

# 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1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	0.01%	1.15%	2.10%	2.73%	1.13%
舊制基金	0.10%				

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 1 月底止基金規模與收益			
基金運用規模		1 兆 6,920 億 4,402 萬元	
106 年截至 1 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	4 億 9,196 萬元 1.20%
		國內權益證券 及國外投資	-20 億 9,060 萬元 -0.76%
	委託經營		18 億 650 萬元 0.19%
	合 計		2 億 786 萬元 0.01%

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 1 月之保證收益率為 1.0541%。

#### 2. 舊制勞工退休基金

至 106 年 1 月底止基金規模與收益			
基金運用規模		8,157 億 5,128 萬元	
106 年截至 1 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	2 億 3,175 萬元 1.00%
		國內權益證券 及國外投資	5 億 4,055 萬元 0.29%
	委託經營		-3,496 萬元 -0.01%
	合 計		7 億 3,734 萬元 0.10%

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 1 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>771,122,468,531</b>	<b>45.57</b>
轉存金融機構	271,961,671,707	16.07
短期票券	54,751,051,126	3.24
公債、公司債、金融債券及特別股	163,684,163,831	9.67
股票及受益憑證投資(含期貨)	65,123,452,429	3.85
國外投資	215,602,129,438	12.74
固定收益	164,475,034,145	9.72
權益證券	27,572,258,408	1.63
另類投資	23,554,836,885	1.39
<b>委託經營</b>	<b>920,921,556,191</b>	<b>54.43</b>
國內委託經營	247,811,851,313	14.65
國外委託經營	673,109,704,878	39.78
固定收益	171,661,868,784	10.14
權益證券	340,600,626,248	20.13
另類投資	160,847,209,846	9.51
<b>合 計</b>	<b>1,692,044,024,722</b>	<b>100.00</b>

## 2. 舊制勞工退休基金

截至 106 年 1 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>462,975,872,160</b>	<b>56.75</b>
轉存金融機構	147,314,183,693	18.06
短期票券	26,410,700,987	3.23
公債、金融債券、公司債及證券化商品	101,237,884,233	12.41
股票及受益憑證投資(含期貨)	79,604,540,356	9.76
國外投資	108,408,562,891	13.29
固定收益	57,613,981,215	7.06
權益證券	37,281,113,764	4.57
另類投資	13,513,467,912	1.66
<b>委託經營</b>	<b>352,775,412,181</b>	<b>43.25</b>
國內委託經營	112,761,260,249	13.83
國外委託經營	240,014,151,932	29.42
固定收益	63,824,698,914	7.82
權益證券	131,570,126,281	16.13
另類投資	44,619,326,737	5.47
<b>合 計</b>	<b>815,751,284,341</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 1 月底

單位：新台幣元

項 目	金 額	占基金運用比例(%)
自行運用	771,122,468,531	45.57
委託經營	920,921,556,191	54.43

#### 2. 舊制勞工退休基金

截至 106 年 1 月底

單位：新台幣元

項 目	金 額	占基金運用比例(%)
自行運用	462,975,872,160	56.75
委託經營	352,775,412,181	43.25

## (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 1 月底

單位：新台幣元

項 目	金 額	占基金運用比例 (%)
國內投資	803,332,190,406	47.48
國外投資	888,711,834,316	52.52

### 2. 舊制勞工退休基金

截至 106 年 1 月底

單位：新台幣元

項 目	金 額	占基金運用比例 (%)
國內投資	467,328,569,518	57.29
國外投資	348,422,714,823	42.71

## 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 1 月底

項 目	收益率 (%)
國內權益證券	1.60

#### 2. 舊制勞工退休基金

截至 106 年 1 月底

項 目	收益率 (%)
國內權益證券	1.57

## (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 1 月底 單位：新台幣元

項 目	金 額	比 例 (%)
國內權益證券	65,123,452,429	3.85

### 2. 舊制勞工退休基金

截至 106 年 1 月底 單位：新台幣元

項 目	金 額	比 例 (%)
國內權益證券	79,604,540,356	9.76

## 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 1 月 累積投資報酬 (%)	委任迄今 (105.9.27~106.1.31)		
				投資 報酬率 (%)	委託經 營排名	大盤 報酬率 (%)
野村	15,000,000,000	15,083,083,142	2.24	0.55	—	2.76

## 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 1 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (106.1.20~106.1.31)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤 報酬率(%)
野村	7,198,313,969	7,259,342,467	0.85	0.85	—	1.39

## 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 1 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (104.7.14~106.1.31)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤 報酬率(%)
野村	10,576,888,916	10,912,738,245	2.28	3.18	2	4.58
保德信	4,365,128,502	4,593,033,449	1.98	5.22	1	
合計	14,942,017,418	15,505,771,694	2.19	3.77	—	

## 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 1 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (103.12.1~106.1.31)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤 報酬率(%)
國泰	6,366,621,977	7,211,800,291	2.65	13.28	—	2.84

## 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 1 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (104.7.15~106.1.31)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤/指標 報酬率(%)
復華	14,358,076,699	15,645,281,641	1.65	8.97	1	4.49/ 9.40
滙豐中華	15,278,501,877	16,481,902,851	1.62	7.88	2	
合計	29,636,578,576	32,127,184,492	1.64	8.40	—	

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 1 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (104.8.10~106.1.31)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤 報酬率(%)
復華	17,101,520,990	18,008,199,029	1.85	5.30	—	11.91

## 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 1 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (105.4.18~106.1.31)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤/指標 報酬率(%)
國泰	5,387,135,656	6,110,730,386	2.23	13.43	1	8.59/ 13.10
滙豐中華	10,927,481,593	12,383,474,485	2.15	13.32	2	
合計	16,314,617,249	18,494,204,871	2.18	13.36	—	

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 1 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (105.7.18~106.1.31)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤 報酬率(%)
野村	6,850,998,495	7,042,353,316	2.27	2.79	2	5.57
統一	7,019,680,328	7,373,073,647	2.21	5.03	1	
合計	13,870,678,823	14,415,426,963	2.24	3.93	—	



## 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 1 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (102.6.7~106.1.31)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤 報酬率(%)
國泰	2,500,000,000	3,033,668,454	1.39	21.35	2	16.70
統一	2,500,000,000	2,977,372,926	1.92	19.09	3	
復華	2,500,000,000	3,072,716,544	1.56	22.91	1	
安聯	2,500,000,000	2,834,829,358	1.36	13.39	4	
合計	10,000,000,000	11,918,587,282	1.56	19.19	—	

## 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 1 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (102.11.22~106.1.31)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤 報酬率(%)
國泰	2,500,000,000	2,797,351,070	1.39	11.89	3	16.65
統一	2,500,000,000	2,776,190,065	1.87	11.05	5	
復華	2,500,000,000	3,001,737,868	1.55	20.07	1	
安聯	2,500,000,000	2,798,534,137	1.47	11.94	2	
摩根	2,500,000,000	2,787,167,621	1.34	11.49	4	
合計	12,500,000,000	14,160,980,761	1.52	13.29	—	

## 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 1 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (103.1.20~106.1.31)		
				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	5,661,950,378	1.72	18.60	4	9.91/ 22.65
統一	5,000,000,000	5,709,742,361	2.20	19.46	3	
富邦	5,000,000,000	5,458,942,401	1.60	13.54	6	
復華	5,000,000,000	6,063,913,954	2.64	28.84	1	
群益	5,000,000,000	5,488,698,191	1.27	17.13	5	
滙豐中華	5,000,000,000	5,886,504,128	2.28	23.42	2	
合計	30,000,000,000	34,269,751,413	1.96	20.17	—	

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 1 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (103.8.11~106.1.31)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤 報酬率(%)
國泰	7,000,000,000	7,565,133,363	1.73	8.07	1	3.98
統一	7,000,000,000	6,846,284,728	1.84	-2.20	3	
復華	7,000,000,000	7,035,541,161	2.31	0.51	2	
合計	21,000,000,000	21,446,959,252	1.95	2.13	—	

## 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 1 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (103.10.8~106.1.31)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤 報酬率(%)
台新	7,000,000,000	7,435,172,304	2.07	6.22	1	4.50
保德信	7,000,000,000	7,311,158,634	1.39	4.45	2	
群益	7,000,000,000	7,047,546,632	1.43	0.68	3	
合計	21,000,000,000	21,793,877,570	1.63	3.78	—	

## 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 1 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (104.3.31~106.1.31)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤 報酬率(%)
永豐	2,500,000,000	2,498,857,872	1.70	-0.05	4	-0.78
國泰	2,500,000,000	2,548,080,486	1.67	1.92	3	
統一	2,500,000,000	2,563,232,847	1.78	2.53	2	
復華	2,500,000,000	2,448,263,269	2.32	-2.07	6	
滙豐中華	2,500,000,000	2,630,714,032	1.60	5.23	1	
安聯	2,500,000,000	2,476,808,715	1.61	-0.93	5	
合計	15,000,000,000	15,165,957,221	1.77	1.11	—	

## 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 1 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (105.12.28~106.1.31)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤 報酬率(%)
永豐	2,500,000,000	2,506,556,587	0.25	0.26	6	3.72
國泰	2,500,000,000	2,517,447,650	0.68	0.70	4	
統一	2,500,000,000	2,523,752,000	0.87	0.95	2	
復華	2,500,000,000	2,543,387,221	1.70	1.74	1	
滙豐中華	2,500,000,000	2,520,589,067	0.76	0.82	3	
安聯	2,500,000,000	2,513,885,004	0.48	0.56	5	
合計	15,000,000,000	15,125,617,529	0.79	0.84	—	

## 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 1 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (105.1.26~106.1.31)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤 報酬率(%)
富邦	4,927,262,338	5,229,282,324	1.29	6.13	2	19.68
統一	5,071,927,246	5,523,172,739	1.82	8.90	1	
合計	9,999,189,584	10,752,455,063	1.56	7.53	—	

### 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 1 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (104.3.17~106.1.31)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤 報酬率(%)
群益	6,094,525,480	5,749,203,777	1.61	-5.67	3	-0.68
復華	6,134,978,456	6,150,366,603	1.71	0.25	1	
統一	6,511,946,664	6,363,309,117	1.92	-2.28	2	
合計	18,741,450,600	18,262,879,497	1.75	-2.55	—	

### 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 1 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (105.10.31~106.1.31)		
				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	5,748,478,976	1.97	1.13	—	1.52/1.53

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 1 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (105.5.3~106.1.31)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤 報酬率(%)
野村	16,650,814,154	18,165,769,577	2.31	9.10	—	12.77

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 1 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (102.6.7~106.1.31)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤 報酬率(%)
安聯	2,500,000,000	2,835,165,981	1.36	13.41	4	16.70
復華	5,000,000,000	5,676,630,720	1.52	23.05	1	
國泰	2,500,000,000	3,034,003,302	1.39	21.36	2	
統一	2,500,000,000	2,977,759,349	1.92	19.11	3	
合計	12,500,000,000	14,523,559,352	1.54	19.08	—	

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 1 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (102.11.22~106.1.31)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤 報酬率(%)
安聯	2,500,000,000	2,798,849,865	1.47	11.95	2	16.65
復華	5,000,000,000	5,604,879,971	1.51	20.22	1	
國泰	2,500,000,000	2,797,616,495	1.39	11.90	3	
摩根	2,500,000,000	2,787,516,390	1.34	11.50	4	
統一	2,500,000,000	2,776,522,432	1.87	11.06	5	
合計	15,000,000,000	16,765,385,153	1.51	13.03	—	

### 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 1 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (104.3.16~106.1.31)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤 報酬率(%)
統一	5,118,273,278	4,960,747,124	1.83	-3.08	-	-1.37

### 國內 104 年第一次委託經營

單位：新台幣元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	106 年截至 1 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (104.3.31~106.1.31)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤 報酬率(%)
永豐	2,500,000,000	2,498,988,080	1.70	-0.04	4	-0.78
國泰	2,500,000,000	2,548,205,628	1.67	1.93	3	
統一	2,500,000,000	2,563,376,897	1.78	2.54	2	
復華	2,500,000,000	2,448,356,772	2.32	-2.07	6	
匯豐中華	2,500,000,000	2,630,885,628	1.60	5.24	1	
安聯	2,500,000,000	2,476,945,393	1.61	-0.92	5	
合計	15,000,000,000	15,166,758,398	1.77	1.11	-	

### 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 1 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (105.12.28~106.1.31)		
				投資 報酬率(%)	委託經 營排名	大盤 報酬率(%)
永豐	2,500,000,000	2,506,560,169	0.25	0.26	6	3.72
國泰	2,500,000,000	2,517,450,347	0.68	0.70	4	
統一	2,500,000,000	2,523,755,779	0.87	0.95	2	
復華	2,500,000,000	2,543,393,140	1.70	1.74	1	
匯豐中華	2,500,000,000	2,520,594,350	0.76	0.82	3	
安聯	2,500,000,000	2,513,890,059	0.48	0.56	5	
合計	15,000,000,000	15,125,643,844	0.79	0.84	-	

## (二) 106 年 1 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 2)

單位：美元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	106 年截至 1 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (105.6.6~106.1.31)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
聯博	793,101,125	764,280,927	1.06	-3.63	2	-4.08
坦伯頓	744,405,663	717,953,741	0.13	-3.55	1	
合計	1,537,506,788	1,482,234,669	0.61	-3.59	—	

## 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 1 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (106.1.6~106.1.31)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
太平洋	819,586,290	827,278,145	0.94	0.94	—	0.71

## 97-2 全球增值股票型 (續約)

單位：美元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	106 年截至 1 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (102.2.5~106.1.31)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
貝萊德	784,277,868	960,842,474	3.22	39.74	1	32.71
摩根	587,857,352	795,405,427	2.73	35.31	2	
合計	1,372,135,220	1,756,247,901	2.99	36.93	—	

## 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 1 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (102.11.18~106.1.31)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
景順	571,501,358	625,796,168	7.68	11.70	—	4.73

## 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 1 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (102.12.2~106.1.31)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
貝萊德	399,329,552	451,164,877	2.79	15.74	1	14.64
道富	549,680,272	614,925,628	2.75	15.50	2	
合計	949,009,824	1,066,090,505	2.77	15.59	—	



### 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1月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (103.8.25~106.1.31)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
摩根士丹利	403,049,882	352,326,018	5.62	-12.59	2	-11.15
瑞萬通博	716,993,858	644,698,474	4.35	-10.08	1	
合計	1,120,043,740	997,024,493	4.79	-10.98	—	

### 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1月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (105.7.1~106.1.31)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
道富	562,180,574	643,435,048	2.67	14.46	2	14.56
貝萊德	566,301,910	648,548,272	2.65	14.52	1	
合計	1,128,482,484	1,291,983,320	2.66	14.49	—	

### 100-1 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1月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (101.3.6~106.1.31)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
Cohen & Steers	750,000,000	935,720,714	1.25	48.64	1	37.11
景順	800,000,000	965,443,722	0.90	40.98	2	
合計	1,550,000,000	1,901,164,436	1.07	44.44	—	

### 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1月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (101.7.31~106.1.31)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
Ashmore	300,000,000	282,389,582	1.71	-2.79	1	-1.62
Bluebay	300,000,000	268,417,882	1.44	-8.58	4	
實港	300,000,000	269,231,978	1.93	-8.56	3	
Pictet	300,000,000	284,062,536	1.55	-3.47	2	
合計	1,200,000,000	1,104,101,977	1.66	-5.85	—	

### 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1月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (102.4.18~106.1.31)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
道富	500,000,000	580,176,189	2.32	15.77	1	14.32
貝萊德	500,000,000	576,583,137	2.26	15.03	2	
合計	1,000,000,000	1,156,759,326	2.29	15.40	—	

### 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1月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (103.1.22~106.1.31)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
瑞萬通博	500,000,000	603,636,405	3.75	24.18	1	8.02
MFS	500,000,000	533,030,298	2.97	10.28	3	
威靈頓	500,000,000	546,164,100	2.26	13.55	2	
合計	1,500,000,000	1,682,830,802	3.02	16.03	—	

### 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1月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (103.4.25~106.1.31)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
Bluebay	400,000,000	398,881,623	1.26	-0.04	3	0.42
貝萊德	400,000,000	400,521,749	1.01	0.32	2	
盧米斯	400,000,000	403,595,178	0.84	1.11	1	
合計	1,200,000,000	1,202,998,550	1.03	0.46	—	

### 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1月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (104.8.11~106.1.31)		
				投資 報酬率(%)	排名	大盤/指標 報酬率(%)
北美信託	650,000,000	696,737,541	2.56	6.13	1	5.92
LGIM	650,000,000	696,925,125	2.54	5.99	2	
Geode	650,000,000	695,420,587	2.47	5.80	3	
合計	1,950,000,000	2,089,083,253	2.52	5.97	—	

### 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1月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (104.9.25~106.1.31)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
Cohen & Steers	350,000,000	371,055,871	1.70	5.87	4	10.46
麥格理	350,000,000	375,575,511	1.44	9.17	3	
Magellan	350,000,000	358,047,296	1.06	9.90	2	
RREEF	350,000,000	370,798,957	1.63	9.98	1	
合計	1,400,000,000	1,475,477,635	1.46	8.81	—	

### 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1月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (104.11.13~106.1.31)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
NNIP	100,000,000	103,178,680	2.24	3.18	3	3.58
Brandywine	300,000,000	305,458,188	2.33	6.59	1	
盧米斯	300,000,000	302,161,377	2.09	3.51	2	
合計	700,000,000	710,798,245	2.21	4.41	—	

### 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1月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (105.7.20~106.1.31)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標報酬率 (%)
安聯	450,000,000	451,515,567	0.72	0.73	3	0.48
摩根	450,000,000	456,430,338	0.56	1.75	1	
德意志	450,000,000	457,563,802	0.78	1.70	2	
柏瑞	450,000,000	451,912,453	1.29	0.53	4	
合計	1,800,000,000	1,817,422,160	0.84	1.18	—	

### 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1月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (105.8.24~106.1.31)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標報酬率 (%)
貝萊德	300,000,000	302,194,646	5.04	1.05	2	0.91
北美信託	300,000,000	298,974,807	4.24	-0.06	3	
領航	300,000,000	306,901,757	5.27	3.26	1	
合計	900,000,000	908,071,210	4.86	1.42	—	

## 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1月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (104.6.22~106.1.31)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
富達國際	783,555,210	793,947,871	0.45	2.51	-	4.34

### 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1月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (106.1.6~106.1.31)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
太平洋	923,576,760	932,115,519	0.92	0.92	1	0.71
盧米斯	698,763,197	704,849,953	0.87	0.87	2	
合計	1,622,339,957	1,636,965,472	0.90	0.90	—	

### 97年續約國外委託經營(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1月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (102.2.5~106.1.31)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
貝萊德	584,953,368	751,284,329	3.20	39.80	-	32.71

### 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1月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (102.11.17~106.1.31)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
景順	362,187,756	397,456,901	7.50	11.98	-	4.73

### 100 年國外委託經營(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 1 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (101.3.6~106.1.31)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
貝萊德	300,000,000	396,489,015	2.65	47.71	4	46.79
道富	300,000,000	399,283,053	2.62	49.03	1	
瑞銀	300,000,000	397,771,067	2.62	48.43	3	
野村	300,000,000	398,334,796	2.63	48.69	2	
合計	1,200,000,000	1,591,877,931	2.63	48.47	—	

### 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 1 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (102.6.13~106.1.31)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
貝萊德	500,000,000	559,587,482	2.23	19.35	—	18.43

### 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 1 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (103.1.22~106.1.31)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
瑞萬通博	150,000,000	185,019,981	3.76	24.25	1	8.02
MFS	200,000,000	217,368,644	2.95	10.04	3	
威靈頓	400,000,000	435,238,309	2.26	13.47	2	
合計	750,000,000	837,626,934	2.77	16.00	—	

### 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 1 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (103.5.29~106.1.31)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
Lazard	300,000,000	324,639,035	1.44	11.79	1	-0.38
Cohen & Steers	100,000,000	95,522,628	1.69	-3.55	2	
合計	400,000,000	420,161,663	1.50	4.48	—	

### 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 1 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (103.8.27~106.1.31)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
PGI	300,000,000	309,079,697	0.35	4.58	1	5.04
AMP	100,000,000	100,901,327	-0.47	0.47	2	
合計	400,000,000	409,981,024	0.15	2.85	—	

### 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 1 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (105.7.20~106.1.31)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標 報酬率(%)
安聯	150,000,000	150,486,972	0.72	0.73	3	0.48
摩根	150,000,000	152,126,045	0.55	1.73	1	
德意志	150,000,000	152,476,061	0.79	1.68	2	
柏瑞	150,000,000	150,654,177	1.29	0.55	4	
合計	600,000,000	605,743,255	0.84	1.77	—	

## (二)106年1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1月31日

#### 1. 避險：

種類	避險比例
權益證券避險	0%
匯率避險	5.24%

#### 2. 投資：無

### (二)舊制勞工退休基金自營部位

(依交易目的)

106年1月31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1月	259,686,650	26,719,461,090	26,459,774,440

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1月	737,337,301	10,691,834,246	9,954,496,945

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1月份

單位：新台幣元

項 目	金 額
基金收入	234,949,382,219
基金支出	227,777,955,476
現金增(減)數	7,171,426,743

註：本表採現金基礎。

### (二)舊制勞工退休基金

106年1月份

單位：新台幣元

項 目	金 額
基金收入	25,465,247,127
基金支出	25,465,997,258
現金增(減)數	-750,131

註：本表採現金基礎。