

## 勞工退休基金運用情形報告（102 年截至 2 月底止）

根據最近經濟數據顯示，全球三大經濟體景氣表現落差加劇，其中美國 1 月製造業指數，較上月上升 1.1 至 54.2，為近 1 年半來最高值；非製造業指數上升 0.8 至 56，失業率下降 0.2% 至 7.7%，達近 4 年最低值，展現強勢復甦。而歐元區製造業指數與上月持平為 47.9，服務業指數則較上個月下降 0.7 至 47.9，近期公布的 1 月失業率則上升 0.2% 至 11.9%，經濟情勢依然嚴峻；而中國 2 月製造業指數持續小幅下降 0.3 至 50.1，服務業指數則反轉下滑 1.7 至 54.5，擴張速度趨緩。

今年初全球股市在財報利多推升後，2 月呈現高檔震盪格局，然期間再因美國財政自動減支在即、義大利大選牽動歐債疑慮，以及美國 QE 政策可能提前退場等議題，使股市震盪加劇。2 月單月 MSCI 世界、新興市場及台股指數表現分別為 -0.01%、-0.98% 及 0.61%，累計今年表現則分別上漲 4.59%、0.54% 及 2.58%。

觀諸勞工退休基金截至 102 年 2 月底止，整體新、舊制基金規模為 1 兆 5,150 億 7,281 萬元，其中舊制基金規模為 5,928 億 9,701 萬元，新制基金規模為 9,221 億 7,580 萬元。102 年截至 2 月底，整體基金評價後收益數為 262 億 7,107 萬元，收益率為 1.7823%，新、舊制基金均優於法定最低保證收益率。

展望未來，美國聯準會 3 月 6 日公布之褐皮書顯示美國經濟持續擴張，雖存有財政改革壓力，然仍可維持溫和成長趨勢。歐洲央行 (ECB) 於 3 月 7 日指出，近期雖各項歐元區經濟指標仍處低點，然其中各細項指標已出現止穩跡象，金融市場系統性風險逐步降低，景氣可望於下半年好轉。亞洲部分，經濟合作發展組織 (OECD) 表示，儘管全球仍充滿不確定性，且中國、印度成長減緩，東南亞國協依然展現強韌

的經濟動能。而北韓威脅廢除朝鮮半島停戰協定，南韓與美國進行軍事演習，也造成東北亞情勢動盪。

目前各國政治、經濟前景分歧，勞退基金未來仍將密切掌握全球金融情勢，秉持長期投資策略，在既定之資產配置下，以多元布局分散投資風險，獲取長期穩健之基金收益。

## \* 基金整體績效

### 新制勞工退休基金 97 年 1 月迄今整體績效

截至 102 年 2 月底

收益率
1.93%

### 舊制勞工退休基金 75 年 9 月迄今整體績效

截至 102 年 2 月底

收益率
4.95%

## \* 基金運用概況表

### 新制勞工退休基金

#### 1. 基金規模與投資績效

單位：新台幣萬元；%

至 102 年 2 月底止基金規模與收益		
基金運用規模		9,221 億 7,580 萬元
102 年截至 2 月底止 運用總損益及評價後報酬率	自行運用	22 億 5,924 萬元 0.53%
	委託經營	144 億 9,809 萬元 3.08%
	合計	167 億 5,733 萬元 1.86%

註 1：評價後報酬率係以當期報酬率（即收益÷102 年之日平均餘額）列示。

註 2：102 年 2 月之保證收益率為 1.3916%。

## 資產配置

截至 102 年 2 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>440,639,500,753</b>	<b>47.79</b>
轉存金融機構	213,807,530,559	23.19
短期票券	48,929,279,516	5.31
公債、公司債及金融債券	93,171,027,446	10.10
貨幣型基金	10,113,231,710	1.10
股票及受益憑證投資(含期貨)	6,544,595,136	0.71
國外投資	68,073,836,386	7.38
固定收益	62,536,459,530	6.78
權益證券	3,479,327,793	0.38
另類投資	2,058,049,063	0.22
<b>委託經營</b>	<b>481,536,299,892</b>	<b>52.21</b>
國內委託經營	198,422,215,511	21.51
國外委託經營	283,114,084,381	30.70
固定收益	123,678,412,375	13.41
權益證券	124,329,502,728	13.48
另類投資	35,106,169,278	3.81
<b>合 計</b>	<b>922,175,800,645</b>	<b>100.00</b>

## 舊制勞工退休基金

### 1.基金規模與投資績效

單位：新台幣萬元

至 102 年 2 月底止基金規模與收益		
基金運用規模		5,928 億 9,701 萬元
102 年截至 2 月底止 運用總損益及評價後報酬率	自行運用	38 億 387 萬元 1.03%
	委託經營	57 億 987 萬元 2.79%
	合 計	95 億 1,374 萬元 1.66%

註：1.評價後報酬率係以當期報酬率(即收益÷102年之日平均餘額)列示

### 資產配置

#### 截至 102 年 2 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>399,359,827,357</b>	67.36
轉存金融機構	154,092,148,608	25.99
短期票券	51,357,802,685	8.66
公債、金融債券、公司債及證券化商品	60,263,500,150	10.17
貨幣型基金	20,600,836,015	3.47
股票及受益憑證投資(含期貨)	42,361,692,940	7.15
國外投資	70,683,846,959	11.92
固定收益類	47,774,101,574	8.06
權益證券	18,387,897,127	3.10
另類投資	4,521,848,258	0.76
<b>委託經營</b>	<b>193,537,180,527</b>	32.64
國內委託經營	96,696,685,243	16.31
國外委託經營	96,840,495,284	16.33
固定收益類	60,056,587,284	10.13
權益證券	36,783,908,000	6.20
合 計	<b>592,897,007,884</b>	100.00

## 2.基金自營投資與委外投資比例

### 新制勞工退休基金

截至102年2月底

單位：新台幣元；%

項 目	金 額	占基金運用比例(%)
自行運用	440,639,500,753	47.79
委託經營	481,536,299,892	52.21

### 舊制勞工退休基金

截至102年2月底

單位：新台幣元；%

項 目	金 額	占基金運用比例(%)
自行運用	399,359,827,357	67.36
委託經營	193,537,180,527	32.64

### 3.基金國內投資與國外投資比例

#### 新制勞工退休基金

截至102年2月底

單位：新台幣元；%

項 目	金 額	占基金運用比例(%)
國 內 投 資	570,987,879,878	61.92
國 外 投 資	351,187,920,767	38.08

#### 舊制勞工退休基金

截至102年2月底

單位：新台幣元；%

項 目	金 額	占基金運用比例(%)
國 內 投 資	425,372,665,641	71.75
國 外 投 資	167,524,342,243	28.25

## \* 基金自營投資概況

### 1. 基金自營投資績效 (股票)

#### 新制勞工退休基金

截至 102 年 2 月底

單位：%

項 目	收益率 (%)
國內權益證券 (ETF)	2.77

#### 舊制勞工退休基金

截至 102 年 2 月底

單位：%

項 目	收益率 (%)
國內權益證券	2.35



## 2.基金自營股票及受益憑證投資比例概況

### 新制勞工退休基金

截至 102 年 2 月底

單位：新台幣元；%

項 目	金 額	比 例 (%)
國內權益證券 (ETF)	6,544,595,136	0.71

### 舊制勞工退休基金

截至 102 年 2 月底

單位：新台幣元；%

項 目	金 額	比 例 (%)
國內權益證券	42,361,692,940	7.15

註：不含貨幣型基金

\*基金國內委外投資概況表

1.基金國內委外投資績效、績效指標及排名表

新制勞工退休基金

96年第一次委託經營安泰（續約）

單位：新台幣元；%

投信名稱	委託金額	目前淨資產	102年截至2月 累積投資報酬(%) (102.1.1~ 102.2.28)	委任迄今 (99.9.27~102.2.28)		
				投資報酬率 (%)	委託經營排名	大盤/指標 報酬率(%)
安泰	7,000,000,000	7,451,465,936	2.00	6.45	1	-3.29
合計	7,000,000,000	7,451,465,936	2.00	6.45	1	

97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	102年截至2月 累積投資報酬(%) (102.1.1~ 102.2.28)	委任迄今 (100.1.18~102.2.28)		
				投資報酬率 (%)	委託經營排名	大盤/指標 報酬率(%)
日盛	4,968,884,136	4,767,248,909	2.21	-4.06	3	-11.51
安泰	3,298,075,210	3,344,713,800	2.09	1.41	1	
保德信	2,939,416,481	2,757,141,489	1.88	-6.20	4	
國泰	2,944,902,854	2,662,954,971	-1.23	-9.57	5	
群益	2,782,544,958	2,794,598,386	3.23	0.43	2	
合計	16,933,823,639	16,326,657,555	1.72	-3.59	—	

## 97 年第一次委託經營（續約）A 帳戶

單位：新台幣元；%

投信名稱	委託金額	目前淨資產	102 年截至 2 月 累積投資報酬(%) (102. 1. 1~ 102. 2. 28)	委任迄今 (100. 3. 17~102. 2. 28)		
				投資報酬率(%)	委託經營排名	大盤/指標報酬率(%)
安泰	2,000,000,000	2,033,714,914	2.10	1.69	1	-5.12
保德信	2,000,000,000	1,995,269,122	2.04	-0.24	2	
合計	4,000,000,000	4,028,984,036	2.07	0.72	—	

## 97 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	102 年截至 2 月 累積投資報酬(%) (102. 1. 1~ 102. 2. 28)	委任迄今 (100. 10. 8~102. 2. 28)		
				投資報酬率(%)	委託經營排名	大盤/指標報酬率(%)
富邦	6,747,919,987	6,837,651,542	1.71	1.33	2	9.51
群益	7,256,147,326	7,699,096,255	3.16	6.10	1	
合計	14,004,067,313	14,536,747,797	2.47	3.80	—	

## 98 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	102 年截至 2 月 累積投資報酬(%) (102. 1. 1~ 102. 2. 28)	委任迄今 (100. 7. 14~102. 2. 28)		
				投資報酬率(%)	委託經營排名	大盤/指標報酬率(%)
安泰	3,421,364,679	3,624,343,934	1.99	5.93	2	11.17
保德信	3,423,163,553	3,697,723,266	2.88	8.02	1	
合計	6,844,528,232	7,322,067,200	2.44	6.98	—	

### 99 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	102 年截至 2 月 累積投資報酬(%) (102.1.1~ 102.2.28)	委任迄今 (99.3.9~102.2.28)		
				投資報酬率 (%)	委託經營排名	大盤/指標 報酬率(%)
安泰	4,000,000,000	4,496,691,773	1.62	12.42	2	1.75
保德信	4,000,000,000	4,712,831,673	2.84	17.82	1	
國泰	4,000,000,000	3,856,335,875	-1.37	-3.59	7	
富邦	4,000,000,000	4,070,274,051	1.21	1.76	5	
復華	4,000,000,000	4,028,750,779	0.75	0.72	6	
群益	4,000,000,000	4,417,986,299	2.27	10.45	3	
摩根	4,000,000,000	4,109,004,369	1.90	2.73	4	
合計	28,000,000,000	29,691,874,819	1.37	6.04	—	

### 99 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	102 年截至 2 月 累積投資報酬(%) (102.1.1~ 102.2.28)	委任迄今 (100.5.12~102.2.28)		
				投資報酬率 (%)	委託經營排名	大盤/指標 報酬率(%)
保德信	3,968,544,959	3,645,371,262	2.32	-8.14	1	-12.44
合計	3,968,544,959	3,645,371,262	2.32	-8.14	—	

## 99 年第二次委託經營

單位：新台幣元；%

投信 名稱	委託金額	目前淨資產	102 年截至 2 月 累積投資報酬(%) (102.1.1~ 102.2.28)	委任迄今 (99.11.30~102.2.28)		
				投資報酬 率(%)	委託經 營排名	大盤/指 標報酬率 (%)
日盛	5,000,000,000	4,501,857,318	2.93	-9.96	3	-5.61
永豐	5,000,000,000	4,500,606,827	0.56	-9.99	4	
國泰	5,000,000,000	5,462,629,043	2.80	9.25	1	
富邦	5,000,000,000	5,123,529,073	2.15	2.47	2	
滙豐 中華	5,000,000,000	4,498,837,565	2.59	-10.02	5	
元大 寶來 (原寶 來)	5,000,000,000	4,441,674,553	2.99	-11.17	6	
合計	30,000,000,000	28,529,134,379	2.34	-4.90	—	

# 100 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	102 年截至 2 月 累積投資報酬 (%) (102.1.1~ 102.2.28)	委任迄今 (100.7.15~102.2.28)		
				投資報酬 率(%)	委託經 營排名	大盤/指 標報酬率 (%)
元大 寶來 (原元 大)	5,000,000,000	5,397,534,910	4.56	7.95	2	-6.88/ -2.82
國泰	5,000,000,000	5,303,365,854	3.84	6.07	5	
富邦	5,000,000,000	5,277,165,642	4.65	5.54	6	
復華	5,000,000,000	5,449,748,485	5.06	8.99	1	
滙豐中 華	6,000,000,000	6,439,023,620	4.89	7.32	4	
元大 寶來 (原寶 來)	5,000,000,000	5,367,533,664	4.66	7.35	3	
合計	31,000,000,000	33,234,372,175	4.62	7.21	—	

註：本次委託為相對報酬委託經營，採就業 99 指數為指定指標，自委託日起算大盤/指定指標  
報酬率為 -6.88% / -2.82%，自建倉期滿起算則為 -9.28%/-6.96%。

## 100 年第二次委託經營第一期

單位：新台幣元；%

投信 名稱	委託金額	目前淨資產	102 年截至 1 月 累積投資報酬 (%) (102.1.1~ 102.2.28)	委任迄今 (100.8.10~102.2.28)		
				投資報酬 率(%)	委託經 營排名	大盤/指 標報酬 率(%)
保德信	3,000,000,000	3,072,317,296	1.97	2.41	2	5.40
統一	3,000,000,000	2,883,414,314	2.38	-3.89	4	
富邦	3,000,000,000	2,805,121,632	1.02	-6.50	5	
復華	3,000,000,000	3,081,329,951	3.41	2.71	1	
摩根	3,000,000,000	2,905,751,387	-0.28	-3.14	3	
合計	15,000,000,000	14,747,934,580	1.71	-1.68	—	

## 100 年第二次委託經營第二期

單位：新台幣元；%

投信 名稱	委託金額	目前淨資產	102 年截至 1 月 累積投資報酬 (%) (102.1.1~ 102.2.28)	委任迄今 (100.11.23~102.2.28)		
				投資報酬 率(%)	委託經 營排名	大盤/指 標報酬 率(%)
保德信	2,000,000,000	2,085,197,086	2.06	4.26	3	12.83
統一	2,000,000,000	2,055,471,303	2.36	2.77	4	
富邦	2,000,000,000	2,000,546,696	1.02	0.03	5	
復華	2,000,000,000	2,184,782,161	3.42	9.24	1	
滙豐 中華	2,000,000,000	2,093,168,382	1.66	4.66	2	
摩根	2,000,000,000	1,948,258,988	-0.27	-2.59	6	
合計	12,000,000,000	12,367,424,616	1.73	3.06	—	

## 101 年第一次委託

單位：新台幣元；%

投信名稱	委託金額	目前淨資產	102 年截至 2 月 累積投資報酬 (%) (102.1.1~ 102.2.28)	委任迄今 (101.4.18~102.2.28)		
				投資報酬 率(%)	委託經 營排名	大盤/指 標報酬 率(%)
國泰	1,000,000,000	1,074,542,264	1.95	7.45	3	4.11/ 8.01
富邦	1,000,000,000	1,073,131,957	2.37	7.31	4	
滙豐 中華	1,000,000,000	1,081,314,222	3.54	8.13	2	
元大 寶來 (原寶 來)	1,000,000,000	1,089,146,317	2.53	8.91	1	
合計	4,000,000,000	4,318,134,760	2.59	7.95	—	

註：本次委託為相對報酬委託經營，採加權股價報酬指數為指定指標。

## 101 年第二次委託經營

單位：新台幣元；%

投信名稱	委託金額	目前淨資產	102 年截至 2 月 累積投資報酬 (%) (102.1.1~ 102.2.28)	委任迄今 (101.7.16~102.2.28)		
				投資報酬 率(%)	委託經 營排名	大盤/指 標報酬 率(%)
安泰	5,000,000,000	5,221,731,715	1.93	4.43	5	11.17
保德信	5,000,000,000	5,241,694,515	1.91	4.83	4	
國泰	5,000,000,000	5,221,472,803	1.10	4.43	5	
統一	5,000,000,000	5,285,092,816	2.34	5.70	2	
富邦	5,000,000,000	5,267,989,781	1.93	5.36	3	
滙豐 中華	5,000,000,000	5,318,643,877	2.47	6.37	1	
合計	30,000,000,000	31,556,625,507	1.94	5.19	—	



## 舊制勞工退休基金

### 國內 97 年第 1 次委託(續)

單位：新台幣元；%

投信名稱	委託金額	目前淨資產	102 年截至 2 月 累積投資報酬(%) (102.1.1~102.2.28)	委任迄今 (100.3.17~102.2.28)		
				投資 報酬率(%)	排名	大盤/指標 報酬率(%)
保德信	3,313,984,536	3,259,603,093	2.14	-1.64	1	-5.12
群益	3,472,017,296	3,347,077,507	1.66	-3.60	2	
合計	6,786,001,832	6,606,680,600	1.89	-2.64	—	

### 國內 98 年第 2 次委託(續)

投信名稱	委託金額 (新台幣元)	目前淨資產 (新台幣元)	102 年截至 2 月 累積投資報酬(%) (102.1.26~102.2.28)	委任迄今 (102.1.26~102.2.28)		
				投資 報酬率(%)	排名	大盤/指標 報酬率(%)
保德信	3,380,116,383	3,465,709,760	2.53	2.53	2	2.94
富邦	3,208,581,038	3,284,894,661	2.38	2.38	3	
統一	3,514,321,648	3,640,943,635	3.60	3.60	1	
合計	10,103,019,069	10,391,548,056	2.86	2.86	—	

## 國內 99 年第 1 次委託

單位：新台幣元；%

投信名稱	委託金額	目前淨資產	102 年截至 2 月 累積投資報酬(%) (102.1.1~102.2.28)	委任迄今 (99.8.13~102.2.28)		
				投資 報酬率(%)	排名	大盤/指標 報酬率(%)
保德信	4,000,000,000	3,721,921,246	1.10	-6.95	5	0.87
群益	4,000,000,000	3,762,569,784	1.93	-5.94	4	
復華	4,000,000,000	3,712,181,927	2.86	-7.20	6	
國泰	4,000,000,000	4,070,799,409	1.17	1.77	1	
元大寶來	4,000,000,000	3,546,416,004	3.29	-11.34	7	
永豐	4,000,000,000	3,838,860,475	0.55	-4.03	3	
日盛	4,000,000,000	3,921,074,775	2.34	-1.97	2	
合計	28,000,000,000	26,573,823,620	1.86	-5.09	—	

## 國內 100 年第 1 次委託

單位：新台幣元；%

投信名稱	委託金額	目前淨資產	102 年截至 2 月 累積投資報酬(%) (102.1.1~102.2.28)	委任迄今 (100.3.17~102.2.28)		
				投資 報酬率(%)	排名	大盤/指標 報酬率(%)
保德信	5,000,000,000	4,903,310,872	2.06	-1.93	4	-5.12
群益	5,000,000,000	4,999,583,289	2.23	-0.01	3	
復華	5,000,000,000	4,846,350,518	3.19	-3.07	5	
國泰	5,000,000,000	5,005,432,520	1.32	0.11	2	
統一	5,000,000,000	5,066,268,864	2.35	1.33	1	
合計	25,000,000,000	24,820,946,063	2.22	-0.72	—	

## 國內 101 年第 1 次委託

單位：新台幣元；%

投信名稱	委託金額	目前淨資產	102 年截至 2 月 累積投資報酬(%) (102.1.1~102.2.28)	委任迄今 (101.10.30~102.2.28)		
				投資 報酬率(%)	排名	大盤/指標 報酬率(%)
匯豐中華	500,000,000	547,142,566	3.59	9.43	2	11.37
元大寶來	500,000,000	549,102,531	2.73	9.82	1	
合計	1,000,000,000	1,096,245,097	3.16	9.62	—	

## 國內 101 年第 2 次委託

單位：新台幣元；%

投信名稱	委託金額	目前淨資產	102 年截至 2 月 累積投資報酬(%) (102.1.1~102.2.28)	委任迄今 (101.4.30~102.2.28)		
				投資報酬率 (%)	排名	大盤/指標報 酬率(%)
保德信	5,000,000,000	5,243,907,537	2.04	4.88	4	5.58
群益	5,000,000,000	5,362,907,415	2.91	7.26	1	
匯豐中華	5,000,000,000	5,309,172,295	1.52	6.18	2	
安泰	5,000,000,000	5,273,505,263	2.70	5.47	3	
國泰	5,000,000,000	5,230,325,797	1.51	4.61	5	
統一	5,000,000,000	5,163,648,269	2.56	3.27	6	
合計	30,000,000,000	31,583,466,576	2.20	5.28	—	

## 2. 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：

單位：元

投信名稱	收回日期	收回委託金額	經理人	收回理由
97-1 續 元大寶來	102.1.9	38 億	楊○○	委託經營投資契約第 23 條規定，收回全數委託資產

舊制勞工退休基金：無

### (2)委託業者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。

## \*基金國外委外投資概況表

### 1.基金國外委外投資績效、績效指標及排名表

#### 新制勞工退休基金

#### 97 -1 全球股票型續約

單位：美元；%

投信名稱	目前淨資產	委託金額 (億美元)	102年截至2月 累積投資報酬(%) (102.1.1~102.2.28)	委任迄今 (101.5.21~102.2.28)		
				投資報酬 率(%)	委託經 營排名	大盤/指標 報酬率(%)
坦伯頓	505,587,491.98	4	4.80	26.40	1	20.91
合計	505,587,491.98	4	4.80	26.40	—	

#### 97-1 全球債券型續約

單位：美元；%

投信名稱	目前淨資產	委託金額 (億美元)	102年截至2月 累積投資報酬(%) (102.1.1~102.2.28)	委任迄今 (101.6.4~102.2.28)		
				投資報酬 率(%)	委託經 營排名	大盤/指標 報酬率(%)
聯博	764,567,203.02	7.5	-1.68	1.94	2	1.06
高盛	405,721,228.05	4	-2.17	1.43	3	
坦伯頓	709,294,204.12	6.5	-0.85	9.12	1	
合計	1,879,582,635.19	18	-1.47	4.42	—	

## 97-2 全球增值債券型續約

單位：美元；%

投信名稱	目前淨資產	委託金額 (億美元)	102年截至2月 累積投資報酬(%) (102.1.1~102.2.28)	委任迄今 (101.1.7~102.2.28)		
				投資報酬 率(%)	委託經 營排名	大盤/指標 報酬率(%)
太平洋	613,192,802.55	6.15	-0.37	-0.37	1	-0.72
高盛	474,937,273.95	4.79	-0.99	-0.99	2	
合計	1,088,130,076.50	10.95	-0.65	-0.65	—	

## 97-2 全球增值股票型續約

單位：美元；%

投信名稱	目前淨資產	委託金額 (億美元)	102年截至2月 累積投資報酬(%) (102.2.5~102.2.28)	委任迄今 (102.2.5~102.2.28)		
				投資報酬 率(%)	委託經 營排名	大盤/指標 報酬率(%)
貝萊德	385,473,495.81	3.84	0.31	0.31	2	0.30
摩根	590,806,447.50	5.88	0.50	0.50	1	
合計	976,279,943.31	9.72	0.43	0.43	—	

## 98-1 亞太（日本除外）股票型

單位：美元；%

投信名稱	目前淨資產	委託金額 (億美元)	102年截至2月 累積投資報酬(%) (102.1.1~102.2.28)	委任迄今 (98.11.17~102.2.28)		
				投資報酬 率(%)	委託經 營排名	大盤/指標 報酬率(%)
德盛安聯	342,007,316.59	3	2.25	20.44	2	26.89
景順	359,203,009.74	3	3.31	26.73	1	
摩根士丹利	237,584,335.58	2	4.76	18.79	3	
合計	938,794,661.91	8	3.28	22.08	—	

## 98-1 全球被動股票型

單位：美元；%

投信名稱	目前淨資產	委託金額 (億美元)	102年截至2月 累積投資報酬(%) (102.1.1~102.2.28)	委任迄今 (98.11.30~102.2.28)		
				投資報酬 率(%)	委託經 營排名	大盤/指標 報酬率(%)
貝萊德	258,832,847.64	2	4.34	29.42	2	30.07
道富	258,858,765.28	2	4.59	29.43	1	
合計	517,691,612.92	4	4.47	29.42	—	

## 99-1 全球新興市場股票型

單位：美元；%

投信名稱	目前淨資產	委託金額 (億美元)	102年截至2月 累積投資報酬(%) (102.1.1~102.2.28)	委任迄今 (99.8.24~102.2.28)		
				投資報酬 率(%)	委託經 營排名	大盤/指標 報酬率(%)
摩根士丹利	276,278,229.74	2.5	1.54	16.00	2	12.82
美盛	242,827,061.74	2.5	-0.17	1.68	3	
瑞萬通博	538,549,493.56	4.5	0.07	30.58	1	
合計	1,057,654,785.04	9.5	0.40	18.44	—	

## 100-1 全球基本面指數股票型

單位：美元；%

投信名稱	目前淨資產	委託金額 (億美元)	102年截至2月 累積投資報酬(%) (102.1.1~102.2.28)	委任迄今 (100.7.1~102.2.28、 100.7.13~102.2.28)		
				投資報酬 率(%)	委託經 營排名	大盤/指標 報酬率(%)
道富	313,950,425.22	3	4.82	4.65	2	4.21
貝萊德	321,849,115.65	3	4.72	7.27	1	
合計	635,799,540.87	6	4.77	5.96	—	

註：其中道富委託日100.7.1~105.6.30，貝萊德委託日100.7.13~105.7.12，委任迄今大盤/指標報酬率分別為4.21%及7.17%。

## 100-1 全球不動產股票型

單位：美元；%

投信名稱	目前淨資產	委託金額 (億美元)	102年截至2月 累積投資報酬(%) (102.1.1~102.2.28)	委任迄今 (101.3.6~102.2.28)		
				投資報酬 率(%)	委託經 營排名	大盤/指標 報酬率(%)
Cohen & Steers	354,301,914.01	3	4.85	20.17	2	19.18
Invesco 景順	512,294,316.49	4.5	3.58	22.25	1	
EII	448,294,352.52	4	2.31	17.79	3	
合計	1,314,890,583.02	11.5	3.48	19.95	—	



# 101-1 新興市場債券型

單位：美元；%

投信名稱	目前淨資產	委託金額 (億美元)	102 年截至 2 月 累積投資報酬(%) (102.1.1~102.2.28)	委任迄今 (101.7.31~102.2.28)		
				投資報酬 率(%)	委託經 營排名	大盤/指標 報酬率(%)
Ashmore	309,226,332.05	3	0.41	6.45	1	5.17
Bluebay	306,445,425.02	3	0.00	4.37	2	
Stone Harbour	304,735,025.16	3	-0.34	3.50	3	
Pictet	304,508,509.69	3	-0.49	3.48	4	
合計	1,224,915,291.92	12	-0.10	4.45	—	

## 舊制勞工退休基金

### 96年續約國外委託經營(平衡型)

投信名稱	委託金額 (美元)	目前淨資產 (美元)	102年截至2月 累積投資報酬(% (102.1.1~102.2.28)	委任迄今 (100.6.21~102.2.28)		
				投資 報酬率(%)	排名	大盤/指標 報酬率(%)
富達國際	425,533,349.13	496,582,089.17	3.46	14.68	-	11.48

### 97年續約國外委託經營(全球增值債券型)

投信名稱	委託金額 (美元)	目前淨資產 (美元)	102年截至2月 累積投資報酬(% (102.1.6~102.2.28)	委任迄今 (102.1.6~102.2.28)		
				投資 報酬率(%)	排名	大盤/指標 報酬率(%)
太平洋	731,384,465.68	728,316,597.91	-0.42	-0.42	1	-0.72
盧米斯	712,476,555.58	708,944,730.89	-0.50	-0.50	2	
合計	1,443,861,021.26	1,437,261,328.80	-0.46	-0.46	—	

### 97年續約國外委託經營(全球增值股票型)

投信名稱	委託金額 (美元)	目前淨資產 (美元)	102年截至2月 累積投資報酬(% (102.2.5~102.2.28)	委任迄今 (102.2.5~102.2.28)		
				投資 報酬率(%)	排名	大盤/指標 報酬率(%)
貝萊德	384,953,368.29	386,189,705.61	0.32	0.32	-	0.30

### 98年國外委託經營(亞太(日本除外)股票型)

投信名稱	委託金額 (美元)	目前淨資產 (美元)	102年截至2月 累積投資報酬(% (102.1.1~102.2.28)	委任迄今 (98.11.17~102.2.28)		
				投資 報酬率(%)	排名	大盤/指標 報酬率(%)
景順	200,000,000	253,769,358.05	3.30	26.88	-	26.89

## 100 年國外委託經營(全球基本面指數股票型)

投信名稱	委託金額 (美元)	目前淨資產 (美元)	102 年截至 2 月 累積投資報酬(%) (102.1.1~102.2.28)	委任迄今 (101.3.6~102.2.28)		
				投資 報酬率(%)	排名	大盤/指標 報酬率(%)
貝萊德	100,000,000	109,725,193.95	4.65	9.73	4	9.70
道富	100,000,000	109,880,338.99	4.79	9.88	3	
瑞銀環球	100,000,000	110,151,433.76	4.62	10.15	1	
野村	100,000,000	110,063,998.69	4.76	10.06	2	
合計	400,000,000	439,820,965.39	4.70	9.96	—	

## 2. 國外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。

## \* 基金投資衍生性金融商品概況表

### 新制勞工退休基金自營部位

102年2月28日

#### 一、避險：

種類	避險比例
權益證券避險	0%
匯率避險	13.96%

#### 二、投資：無

### 舊制勞工退休基金自營部位

(依交易目的)

102年2月28日

#### 一、避險：

種類	避險比例
權益證券避險	0%
匯率避險	6.64%

#### 二、投資：無