115 | -4.99 | -5.17 | 2 | |
| WESTERN | 400,000,000 | 384,007,315 | -5.27 | -5.53 | 5 | |
| 合計 | 2,000,000,000 | 1,930,153,537 | -4.96 | -5.21 | — | |

110-1 全球基礎建設有價證券型

單位：美元

| 受託機構 | 委託金額 | 目前淨資產 | 111年截至2月 累積投資報酬(%) | 委任迄今 (110.9.8~111.2.28) | | |
|-------------|---------------|---------------|-----------------------|----------------------------|----|----------|
| | | | | 投資報酬率(%) | 排名 | 指標報酬率(%) |
| CBRE | 250,000,000 | 249,493,629 | -2.65 | -0.31 | 2 | -0.32 |
| Clearbridge | 250,000,000 | 259,307,033 | 0.03 | 4.31 | 1 | |
| Magellan | 250,000,000 | 249,747,603 | -2.96 | -1.20 | 3 | |
| RREEF | 250,000,000 | 247,247,668 | -4.27 | -1.62 | 4 | |
| 合計 | 1,000,000,000 | 1,005,795,933 | -2.46 | 0.29 | — | |

110-1 全球多元資產型

單位：美元

| 受託機構 | 委託金額 | 目前淨資產 | 111年截至2月 累積投資報酬 (%) | 委任迄今 (110.10.15~111.2.28) | | |
|---------------|---------------|---------------|---------------------------|------------------------------|----|-----------------|
| | | | | 投資報酬率(%) | 排名 | 指標/目標 報酬率(%) |
| 富達 | 400,000,000 | 384,411,280 | -5.80 | -4.29 | 4 | 0.04/1.92 |
| 摩根 | 400,000,000 | 384,077,854 | -5.82 | -4.15 | 3 | |
| Ninety One | 400,000,000 | 393,779,793 | -1.63 | -2.08 | 1 | |
| Schroders | 400,000,000 | 385,443,472 | -5.17 | -4.04 | 2 | |
| T. Rowe Price | 400,000,000 | 381,459,331 | -5.75 | -5.76 | 5 | |
| 合計 | 2,000,000,000 | 1,929,171,730 | -4.85 | -4.06 | — | |

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。

2. 舊制勞工退休基金

96 國際平衡型(續約 3)

單位：美元

| 受託機構 | 委託金額 | 目前淨資產 | 111年截至2月 累積投資報酬率 (%) | 委任迄今 (108.6.24~111.2.28) | | |
|------|-------------|-------------|----------------------------|-----------------------------|----|------------------|
| | | | | 投資報酬率(%) | 排名 | 指標 報酬率 (%) |
| 富達 | 786,579,222 | 965,653,299 | -4.62 | 20.08 | — | 24.64 |

97-1 全球增值債券型(續約 3)

單位：美元

| 受託機構 | 委託金額 | 目前淨資產 | 111年截至2月 累積投資報酬率 (%) | 委任迄今 (111.1.6~111.2.28) | | |
|-------|---------------|---------------|----------------------------|----------------------------|----|------------------|
| | | | | 投資報酬率(%) | 排名 | 指標 報酬率 (%) |
| PIMCO | 1,003,724,736 | 974,609,940 | -2.90 | -2.90 | 2 | -2.75 |
| 盧米斯 | 948,693,762 | 924,115,975 | -2.59 | -2.59 | 1 | |
| 合計 | 1,952,418,498 | 1,898,725,915 | -2.75 | -2.75 | — | |

97-1 全球增值股票型(續約 3)

單位：美元

| 受託機構 | 委託金額 | 目前淨資產 | 111 年截至 2 月 累積投資報酬 (%) | 委任迄今 (111.2.6~111.2.28) | | |
|------|---------------|---------------|------------------------------|----------------------------|----|------------------|
| | | | | 投資 報酬率 (%) | 排名 | 指標 報酬率 (%) |
| 貝萊德 | 1,156,987,544 | 1,118,215,278 | -3.35 | -3.35 | — | -2.78 |

98-1 亞太(日本除外)主動股票型(續約 2)

單位：美元

| 受託機構 | 委託金額 | 目前淨資產 | 111 年截至 2 月 累積投資報酬 (%) | 委任迄今 (106.11.17~111.2.28) | | |
|------|-------------|-------------|------------------------------|------------------------------|----|--------------|
| | | | | 投資 報酬率 (%) | 排名 | 指標 報酬率(%) |
| 景順 | 307,323,526 | 372,433,619 | 0.95 | 26.09 | — | 18.78 |

100-1 全球基本面指數被動股票型(續約)

單位：美元

| 受託機構 | 委託金額 | 目前淨資產 | 111 年截至 2 月 累積投資報酬率 (%) | 委任迄今 (106.3.6~111.2.28) | | |
|--------|---------------|---------------|-------------------------------|----------------------------|----|------------------|
| | | | | 投資 報酬率 (%) | 排名 | 指標 報酬率 (%) |
| 貝萊德 | 255,588,950 | 414,207,526 | -2.56 | 54.90 | 4 | 53.56 |
| 道富 | 258,539,391 | 420,660,359 | -2.57 | 55.42 | 2 | |
| 瑞銀 | 256,994,133 | 417,592,743 | -2.37 | 55.17 | 3 | |
| Nomura | 257,549,840 | 421,281,019 | -2.53 | 55.98 | 1 | |
| 合計 | 1,028,672,314 | 1,673,741,647 | -2.51 | 55.37 | — | |

101-1 全球低波動指數被動股票型(續約)

單位：美元

| 受託機構 | 委託金額 | 目前淨資產 | 111年截至2月 累積投資報酬率 (%) | 委任迄今 (107.6.13~111.2.28) | | |
|------|-------------|-------------|----------------------------|-----------------------------|----|------------------|
| | | | | 投資 報酬率 (%) | 排名 | 指標 報酬率 (%) |
| 貝萊德 | 671,455,711 | 808,653,557 | -4.70 | 20.43 | — | 20.11 |

102-1 年全球高股利增值股票型(續約)

單位：美元

| 受託機構 | 委託金額 | 目前淨資產 | 111年截至2月 累積投資報酬率 (%) | 委任迄今 (108.1.22~111.2.28) | | |
|------|---------------|---------------|----------------------------|-----------------------------|----|--------------|
| | | | | 投資 報酬率 (%) | 排名 | 指標 報酬率(%) |
| 瑞萬通博 | 287,169,673 | 442,323,957 | -8.45 | 54.03 | 1 | 34.97 |
| MFS | 246,618,331 | 337,009,554 | -1.35 | 36.65 | 3 | |
| 威靈頓 | 503,548,464 | 739,632,528 | -3.22 | 46.88 | 2 | |
| 合計 | 1,037,336,468 | 1,518,966,039 | -4.41 | 46.43 | — | |

102-2 全球基礎建設有價證券型(續約)

單位：美元

| 受託機構 | 委託金額 | 目前淨資產 | 111年截至2月 累積投資報酬率 (%) | 委任迄今 (108.5.29~111.2.28) | | |
|--------|-------------|-------------|----------------------------|-----------------------------|----|------------------|
| | | | | 投資 報酬率 (%) | 排名 | 指標 報酬率 (%) |
| Lazard | 713,987,040 | 869,157,082 | -3.02 | 22.66 | — | 19.18 |

102-2 全球不動產有價證券型 (續約)

單位：美元

| 受託機構 | 委託金額 | 目前淨資產 | 111年截至2月 累積投資報酬率 (%) | 委任迄今 (108.8.27~111.2.28) | | |
|----------|-------------|-------------|----------------------------|-----------------------------|----|--------------|
| | | | | 投資 報酬率(%) | 排名 | 指標 報酬率(%) |
| 信安 環球 | 610,886,182 | 725,094,547 | -8.80 | 14.82 | 2 | 10.86 |
| AMP | 126,937,100 | 153,455,727 | -9.37 | 20.89 | 1 | |
| 合計 | 737,823,282 | 878,550,274 | -8.90 | 15.92 | — | |

105-1 全球多元資產型 (續約)

單位：美元

| 受託機構 | 委託金額 | 目前淨資產 | 111年截至2月 累積投資報酬率 (%) | 委任迄今 (110.7.20~111.2.28) | | |
|---------|---------------|---------------|----------------------------|-----------------------------|----|-----------------|
| | | | | 投資 報酬率 (%) | 排名 | 指標/目標 報酬率(%) |
| Allianz | 155,447,975 | 157,764,964 | -3.82 | 1.49 | 1 | 0.05/3.12 |
| 摩根 | 594,592,070 | 583,183,837 | -6.10 | -1.92 | 3 | |
| DWS | 311,387,682 | 306,570,692 | -2.96 | -1.55 | 2 | |
| 柏瑞 | 254,823,294 | 245,747,802 | -5.38 | -3.56 | 4 | |
| 合計 | 1,316,251,021 | 1,293,267,295 | -4.96 | -1.75 | — | |

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

106-1 全球 ESG 混合指數被動股票型

單位：美元

| 受託機構 | 委託金額 | 目前淨資產 | 111年截至2月 累積投資報酬率 (%) | 委任迄今 (106.6.22~111.2.28) | | |
|------|-------------|-------------|----------------------------|-----------------------------|----|------------------|
| | | | | 投資 報酬率 (%) | 排名 | 指標 報酬率 (%) |
| 貝萊德 | 150,000,000 | 222,124,424 | -6.50 | 56.51 | 4 | 56.57 |
| DWS | 150,000,000 | 223,365,663 | -6.58 | 57.53 | 3 | |
| 道富 | 150,000,000 | 223,525,433 | -6.48 | 57.56 | 2 | |
| 北美信託 | 150,000,000 | 223,647,993 | -6.53 | 57.57 | 1 | |
| 合計 | 600,000,000 | 892,663,513 | -6.52 | 57.29 | — | |

106-1 絕對報酬債券型

單位:美元

| 受託機構 | 委託金額 | 目前淨資產 | 111年截至2月 累積投資報酬率 (%) | 委任迄今 (106.7.25~111.2.28) | | |
|------------------|---------------|---------------|----------------------------|-----------------------------|----|-----------------|
| | | | | 投資報酬率(%) | 排名 | 指標/目標 報酬率(%) |
| American Century | 300,000,000 | 330,084,537 | -1.94 | 10.55 | 3 | 4.91/16.42 |
| 富達 | 300,000,000 | 334,577,893 | -5.02 | 11.24 | 2 | |
| 富蘭克林 坦伯頓 | 300,000,000 | 314,852,005 | -1.23 | 6.53 | 4 | |
| TCW | 300,000,000 | 340,661,408 | -1.72 | 15.41 | 1 | |
| 合計 | 1,200,000,000 | 1,320,175,843 | -2.52 | 10.95 | — | |

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 個基點為基準。

107-1 絕對報酬股票型

單位:美元

| 受託機構 | 委託金額 | 目前淨資產 | 111年截至2月 累積投資報酬率 (%) | 委任迄今 (108.1.23~111.2.28) | | |
|--------|-------------|-------------|----------------------------|-----------------------------|----|-----------------|
| | | | | 投資報酬率(%) | 排名 | 指標/目標 報酬率(%) |
| Nomura | 40,000,000 | 36,373,006 | -1.21 | 4.72 | 5 | 3.03/18.55 |
| 景順 | 80,000,000 | 109,657,248 | -3.81 | 41.46 | 1 | |
| 威靈頓 | 80,000,000 | 98,590,980 | -3.60 | 30.65 | 3 | |
| CPR | 80,000,000 | 108,107,124 | -5.24 | 38.25 | 2 | |
| 道富 | 80,000,000 | 92,223,054 | -5.90 | 21.77 | 4 | |
| 合計 | 360,000,000 | 444,951,412 | -4.35 | 28.05 | — | |

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

110-1 全球基礎建設有價證券型

單位:美元

| 受託機構 | 委託金額 | 目前淨資產 | 111年截至2月 累積投資報酬率 (%) | 委任迄今 (110.9.8~111.2.28) | | |
|-------------|-------------|-------------|----------------------------|----------------------------|----|-----------------|
| | | | | 投資報酬率(%) | 排名 | 指標/目標 報酬率(%) |
| CBRE | 30,000,000 | 29,893,035 | -2.66 | -0.36 | 2 | -0.32 |
| ClearBridge | 30,000,000 | 31,394,136 | 0.03 | 4.65 | 1 | |
| Magellan | 30,000,000 | 29,722,259 | -2.96 | -0.93 | 3 | |
| RREEF | 30,000,000 | 29,577,157 | -4.20 | -1.41 | 4 | |
| 合計 | 120,000,000 | 120,586,587 | -2.44 | 0.49 | — | |

(二)111 年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)

111 年 2 月 28 日

1. 避險：

| 種類 | 避險比率 |
|--------|-------|
| 權益證券避險 | 0% |
| 匯率避險 | 3.87% |

2. 投資：無

(二)舊制勞工退休基金自營部位

(依交易目的)

111 年 2 月 28 日

1. 避險：

| 種類 | 避險比率 |
|--------|------|
| 權益證券避險 | 0% |
| 匯率避險 | 0% |

2. 投資：無

七、勞工退休基金財務收支表

(一)新制勞工退休基金

單位：新臺幣元

| | 餘絀 | 收入 | 支出 |
|---------|-----------------|----------------|----------------|
| 111年2月份 | -26,247,886,522 | 39,099,546,126 | 65,347,432,648 |

(二)舊制勞工退休基金

單位：新臺幣元

| | 餘絀 | 收入 | 支出 |
|---------|----------------|---------------|----------------|
| 111年2月份 | -6,834,893,425 | 7,515,127,524 | 14,350,020,949 |

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

111年2月份

單位：新臺幣元

| 項 目 | 金 額 |
|---------|-----------------|
| 現金收入 | 256,649,661,814 |
| 現金支出 | 242,394,259,991 |
| 現金增(減)數 | 14,255,401,823 |

(二)舊制勞工退休基金

111年2月份

單位：新臺幣元

| 項 目 | 金 額 |
|---------|----------------|
| 現金收入 | 18,226,155,252 |
| 現金支出 | 18,233,296,091 |
| 現金增(減)數 | -7,140,839 |