

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 (%)
自行運用	771,122,468,531	45.57
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
委託經營	920,921,556,191	54.43
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
合 計	1,692,044,024,722	100.00

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(%)
自行運用	462,975,872,160	56.75
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
委託經營	352,775,412,181	43.25
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
合 計	815,751,284,341	100.00

(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。