

# 勞工退休基金運用情形

## 一、勞工退休基金整體績效

### (一) 本年度迄今(106年4月)績效

基金別	收益率	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
新制基金	1.16%	1.12%	6.68%	8.57%	2.91%
舊制基金	1.19%				

註：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。

### (二) 近一年(105年)績效

基金別	收益率	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
新制基金	3.23%	0.86%	10.98%	7.86%	2.09%
舊制基金	4.17%				

### (三) 近三年(103~105年)績效

基金別	收益率	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
新制基金	3.01%	1.29%	2.43%	3.13%	-0.19%
舊制基金	3.60%				

### (四) 近五年(101~105年)績效

基金別	收益率	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
新制基金	3.72%	1.30%	5.52%	9.36%	0.21%
舊制基金	4.34%				

## 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

至 106 年 4 月底止基金規模與收益			
基金運用規模		1 兆 7,193 億 8,755 萬元	
106 年截至 4 月底止 運用總損益及評價後報酬率	自行運用	國內固定收益	17 億 8,795 萬元 1.08%
		國內權益證券 及國外投資	-40 億 52 萬元 -1.49%
	委託經營		218 億 9,682 萬元 2.35%
	合 計		196 億 8,425 萬元 1.16%

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：評價後報酬率係以當期報酬率（即收益÷106 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。

註 3：106 年 4 月之保證收益率為 1.0541%。

#### 2. 舊制勞工退休基金

至 106 年 4 月底止基金規模與收益			
基金運用規模		8,377 億 6,039 萬元	
106 年截至 4 月底止 運用總損益及評價後報酬率	自行運用	國內固定收益	9 億 1,364 萬元 0.97%
		國內權益證券 及國外投資	21 億 6,492 萬元 1.20%
	委託經營		60 億 7,735 萬元 1.72%
	合 計		91 億 5,591 萬元 1.19%

註：評價後報酬率係以當期報酬率（即收益÷106 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

截至 106 年 4 月底

單位：新台幣元

項 目	餘 額	占基金運用比例(%)
<b>自行運用</b>	<b>789,064,662,723</b>	<b>45.89</b>
轉存金融機構	289,057,309,658	16.81
短期票券	72,242,379,456	4.20
公債、公司債、金融債券及特別股	160,061,686,862	9.31
股票及受益憑證投資(含期貨)	62,443,335,827	3.63
國外投資	205,259,950,920	11.94
固定收益	158,103,271,695	9.20
權益證券	25,080,951,693	1.46
另類投資	22,075,727,532	1.28
<b>委託經營</b>	<b>930,322,883,817</b>	<b>54.11</b>
國內委託經營	244,152,915,550	14.20
國外委託經營	686,169,968,267	39.91
固定收益	172,426,818,760	10.03
權益證券	355,663,607,692	20.69
另類投資	158,079,541,815	9.19
<b>合 計</b>	<b>1,719,387,546,540</b>	<b>100.00</b>

## 2. 舊制勞工退休基金

截至 106 年 4 月底

單位：新台幣元

項 目	餘 額	占基金運用比例(%)
<b>自行運用</b>	<b>487,335,353,457</b>	<b>58.17</b>
轉存金融機構	165,346,102,782	19.74
短期票券	44,950,368,664	5.37
公債、金融債券、公司債及證券化商品	104,235,814,295	12.44
股票及受益憑證投資(含期貨)	63,608,880,470	7.59
國外投資	109,194,187,246	13.03
固定收益	59,984,542,177	7.16
權益證券	37,223,307,436	4.44
另類投資	11,986,337,633	1.43
<b>委託經營</b>	<b>350,425,031,885</b>	<b>41.83</b>
國內委託經營	110,456,849,095	13.19
國外委託經營	239,968,182,790	28.64
固定收益	61,689,371,137	7.36
權益證券	134,931,705,381	16.11
另類投資	43,347,106,272	5.17
<b>合 計</b>	<b>837,760,385,342</b>	<b>100.00</b>

### (三)基金自營投資與委外投資比例

#### 1. 新制勞工退休基金

截至 106 年 4 月底

單位：新台幣元

項 目	金 額	占基金運用比例(%)
自行運用	789,064,662,723	45.89
委託經營	930,322,883,817	54.11

#### 2. 舊制勞工退休基金

截至 106 年 4 月底

單位：新台幣元

項 目	金 額	占基金運用比例(%)
自行運用	487,335,353,457	58.17
委託經營	350,425,031,885	41.83

## (四)基金國內投資與國外投資比例

### 1. 新制勞工退休基金

截至 106 年 4 月底

單位：新台幣元

項 目	金 額	占基金運用比例 (%)
國內投資	827,957,627,353	48.15
國外投資	891,429,919,187	51.85

### 2. 舊制勞工退休基金

截至 106 年 4 月底

單位：新台幣元

項 目	金 額	占基金運用比例 (%)
國內投資	488,598,015,306	58.33
國外投資	349,162,370,036	41.67

## 三、基金自營投資概況

### (一)基金自營投資績效 (國內權益證券)

#### 1. 新制勞工退休基金

截至 106 年 4 月底

項 目	收益率 (%)
國內權益證券	5.06

#### 2. 舊制勞工退休基金

截至 106 年 4 月底

項 目	收益率 (%)
國內權益證券	5.76

## (二)基金自營股票及受益憑證投資比例概況

### 1. 新制勞工退休基金

截至 106 年 4 月底

單位：新台幣元

項 目	金 額	比 例 (%)
國內權益證券	62,443,335,827	3.63

### 2. 舊制勞工退休基金

截至 106 年 4 月底

單位：新台幣元

項 目	金 額	比 例 (%)
國內權益證券	63,608,880,470	7.59

## 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 3)

單位：新台幣元

投信 名稱	委託金額	目前淨資產	106 年截至 4 月 累積投資報酬 (%)	委任迄今 (105.9.27~106.4.30)		
				投資 報酬率 (%)	委託經 營排名	大盤 報酬率 (%)
野村	15,000,000,000	15,574,475,655	5.57	3.83	—	7.37

## 97 年第一次委託經營 (續約 3)

單位：新台幣元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	106 年截至 4 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (106.1.20~106.4.30)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤 報酬率(%)
野村	7,198,313,969	7,510,420,946	4.34	4.34	—	5.94

## 98 年第一次委託經營 (續約 2)

單位：新台幣元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	106 年截至 4 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (104.7.14~106.4.30)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤 報酬率(%)
野村	10,576,888,916	11,297,538,120	5.88	6.81	2	9.28
保德信	4,365,128,502	4,692,259,542	4.18	7.49	1	
合計	14,942,017,418	15,989,797,662	5.38	7.01	—	

## 99 年第二次委託經營 (續約)

單位：新台幣元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	106 年截至 4 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (103.12.1~106.4.30)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤 報酬率(%)
國泰	6,366,621,977	7,393,428,433	5.23	16.13	—	7.45

## 100 年第一次委託經營(續約)(相對報酬)

單位：新台幣元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	106 年截至 4 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (104.7.15~106.4.30)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤/指標 報酬率(%)
復華	14,358,076,699	16,229,319,566	5.44	13.03	1	9.18/ 13.23
滙豐中華	15,278,501,877	17,003,619,387	4.84	11.29	2	
合計	29,636,578,576	33,232,938,953	5.13	12.13	—	

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

## 100 年第二次委託經營(續約)

單位：新台幣元

投信 名稱	委託金額	目前淨資產	106 年截至 4 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (104.8.10~106.4.30)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤 報酬率(%)
復華	17,101,520,990	18,592,015,400	5.15	8.72	—	16.94

## 101 年第一次委託經營(續約) (相對報酬)

單位：新台幣元

投信 名稱	委託金額	目前淨資產	106 年截至 4 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (105.4.18~106.4.30)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤/指標 報酬率(%)
國泰	5,387,135,656	6,363,654,816	6.46	18.13	1	13.47/ 18.18
滙豐中華	10,927,481,593	12,838,773,419	5.91	17.49	2	
合計	16,314,617,249	19,202,428,235	6.09	17.70	—	

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

## 101 年第二次委託經營(續約)

單位：新台幣元

投信 名稱	委託金額	目前淨資產	106 年截至 4 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (105.7.18~106.4.30)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤 報酬率(%)
野村	6,850,998,495	7,288,430,454	5.84	6.38	2	10.30
統一	7,019,680,328	7,716,166,020	6.97	9.92	1	
合計	13,870,678,823	15,004,596,474	6.42	8.17	—	



## 102 年第一次委託經營第一期

單位：新台幣元

投信 名稱	委託金額	目前淨資產	106 年截至 4 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (102.6.7~106.4.30)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤 報酬率(%)
國泰	2,500,000,000	3,069,758,457	2.60	22.79	3	21.93
統一	2,500,000,000	3,089,899,452	5.77	23.60	2	
復華	2,500,000,000	3,192,469,584	5.51	27.70	1	
安聯	2,500,000,000	2,890,981,262	3.36	15.64	4	
合計	10,000,000,000	12,243,108,755	4.32	22.43	—	

## 102 年第一次委託經營第二期

單位：新台幣元

投信 名稱	委託金額	目前淨資產	106 年截至 4 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (102.11.22~106.4.30)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤 報酬率(%)
國泰	2,500,000,000	2,831,273,560	2.62	13.25	5	21.88
統一	2,500,000,000	2,880,903,799	5.71	15.24	2	
復華	2,500,000,000	3,118,775,395	5.51	24.75	1	
安聯	2,500,000,000	2,858,086,009	3.63	14.32	4	
摩根	2,500,000,000	2,873,496,335	4.48	14.94	3	
合計	12,500,000,000	14,562,535,098	4.40	16.50	—	

## 102 年第二次委託經營(相對報酬)

單位：新台幣元

投信 名稱	委託金額	目前淨資產	106 年截至 4 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (103.1.20~106.4.30)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤/指標 報酬率(%)
保德信	5,000,000,000	5,863,274,047	5.33	22.81	4	14.84/ 28.15
統一	5,000,000,000	5,945,692,258	6.43	24.39	3	
復華	5,000,000,000	6,409,920,074	8.49	36.19	1	
群益	5,000,000,000	5,689,069,927	4.97	21.41	5	
滙豐中華	5,000,000,000	6,101,084,887	6.01	27.92	2	
合計	25,000,000,000	30,009,041,193	6.28	26.56	—	

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

## 103 年第一次委託經營第一期

單位：新台幣元

投信 名稱	委託金額	目前淨資產	106 年截至 4 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (103.8.11~106.4.30)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤 報酬率(%)
國泰	7,000,000,000	7,682,267,379	3.30	9.75	1	8.65
統一	7,000,000,000	7,079,768,331	5.31	1.14	3	
復華	7,000,000,000	7,323,203,390	6.49	4.62	2	
合計	21,000,000,000	22,085,239,100	4.99	5.17	—	

## 103 年第一次委託經營第二期

單位：新台幣元

投信 名稱	委託金額	目前淨資產	106 年截至 4 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (103.10.8~106.4.30)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤 報酬率(%)
台新	7,000,000,000	7,666,955,770	5.25	9.53	1	9.19
保德信	7,000,000,000	7,404,141,811	2.68	5.77	2	
群益	7,000,000,000	7,290,005,178	4.92	4.14	3	
合計	21,000,000,000	22,361,102,759	4.28	6.48	—	

## 104 年第一次委託經營第一期

單位：新台幣元

投信 名稱	委託金額	目前淨資產	106 年截至 4 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (104. 3. 31~106. 4. 30)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤 報酬率(%)
永豐	2,500,000,000	2,568,048,094	4.51	2.72	5	3.68
國泰	2,500,000,000	2,599,033,308	3.70	3.96	3	
統一	2,500,000,000	2,655,674,211	5.45	6.23	2	
復華	2,500,000,000	2,575,084,475	7.62	3.00	4	
滙豐中華	2,500,000,000	2,704,051,478	4.43	8.16	1	
安聯	2,500,000,000	2,527,945,792	3.71	1.12	6	
合計	15,000,000,000	15,629,837,358	4.89	4.20	—	

## 104 年第一次委託經營第二期

單位：新台幣元

投信 名稱	委託金額	目前淨資產	106 年截至 4 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (105. 12. 28~106. 4. 30)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤 報酬率(%)
永豐	2,500,000,000	2,515,951,042	0.62	0.64	6	8.37
國泰	2,500,000,000	2,535,349,453	1.39	1.41	5	
統一	2,500,000,000	2,589,389,269	3.50	3.58	2	
復華	2,500,000,000	2,671,428,179	6.82	6.86	1	
滙豐中華	2,500,000,000	2,564,968,716	2.54	2.60	3	
安聯	2,500,000,000	2,558,368,002	2.26	2.33	4	
合計	15,000,000,000	15,435,454,661	2.85	2.90	—	

## 2. 舊制勞工退休基金

### 國內 98 年第二次委託經營(續約 2)

單位：新台幣元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	106 年截至 4 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (105.1.26~106.4.30)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤 報酬率(%)
富邦	4,927,262,338	5,335,112,427	3.34	8.28	2	25.05
統一	5,071,927,246	5,723,447,771	5.51	12.85	1	
合計	9,999,189,584	11,058,560,198	4.45	10.59	—	

### 國內 100 年第一次委託經營(續約)

單位：新台幣元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	106 年截至 4 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (104.3.17~106.4.30)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤 報酬率(%)
群益	3,094,525,480	2,866,791,188	4.53	-2.96	3	3.77
復華	6,134,978,456	6,353,739,657	5.08	3.57	1	
統一	6,511,946,664	6,594,702,114	5.62	1.27	2	
合計	15,741,450,600	15,815,232,959	5.04	0.60	—	

### 國內 101 年第一次委託經營(相對報酬)(續約)

單位：新台幣元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	106 年截至 4 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (105.10.31~106.4.30)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤/指標 報酬率(%)
匯豐中華	5,684,367,652	5,952,087,514	5.59	4.71	—	6.07/6.08

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

國內 101 年第二次委託經營(續約)

單位：新台幣元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	106 年截至 4 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (105.5.3~106.4.30)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤 報酬率(%)
野村	16,650,814,154	18,871,464,858	6.29	13.34	—	17.83

國內 102 年第一次委託經營第一期

單位：新台幣元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	106 年截至 4 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (102.6.7~106.4.30)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤 報酬率(%)
安聯	2,500,000,000	2,891,345,116	3.36	15.65	4	21.93
復華	5,000,000,000	5,885,922,706	5.26	27.58	1	
國泰	2,500,000,000	3,070,121,737	2.60	22.80	3	
統一	2,500,000,000	3,090,315,773	5.77	23.61	2	
合計	12,500,000,000	14,937,705,332	4.44	22.48	—	

國內 102 年第一次委託經營第二期

單位：新台幣元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	106 年截至 4 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (102.11.22~106.4.30)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤 報酬率(%)
安聯	2,500,000,000	2,858,428,156	3.63	14.34	4	21.88
復華	5,000,000,000	5,810,979,527	5.24	24.64	1	
國泰	2,500,000,000	2,831,561,028	2.62	13.26	5	
摩根	2,500,000,000	2,873,879,097	4.48	14.96	3	
統一	2,500,000,000	2,881,262,364	5.71	15.25	2	
合計	15,000,000,000	17,256,110,172	4.48	16.34	—	

### 國內 102 年第一次委託經營 A 帳戶

單位：新台幣元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	106 年截至 4 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (104.3.16~106.4.30)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤 報酬率(%)
統一	5,118,273,278	5,139,916,571	5.51	0.42	-	3.06

### 國內 104 年第一次委託經營第一期

單位：新台幣元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	106 年截至 4 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (104.3.31~106.4.30)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤 報酬率(%)
永豐	2,500,000,000	2,568,203,669	4.51	2.73	5	3.68
國泰	2,500,000,000	2,599,178,001	3.70	3.97	3	
統一	2,500,000,000	2,655,845,758	5.45	6.23	2	
復華	2,500,000,000	2,575,198,956	7.62	3.01	4	
匯豐中華	2,500,000,000	2,704,251,004	4.43	8.17	1	
安聯	2,500,000,000	2,528,105,611	3.71	1.12	6	
合計	15,000,000,000	15,630,782,999	4.89	4.21	-	

### 國內 104 年第一次委託經營第二期

單位：新台幣元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	106 年截至 4 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (105.12.28~106.4.30)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤 報酬率(%)
永豐	2,500,000,000	2,515,972,845	0.62	0.64	6	8.37
國泰	2,500,000,000	2,535,364,544	1.39	1.41	5	
統一	2,500,000,000	2,589,415,213	3.50	3.58	2	
復華	2,500,000,000	2,671,457,159	6.82	6.86	1	
匯豐中華	2,500,000,000	2,564,996,020	2.54	2.60	3	
安聯	2,500,000,000	2,558,395,637	2.26	2.34	4	
合計	15,000,000,000	15,435,601,418	2.86	2.90	-	

## (二) 106 年 4 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：

投信名稱	收回日期	收回委託金額	經理人	收回理由
100-1 群益	106.4.24	30 億元	謝 ○ ○	委託經營投資契約第 23 條第 4 項第 5 款規定，收回部份委託資產

### 2. 受託機構經管本基金帳戶被主管機關懲處之相關資訊

新制勞工退休基金：無

舊制勞工退休基金：無

## 五、基金國外委外投資概況表

### (一) 基金國外委外投資績效、績效指標及排名表

#### 1. 新制勞工退休基金

##### 97-1 全球主動債券型 (續約 2)

單位：美元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	106 年截至 4 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (105.6.6~106.4.30)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
聯博	793,101,125	781,611,688	3.35	-1.45	1	-2.39
坦伯頓	744,405,663	730,364,896	1.86	-1.89	2	
合計	1,537,506,788	1,511,976,584	2.63	-1.66	—	

### 97-2 全球增值債券型 (續約 2)

單位：美元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	106 年截至 4 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (106.1.6~106.4.30)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
太平洋	819,586,290	844,239,625	3.01	3.01	—	2.48

### 97-2 全球增值股票型 (續約 2)

單位：美元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	106 年截至 4 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (106.2.6~106.4.30)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
貝萊德	967,348,593	1,028,186,097	6.29	6.29	1	4.86
摩根	802,177,668	841,819,847	4.94	4.94	2	
合計	1,769,526,261	1,870,005,944	5.68	5.68	—	

### 98-1 亞太 (日本除外) 主動股票型 (續約)

單位：美元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	106 年截至 4 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (102.11.18~106.4.30)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
景順	571,501,358	672,362,514	15.70	20.01	—	13.43

### 98-1 全球被動股票型 (續約)

單位：美元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	106 年截至 4 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (102.12.2~106.4.30)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
貝萊德	399,329,552	477,118,363	8.71	22.39	1	21.16
道富	549,680,272	649,530,165	8.54	22.00	2	
合計	949,009,824	1,126,648,528	8.61	22.16	—	



### 99-1 全球新興市場主動股票型 (續約)

單位：美元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	106年截至4月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (103.8.25~106.4.30)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
摩根士丹利	403,049,882	384,060,843	15.13	-4.71	2	-3.92
瑞萬通博	716,993,858	715,314,881	15.78	-0.23	1	
合計	1,120,043,740	1,099,375,724	15.55	-1.85	—	

### 100-1 全球基本面指數被動股票型 (續約)

單位：美元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	106年截至4月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (105.7.1~106.4.30)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
道富	562,180,574	668,259,798	6.63	18.87	2	18.86
貝萊德	566,301,910	673,262,404	6.56	18.89	1	
合計	1,128,482,484	1,341,522,202	6.59	18.88	—	

### 100-1 全球不動產有價證券型 (續約)

單位：美元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	106年截至4月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (106.3.6~106.4.30)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
Cohen & Steers	951,936,411	967,022,175	1.58	1.58	1	1.46
景順	984,104,927	997,465,125	1.36	1.36	2	
合計	1,936,041,338	1,964,487,300	1.47	1.47	—	

### 101-1 全球新興市場主動債券型

單位：美元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	106年截至4月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (101.7.31~106.4.30)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
Ashmore	300,000,000	292,406,584	5.32	0.66	1	2.07
Bluebay	300,000,000	277,272,630	4.79	-5.57	4	
實港	300,000,000	280,593,246	6.23	-4.70	3	
Pictet	300,000,000	293,525,360	4.93	-0.25	2	
合計	1,200,000,000	1,143,797,820	5.31	-2.47	—	

### 101-1 全球低波動指數被動股票型

單位：美元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	106年截至4月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (102.4.18~106.4.30)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
道富	500,000,000	613,599,242	8.21	22.44	1	20.90
貝萊德	500,000,000	610,472,018	8.27	21.79	2	
合計	1,000,000,000	1,224,071,260	8.24	22.11	—	

### 102-1 全球高股利增值股票型

單位：美元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	106年截至4月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (103.1.22~106.4.30)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
瑞萬通博	500,000,000	662,967,763	13.95	36.39	1	13.59
MFS	500,000,000	557,242,368	7.64	15.29	3	
威靈頓	500,000,000	579,811,400	8.56	20.55	2	
合計	1,500,000,000	1,800,021,531	10.19	24.11	—	

### 102-1 全球信用主動債券型

單位：美元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	106年截至4月 累積投資報酬率(%)	委任迄今 (103.4.25~106.4.30)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
Bluebay	400,000,000	407,326,851	3.40	2.08	3	2.46
貝萊德	400,000,000	407,811,959	2.85	2.15	2	
盧米斯	400,000,000	412,860,111	3.15	3.43	1	
合計	1,200,000,000	1,227,998,921	3.13	2.55	—	

### 104-1 全球高品質被動股票型

單位：美元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	106年截至4月 累積投資報酬率(%)	委任迄今 (104.8.11~106.4.30)		
				投資 報酬率(%)	排名	大盤/指標 報酬率(%)
北美信託	650,000,000	754,956,607	11.13	15.00	1	14.74
LGIM	650,000,000	755,035,564	11.09	14.82	2	
Geode	650,000,000	752,848,333	10.93	14.54	3	
合計	1,950,000,000	2,262,840,504	11.05	14.79	—	

### 104-2 全球基礎建設有價證券型

單位：美元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	106年截至4月 累積投資報酬率(%)	委任迄今 (104.9.25~106.4.30)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
Cohen & Steers	350,000,000	401,383,417	10.01	14.52	4	19.06
麥格理	350,000,000	405,830,329	9.61	17.96	3	
Magellan	350,000,000	394,437,380	11.33	21.07	1	
RREEF	350,000,000	398,106,606	9.11	18.08	2	
合計	1,400,000,000	1,599,757,732	10.00	17.98	—	

### 104-1 全球主權信用增值債券型

單位：美元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	106年截至4月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (104.11.13~106.4.30)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
NNIP	300,000,000	307,485,389	6.00	6.97	3	7.06
Brandywine	300,000,000	318,549,051	6.72	11.16	1	
盧米斯	300,000,000	313,038,668	5.76	7.24	2	
合計	900,000,000	939,073,108	6.24	8.52	—	

### 105-1 全球多元資產型

單位：美元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	106年截至4月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (105.7.20~106.4.30)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
安聯	450,000,000	462,003,216	3.06	3.07	4	0.75
摩根	450,000,000	474,604,586	4.56	5.80	1	
德意志	450,000,000	471,577,158	3.87	4.81	2	
柏瑞	450,000,000	468,621,516	5.03	4.25	3	
合計	1,800,000,000	1,876,806,476	4.13	4.48	—	

### 105-1 亞太混合指數增值股票型

單位：美元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	106年截至4月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (105.8.24~106.4.30)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
貝萊德	500,000,000	524,553,961	10.90	6.68	2	6.64
北美信託	500,000,000	522,763,820	10.76	6.19	3	
領航	500,000,000	528,924,850	11.45	9.32	1	
合計	1,500,000,000	1,576,242,631	11.04	7.40	—	

## 2. 舊制勞工退休基金

### 96年續約2國外委託經營(平衡型)

單位：美元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	106年截至4月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (104.6.22~106.4.30)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
富達國際	783,555,210	828,948,768	4.88	7.03	-	8.49

### 97年續約2國外委託經營(全球增值債券型)

單位：美元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	106年截至4月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (106.1.6~106.4.30)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
太平洋	923,576,760	951,279,703	3.00	3.00	1	2.48
盧米斯	698,763,197	717,850,601	2.73	2.73	2	
合計	1,622,339,957	1,669,130,304	2.88	2.88	-	

### 97年續約2國外委託經營(全球增值股票型)

單位：美元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	106年截至4月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (106.2.6~106.4.30)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
貝萊德	756,337,413	804,055,508	6.31	6.31	-	4.86

### 98年續約國外委託經營(亞太股票型)

單位：美元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	106年截至4月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (102.11.17~106.4.30)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
景順	362,187,756	426,417,833	15.33	20.13	-	13.43

### 100 年續約國外委託經營(全球基本面指數股票型)

單位：美元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	106 年截至 4 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (106.3.6~106.4.30)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
貝萊德	405,588,950	411,234,098	1.39	1.39	4	1.40
道富	408,539,391	414,345,250	1.42	1.42	3	
瑞銀	406,994,133	412,797,241	1.43	1.43	2	
野村	407,549,840	414,090,935	1.61	1.61	1	
合計	1,628,672,314	1,652,467,524	1.46	1.46	—	

### 101 年國外委託經營(全球低波動指數股票型)

單位：美元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	106 年截至 4 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (102.6.13~106.4.30)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
貝萊德	500,000,000	591,882,411	8.13	26.24	—	25.23

### 102 年國外委託經營(全球高股利增值股票型)

單位：美元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	106 年截至 4 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (103.1.22~106.4.30)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
瑞萬通博	150,000,000	203,192,965	13.95	36.45	1	13.59
MFS	200,000,000	227,215,178	7.62	15.03	3	
威靈頓	400,000,000	462,073,075	8.57	20.47	2	
合計	750,000,000	892,481,218	9.50	23.59	—	

### 102 年國外委託經營(全球基礎建設有價證券型)

單位：美元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	106 年截至 4 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (103.5.29~106.4.30)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
Lazard	300,000,000	367,601,596	14.87	26.58	1	7.38
Cohen & Steers	100,000,000	103,294,058	9.97	4.29	2	
合計	400,000,000	470,895,654	13.75	17.10	—	

### 102 年國外委託經營(全球不動產有價證券型)

單位：美元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	106 年截至 4 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (103.8.27~106.4.30)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
PGI	300,000,000	321,174,484	4.28	8.67	1	7.79
AMP	100,000,000	102,507,176	1.11	2.07	2	
合計	400,000,000	423,681,660	3.49	6.29	—	

### 105 年國外委託經營(全球多元資產型)

單位：美元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	106 年截至 4 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (105.7.20~106.4.30)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
安聯	150,000,000	153,979,848	3.06	3.06	4	0.75
摩根	150,000,000	158,214,035	4.58	5.80	1	
德意志	150,000,000	157,162,607	3.89	4.80	2	
柏瑞	150,000,000	156,233,863	5.04	4.27	3	
合計	600,000,000	625,590,353	4.14	4.48	—	

## (二)106年4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)

106年4月30日

#### 1. 避險：

種類	避險比例
權益證券避險	0%
匯率避險	5.30%

#### 2. 投資：無

### (二)舊制勞工退休基金自營部位

(依交易目的)

106年4月30日

#### 1. 避險：

種類	避險比例
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：新台幣元

	餘絀	收入	支出
106年4月	10,593,081,099	15,779,700,279	5,186,619,180

註：上述金額係依權責基礎填列。

### (二)舊制勞工退休基金

單位：新台幣元

	餘絀	收入	支出
106年4月	4,678,862,788	6,129,824,324	1,450,961,536

註：上述金額係依權責基礎填列。

## 八、勞工退休基金投資運用現金收支表

### (一)新制勞工退休基金

106年4月份

單位：新台幣元

項 目	金 額
基金收入	227,731,034,950
基金支出	232,864,591,761
現金增(減)數	-5,133,556,811

註：本表採現金基礎。

### (二)舊制勞工退休基金

106年4月份

單位：新台幣元

項 目	金 額
基金收入	56,060,736,523
基金支出	56,059,912,267
現金增(減)數	824,256

註：本表採現金基礎。