

勞工退休基金運用情形

一、勞工退休基金整體績效

(一) 115 年截至 1 月底績效

基金與指標	新制基金	舊制基金	臺灣 10 年期 公債殖利率	臺灣加權 股價指數	MSCI 全球 股票指數	Bloomberg 全球債券指數
收益率/報酬率	5.03%	8.08%	1.41%	10.70%	2.96%	0.94%

註 1：股、債指數係依據勞動部 111 年 4 月 29 日勞動福 4 字第 1110145465 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(114 年)績效

基金與指標	新制基金	舊制基金	臺灣 10 年期 公債殖利率	臺灣加權 股價指數	MSCI 全球 股票指數	Bloomberg 全球債券指數
收益率/報酬率	15.60%	22.53%	1.47%	25.74%	22.34%	8.17%

(三) 近三年(112~114 年)平均績效

基金與指標	新制基金	舊制基金	臺灣 10 年期 公債殖利率	臺灣加權 股價指數	MSCI 全球 股票指數	Bloomberg 全球債券指數
收益率/報酬率	14.91%	19.00%	1.40%	27.01%	20.65%	3.98%

(四) 近五年(110~114 年)平均績效

基金與指標	新制基金	舊制基金	臺灣 10 年期 公債殖利率	臺灣加權 股價指數	MSCI 全球 股票指數	Bloomberg 全球債券指數
收益率/報酬率	10.28%	12.12%	1.17%	14.48%	11.19%	-2.15%

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

115 年 1 月底止基金規模與收益			
基金運用規模		5 兆 2,648 億 8,107 萬元	
115 年截至 1 月底止 運用收益數及收益率	自行運用	國內固定收益	13 億 3,117 萬元 1.71%
		國內權益證券 及國外投資	789 億 4,999 萬元 7.44%
	委託經營		1,816 億 260 萬元 5.62%
	合 計		2,618 億 8,376 萬元 5.03%

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 3：115 年 1 月之保證收益率為 1.7108%。

2. 舊制勞工退休基金

115 年 1 月底止基金規模與收益			
基金運用規模		10,722 億 2,511 萬元	
115 年截至 1 月底止 運用收益數及收益率	自行運用	國內固定收益	3 億 7,169 萬元 1.70%
		國內權益證券 及國外投資	363 億 7,125 萬元 17.83%
	委託經營		369 億 6,667 萬元 6.07%
	合 計		737 億 961 萬元 8.08%

註：評價後報酬率係以當期報酬率（即收益÷115 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

115 年 1 月 31 日

單位：新臺幣元

項 目	餘 額	占基金運用比率(%)
自行運用	1,997,381,020,501	37.94
轉存金融機構	542,596,970,245	10.31
短期票券	133,854,412,238	2.54
公債、公司債、金融債券及特別股	244,357,595,081	4.64
股票及受益憑證投資(含期貨)	260,105,388,916	4.94
國外投資	816,466,654,021	15.51
固定收益	719,603,636,127	13.67
權益證券	49,052,466,605	0.93
另類投資	47,810,551,289	0.91
委託經營	3,267,500,049,518	62.06
國內委託經營	831,573,253,748	15.79
國外委託經營	2,435,926,795,770	46.27
固定收益	560,014,671,687	10.64
權益證券	1,346,277,092,815	25.57
另類投資	529,635,031,268	10.06
合 計	5,264,881,070,019	100.00

2. 舊制勞工退休基金

115年1月31日

單位：新臺幣元

項 目	餘 額	占基金運用比率(%)
自行運用	460,833,810,270	42.98
轉存金融機構	125,408,615,805	11.70
短期票券	42,054,779,651	3.92
公債、金融債券、公司債及證券化商品	90,481,276,852	8.44
股票及受益憑證投資(含期貨)	124,514,940,450	11.61
國外投資	78,374,197,512	7.31
固定收益	42,827,418,384	3.99
權益證券	31,183,929,553	2.91
另類投資	4,362,849,575	0.41
委託經營	611,391,300,029	57.02
國內委託經營	149,443,657,790	13.94
國外委託經營	461,947,642,239	43.08
固定收益	102,851,758,557	9.59
權益證券	244,510,232,894	22.80
另類投資	114,585,650,788	10.69
合 計	1,072,225,110,299	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

115年1月31日

單位：新臺幣元

項 目	金 額	占基金運用比率(%)
自行運用	1,997,381,020,501	37.94
委託經營	3,267,500,049,518	62.06

2. 舊制勞工退休基金

115年1月31日

單位：新臺幣元

項 目	金 額	占基金運用比率(%)
自行運用	460,833,810,270	42.98
委託經營	611,391,300,029	57.02

(四)基金國內投資與國外投資比率

1. 新制勞工退休基金

115年1月31日

單位：新臺幣元

項 目	金 額	占基金運用比率(%)
國內投資	2,012,487,620,228	38.22
國外投資	3,252,393,449,791	61.78

2. 舊制勞工退休基金

115年1月31日

單位：新臺幣元

項 目	金 額	占基金運用比率(%)
國內投資	531,903,270,548	49.61
國外投資	540,321,839,751	50.39

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

115年截至1月底

項 目	收益率(%)
國內權益證券	27.45

2. 舊制勞工退休基金

115年截至1月底

項 目	收益率(%)
國內權益證券	27.37

(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

115年1月31日 單位：新臺幣元

項 目	金 額	比 率 (%)
國內權益證券	260,105,388,916	4.94

2. 舊制勞工退休基金

115年1月31日 單位：新臺幣元

項 目	金 額	比 率 (%)
國內權益證券	124,514,940,450	11.61

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6)

單位：新臺幣元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	115年截至1月 累積投資報酬 (%)	委任迄今 (114.9.27~115.1.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	目標報酬率 (%)
野村	53,037,175,831	66,172,566,905	4.65	24.77	—	2.19

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300個基本點為基準。

97年第一次委託經營(續約5)

單位：新臺幣元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	115年截至1月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (112.1.30~115.1.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	目標報酬率 (%)
野村	6,829,066,771	15,524,825,154	8.56	127.33	—	18.30

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。

98 年第一次委託經營(續約 5)

單位：新臺幣元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	115 年截至 1 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (113.7.16~115.1.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	目標報酬率 (%)
野村	25,455,695,879	38,780,961,540	7.74	52.35	1	9.15
玉山	7,430,070,832	9,886,203,232	5.28	33.06	2	
合計	32,885,766,711	48,667,164,772	7.23	47.99	—	

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。

99 年第二次委託經營(續約 3)

單位：新臺幣元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	115 年截至 1 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (111.12.5~115.1.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	目標報酬率 (%)
國泰	10,445,113,310	17,468,601,260	4.60	67.24	—	19.26

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。

100 年第一次委託經營(續約 3)(相對報酬)

單位：新臺幣元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	115 年截至 1 月 累積投資報酬 (%)	委任迄今 (112.7.15~115.1.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
復華	29,101,525,086	54,902,366,557	13.21	88.66	—	83.73

註：本批次為相對報酬型，以臺灣就業 99 指數為指定指標。

101 年第二次委託經營(續約 3)

單位：新臺幣元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	115 年截至 1 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (113.7.20~115.1.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	目標報酬率 (%)
野村	15,198,354,580	25,562,087,672	6.92	68.19	1	9.08
統一	20,913,151,881	28,855,693,439	4.25	37.98	2	
合計	36,111,506,461	54,417,781,111	5.49	50.69	—	

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 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。

102 年第二次委託經營(續約 3) (相對報酬)

單位：新臺幣元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	115 年截至 1 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (115.1.24~115.1.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
統一	37,517,851,631	37,832,355,793	0.84	0.84	2	0.32
復華	39,053,243,767	39,686,578,037	1.62	1.62	1	
合計	76,571,095,398	77,518,933,830	1.24	1.24	—	

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(續約 2)

單位：新臺幣元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	115 年截至 1 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (111.10.11~115.1.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	目標報酬率 (%)
台新	15,841,461,125	29,208,714,214	3.71	84.38	—	20.18

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。

103 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	115 年截至 1 月 累積投資報酬 (%)	委任迄今 (114.12.1~115.1.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
國泰	23,658,255,796	27,372,627,141	9.65	15.70	5	15.89
統一	20,210,724,588	23,541,708,236	10.40	16.48	2	
復華	19,554,752,074	23,036,556,103	11.00	17.81	1	
滙豐	16,812,903,049	19,469,028,372	9.79	15.80	4	
安聯	24,098,049,298	27,922,747,141	9.97	15.87	3	
合計	104,334,684,805	121,342,666,993	10.15	16.30	—	

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 2)

單位：新臺幣元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	115 年截至 1 月 累積投資報酬 (%)	委任迄今 (112.4.6~115.1.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	目標報酬率 (%)
復華	4,799,121,512	9,019,983,166	5.86	87.95	1	17.15
安聯	3,601,238,896	6,407,221,009	10.25	77.92	2	
合計	8,400,360,408	15,427,204,175	7.64	83.65	—	

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。

106 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	115 年截至 1 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (112.2.7~115.1.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	目標報酬率 (%)
安聯	15,088,712,403	32,014,658,460	7.76	116.37	1	18.16
國泰	5,018,453,600	8,802,287,395	6.53	61.86	4	
群益	6,382,621,945	10,500,698,849	6.90	64.52	3	
滙豐	7,096,535,878	12,066,316,941	8.70	70.03	2	
合計	33,586,323,826	63,383,961,645	7.62	87.27	—	

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。

107 年第一次委託經營(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	115 年截至 1 月 累積投資報酬 (%)	委任迄今 (112.10.24~115.1.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
台新	8,254,694,051	17,753,303,080	9.03	115.07	6	113.82
安聯	12,775,472,416	27,635,159,578	9.75	116.31	4	
玉山	9,403,481,285	20,644,650,290	8.94	119.54	3	
統一	12,635,490,783	27,173,929,596	10.03	115.06	7	
國泰	10,445,956,159	23,005,179,247	9.61	120.23	2	
復華	7,235,716,436	15,639,195,740	9.34	116.14	5	
群益	4,439,275,178	9,829,699,887	9.12	121.43	1	
合計	65,190,086,308	141,681,117,418	9.48	117.34	—	

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(續約)

單位：新臺幣元

投信 名稱	委託金額	目前淨資產	115 年截至 1 月 累積投資報酬 (%)	委任迄今 (113.5.24~115.1.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	目標報酬率 (%)
安聯	13,613,817,760	21,859,878,242	7.60	61.31	3	10.03
施羅德	11,400,361,947	20,080,774,550	8.63	76.14	1	
統一	13,638,402,860	21,674,172,137	11.31	59.41	4	
野村	20,601,693,072	36,044,921,665	6.92	75.91	2	
國泰	19,457,627,824	27,980,079,402	7.96	43.80	6	
復華	9,724,896,734	14,748,637,539	5.72	51.66	5	
合計	88,436,800,197	142,388,463,535	7.99	61.61	—	

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 250 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	115 年截至 1 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (110.5.13~115.1.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	目標報酬率 (%)
台新	8,000,000,000	13,421,710,618	2.64	67.77	5	26.73
安聯	8,000,000,000	15,939,389,839	10.36	99.24	2	
玉山	8,000,000,000	13,668,643,387	5.34	70.86	4	
國泰	8,000,000,000	14,712,641,598	6.40	83.91	3	
野村	8,000,000,000	17,442,468,625	4.62	118.03	1	
合計	40,000,000,000	75,184,854,067	5.90	87.96	—	

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 年第二次委託經營（相對報酬）

單位：新臺幣元

投信 名稱	委託金額	目前淨資產	115 年截至 1 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (111.5.13~115.1.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
安聯	3,000,000,000	5,756,008,584	13.05	85.08	4	93.88
玉山	3,000,000,000	5,835,378,361	12.30	89.12	2	
野村	3,000,000,000	5,956,706,305	11.98	88.81	3	
國泰	3,000,000,000	6,002,800,606	11.32	92.13	1	
富邦	3,000,000,000	5,724,104,710	10.79	81.95	5	
合計	15,000,000,000	29,274,998,566	11.88	87.42	—	

註：本批次為相對報酬型，以臺灣企業社會責任中小型報酬指數為指定指標。

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	115 年截至 1 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (110.12.15~115.1.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	目標報酬率 (%)
安聯	8,000,000,000	15,266,474,789	7.73	96.51	2	25.25
玉山	8,000,000,000	12,778,412,831	5.31	62.87	5	
國泰	8,000,000,000	13,626,729,472	7.70	78.75	4	
第一金	8,000,000,000	11,840,442,650	12.51	47.71	6	
野村	8,000,000,000	15,756,627,962	4.56	98.80	1	
富邦	8,000,000,000	15,401,373,683	8.89	96.27	3	
合計	48,000,000,000	84,670,061,387	7.59	80.17	—	

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。

111 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	115 年截至 1 月 累積投資報酬 (%)	委任迄今 (112.10.5~115.1.31)		
				投資 報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
安聯	7,000,000,000	10,284,553,606	9.61	67.70	4	13.98
施羅德	7,000,000,000	12,560,008,894	8.81	106.78	1	
國泰	7,000,000,000	10,723,127,329	7.69	82.33	3	
第一金	7,000,000,000	10,638,728,028	12.43	49.86	6	
野村	7,000,000,000	12,309,024,626	6.87	98.53	2	
華南 永昌	7,000,000,000	8,068,142,644	9.79	23.95	7	
滙豐	7,000,000,000	10,194,482,092	8.44	61.95	5	
合計	49,000,000,000	74,778,067,219	8.98	70.00	—	

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。

112 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	115 年截至 1 月 累積投資報酬 (%)	委任迄今 (114.4.1~115.1.31)		
				投資 報酬率(%)	排名	指標報酬率 (%)
安聯	4,000,000,000	6,022,413,183	11.34	78.24	1	59.15
兆豐 國際	4,000,000,000	5,829,002,633	11.95	69.93	2	
宏利	4,000,000,000	5,714,908,491	11.87	63.11	3	
施羅德	4,000,000,000	5,580,782,996	10.32	58.78	6	
野村	4,000,000,000	5,623,440,017	10.67	60.06	5	
摩根	4,000,000,000	5,713,954,812	10.84	63.07	4	
合計	24,000,000,000	34,484,502,132	11.17	65.52	—	

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。

113 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	115 年截至 1 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (114.11.14~115.1.31)		
				投資 報酬率(%)	排名	目標報酬率 (%)
安聯	4,500,000,000	5,175,127,452	9.51	14.42	2	1.36
貝萊德	4,500,000,000	5,039,614,446	6.95	10.90	5	
施羅德	4,500,000,000	5,373,955,488	10.39	17.63	1	
野村	4,500,000,000	5,096,005,048	7.44	12.50	4	
摩根	4,500,000,000	5,224,468,881	9.34	13.57	3	
合計	22,500,000,000	25,909,171,315	8.74	13.81	—	

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 300 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 5)

單位：新臺幣元

投信 名稱	委託金額	目前淨資產	115 年截至 1 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (114.1.28~115.1.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	目標報酬率 (%)
富邦	15,603,507,854	23,318,587,450	9.56	49.44	1	6.39
統一	13,492,877,440	20,020,841,941	10.63	48.38	2	
合計	29,096,385,294	43,339,429,391	10.05	48.95	—	

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 300 個基本點為基準。

國內 101 年第一次委託經營(相對報酬)(續約 3)

單位：新臺幣元

投信 名稱	委託金額	目前淨資產	115 年截至 1 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (113.11.2~115.1.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
滙豐	6,530,798,735	9,683,347,494	10.45	48.27	—	45.23

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 3)

單位：新臺幣元

投信 名稱	委託金額	目前淨資產	115 年截至 1 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (113.05.04~115.1.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	目標報酬率 (%)
野村	27,357,530,009	49,944,651,178	6.63	82.56	—	10.36

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。

國內 104 年第一次委託經營(續約 2)

單位：新臺幣元

投信 名稱	委託金額	目前淨資產	115 年截至 1 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (112. 4. 6~115. 1. 31)		
				投資報酬率 (%)	排名	目標報酬率 (%)
復華	4,800,107,976	9,021,714,356	5.86	87.95	1	17.15
安聯	3,601,947,821	6,408,353,647	10.25	77.91	2	
合計	8,402,055,797	15,430,068,003	7.64	83.65	—	

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。

國內 106 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	115 年截至 1 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (112. 2. 7~115. 1. 31)		
				投資報酬率 (%)	排名	目標報酬率 (%)
安聯	15,089,937,312	32,018,127,450	7.76	116.37	1	18.16
國泰	5,019,107,110	8,803,797,051	6.53	61.87	4	
群益	6,384,957,618	10,507,426,615	6.90	64.57	3	
滙豐	7,097,524,598	12,068,281,277	8.70	70.04	2	
合計	33,591,526,638	63,397,632,393	7.62	87.28	—	

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。

國內 109 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	115 年截至 1 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (111. 5. 13~115. 1. 31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
安聯	1,000,000,000	1,918,968,330	13.05	85.15	4	93.88
玉山	1,000,000,000	1,945,350,781	12.30	89.13	2	
野村	1,000,000,000	1,985,806,615	11.98	88.84	3	
國泰	1,000,000,000	2,001,208,543	11.31	92.19	1	
富邦	1,000,000,000	1,908,348,771	10.79	82.09	5	
合計	5,000,000,000	9,759,683,040	11.88	87.49	—	

註：本批次為相對報酬型，以臺灣企業社會責任中小型報酬指數為指定指標。

國內 111 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	115 年截至 1 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (112.10.5~115.1.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	目標報酬率 (%)
安聯	3,000,000,000	4,342,948,805	9.45	68.62	4	13.98
施羅德	3,000,000,000	5,285,235,619	8.81	107.71	1	
國泰	3,000,000,000	4,557,117,023	7.61	85.33	3	
第一金	3,000,000,000	4,657,083,160	12.39	50.52	6	
野村	3,000,000,000	5,180,296,823	6.88	97.85	2	
華南 永昌	3,000,000,000	3,508,189,707	9.77	26.97	7	
滙豐	3,000,000,000	4,315,084,484	8.43	63.09	5	
合計	21,000,000,000	31,845,955,621	8.96	71.29	—	

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。

(二) 115 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 3)

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	115 年截至 1 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (110.6.7~115.1.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
聯博	987,613,021	917,638,900	1.10	-8.06	2	-8.65
富蘭克林 坦伯頓	1,351,737,838	1,367,575,828	1.01	-4.92	1	
合計	2,339,350,859	2,285,214,728	1.05	-6.59	—	

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	115 年截至 1 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (111.1.6~115.1.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
PIMCO	2,408,967,886	2,442,312,932	0.91	-1.84	—	-5.21

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	115 年截至 1 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (111.2.6~115.1.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
貝萊德	1,834,805,538	3,059,798,382	5.01	68.76	1	54.95
JPMorgan	1,585,120,883	2,466,200,349	3.20	57.54	2	
合計	3,419,926,421	5,525,998,731	4.19	63.57	—	

98-1 亞太（日本除外）主動股票型（續約 3） 單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	115 年截至 1 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (111.11.17~115.1.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
景順	656,507,639	1,185,733,252	7.38	80.61	—	67.93

98-1 全球被動股票型（續約 3） 單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	115 年截至 1 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (111.12.4~115.1.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
貝萊德	1,241,092,316	2,081,506,474	3.00	73.64	2	72.99
道富	1,663,655,177	2,801,855,850	2.96	74.99	1	
合計	2,904,747,493	4,883,362,324	2.98	74.41	—	

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	115 年截至 1 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (110.7.1~115.1.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
道富	934,565,605	1,573,018,359	5.48	68.32	1	64.88
貝萊德	939,726,931	1,577,358,985	5.40	67.85	2	
合計	1,874,292,536	3,150,377,344	5.44	68.08	—	

100-1 全球不動產有價證券型（續約 2） 單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	115 年截至 1 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (111.3.6~115.1.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
Cohen & Steers	2,555,932,432	2,720,792,607	3.23	4.57	1	2.03
景順	1,567,127,452	1,573,398,807	3.97	-0.42	2	
合計	4,123,059,884	4,294,191,414	3.50	2.67	—	

101-1 全球新興市場主動債券型 (續約 2)

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	115 年截至 1 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (111. 7. 31~115. 1. 31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
Pictet	618, 843, 493	788, 663, 379	0. 77	28. 03	—	29. 36

101-1 全球低波動指數被動股票型 (續約 2)

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	115 年截至 1 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (112. 4. 18~115. 1. 31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
道富	1, 263, 392, 347	1, 609, 486, 010	1. 63	29. 90	2	28. 91
貝萊德	1, 352, 011, 599	1, 721, 409, 184	1. 65	30. 17	1	
合計	2, 615, 403, 946	3, 330, 895, 194	1. 64	30. 04	—	

102-1 全球高股利增值股票型 (續約 2)

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	115 年截至 1 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (113. 1. 22~115. 1. 31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
瑞萬通博	1, 796, 000, 834	2, 141, 110, 514	4. 29	19. 85	3	38. 33
MFS	1, 164, 480, 846	1, 600, 779, 092	6. 06	38. 10	2	
威靈頓	1, 507, 914, 919	2, 111, 732, 519	5. 47	40. 84	1	
合計	4, 468, 396, 599	5, 853, 622, 125	5. 19	31. 69	—	

102-1 全球信用主動債券型 (續約 2)

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	115 年截至 1 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (113.4.25~115.1.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
RBC	1,186,559,371	1,384,386,617	1.06	17.31	1	15.88
貝萊德	670,392,768	776,158,875	0.93	15.78	2	
盧米斯	941,561,542	1,085,584,484	0.90	15.64	3	
合計	2,798,513,681	3,246,129,976	0.97	16.37	—	

104-1 全球高品質被動股票型 (續約 2)

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	115 年截至 1 月 累積投資報酬 (%)	委任迄今 (114.8.11~115.1.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
北美信託	3,222,313,413	3,672,512,792	3.72	14.02	1	14.27
LGIM	3,208,355,339	3,650,645,070	3.63	13.84	3	
Geode	3,189,006,741	3,631,202,582	3.66	13.92	2	
合計	9,619,675,493	10,954,360,444	3.67	13.93	—	

104-2 全球基礎建設有價證券型 (續約 2)

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	115 年截至 1 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (114.9.25~115.1.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
Magellan	1,159,305,130	1,252,169,934	4.05	8.01	1	6.14
RREEF	1,668,471,152	1,753,921,317	4.18	5.12	2	
合計	2,827,776,282	3,006,091,251	4.12	6.31	—	

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	115年截至1月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (114.11.13~115.1.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率(%)
盧米斯	819,799,803	835,921,939	0.99	1.97	—	1.62

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	115年截至1月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (110.7.20~115.1.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標/目標報酬率(%)
Allianz	878,698,278	1,274,656,158	8.11	54.92	1	17.38/40.08
JPMorgan	1,645,715,430	2,017,421,211	2.11	22.59	3	
DWS	1,175,711,371	1,497,635,293	2.61	30.96	2	
柏瑞	315,326,657	402,855,412	2.53	13.25	4	
合計	4,015,451,736	5,192,568,074	3.62	28.44	—	

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 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	115年截至1月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (110.8.24~115.1.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
貝萊德	949,175,052	1,416,728,627	7.74	49.26	—	43.87

106-1 全球 ESG 混合指數被動股票型(續約)

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	115 年截至 1 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (111.6.22~115.1.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
貝萊德	641,552,002	1,033,451,147	4.33	67.98	4	68.04
DWS	848,715,051	1,334,010,488	4.47	72.05	1	
道富	849,045,562	1,349,703,381	4.40	71.74	2	
北美信託	762,047,560	1,236,302,816	4.49	70.08	3	
合計	3,101,360,175	4,953,467,832	4.43	70.55	—	

106-1 絕對報酬債券型(續約)

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	115 年截至 1 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (111.7.25~115.1.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標/目標 報酬率(%)
American Century	427,360,620	516,536,100	0.54	20.87	3	16.83/25.65
富達	905,211,657	1,148,909,411	0.36	25.59	1	
TCW	1,039,618,153	1,269,249,890	0.41	22.07	2	
合計	2,372,190,430	2,934,695,401	0.41	23.35	—	

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 (續約)

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	115年截至1月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (113.1.23~115.1.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標/目標 報酬率(%)
景順	906,698,949	1,275,786,213	2.75	43.87	1	9.26/19.40
威靈頓	787,219,463	1,033,939,479	2.27	31.34	4	
CPR	858,885,217	1,130,453,652	3.26	33.45	3	
道富	706,462,703	993,102,751	3.52	40.57	2	
合計	3,259,266,332	4,433,282,095	2.94	37.26	—	

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 (續約)

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	115年截至1月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (113.12.18~115.1.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
Nomura	559,865,985	761,425,289	6.81	36.67	3	41.09
荷寶	506,416,368	689,033,270	7.92	37.17	2	
道富	441,937,598	613,286,539	7.69	38.77	1	
合計	1,508,219,951	2,063,745,098	7.44	37.46	—	

109-1 全球美元公司增值債券型 (續約)

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	115年截至1月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (115.1.13~115.1.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
Insight	919,063,706	919,687,842	0.07	0.07	3	0.17
JPMorgan	488,802,477	489,638,003	0.17	0.17	1	
PIMCO	594,765,647	595,448,457	0.11	0.11	2	
合計	2,002,631,830	2,004,774,302	0.11	0.11	—	

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	115年截至1月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (110.9.8~115.1.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
CBRE	430,000,000	545,338,528	3.27	30.67	3	30.96
Clearbridge	550,000,000	753,740,036	5.66	43.05	1	
Magellan	350,000,000	469,518,298	4.00	32.12	2	
RREEF	430,000,000	539,410,656	3.44	28.88	4	
合計	1,760,000,000	2,308,007,518	4.23	33.98	—	

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	115 年截至月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (110.10.15~115.1.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標/目標 報酬率(%)
富達	400,000,000	485,067,044	4.75	20.77	3	17.37/38.88
JPMorgan	400,000,000	482,420,533	2.03	20.39	4	
Ninety One	400,000,000	482,524,430	1.05	19.99	5	
Schroders	400,000,000	510,580,931	2.11	27.12	1	
T. Rowe Price	400,000,000	492,767,581	3.57	21.74	2	
合計	2,000,000,000	2,453,360,519	2.69	22.01	—	

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。

111-1 全球氣候變遷增值股票型

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	115 年截至 1 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (112.4.28~115.1.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
滙豐	400,000,000	567,041,232	2.64	67.04	2	61.00
LGIM	400,000,000	551,503,732	0.63	60.63	3	
摩根士丹利	400,000,000	554,701,566	0.70	59.91	4	
Schroders	400,000,000	545,408,664	1.65	59.76	5	
威靈頓	400,000,000	568,608,434	1.41	67.83	1	
合計	2,000,000,000	2,787,263,628	1.41	63.03	—	

111-2 絕對報酬債券型

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	115年截至1月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (112.7.19~115.1.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標/目標 報酬率(%)
盧米斯	600,000,000	683,241,707	0.28	20.19	2	12.21/18.57
Ninety One	500,000,000	580,360,919	0.46	18.63	4	
PIMCO	500,000,000	591,315,098	0.80	20.51	1	
PGIM	600,000,000	673,826,920	0.46	18.70	3	
T. Rowe Price	500,000,000	546,554,357	0.52	10.32	6	
威靈頓	500,000,000	559,151,641	0.48	14.53	5	
合計	3,200,000,000	3,634,450,642	0.49	17.15	—	

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。

112-1 全球被動股票型

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	115年截至1月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (113.6.27~115.1.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
Amundi	400,000,000	492,442,836	3.01	28.42	4	32.72
LGIM	400,000,000	502,974,823	2.98	32.45	3	
道富	400,000,000	504,422,284	3.00	33.05	1	
北美信託	400,000,000	504,330,870	2.99	32.83	2	
合計	1,600,000,000	2,004,170,813	2.99	31.69	—	

113-1 全球永續不動產有價證券型

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	115年截至1月 累積投資報酬 (%)	委任迄今 (114.6.18~115.1.31)		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率(%)
貝萊德	400,000,000	414,996,269	4.07	6.36	2	6.76
Center Square	400,000,000	414,025,827	4.10	5.92	4	
富達	400,000,000	416,836,672	4.13	6.76	1	
RREEF	400,000,000	413,961,732	3.91	5.92	3	
合計	1,600,000,000	1,659,820,500	4.05	6.24	—	

114-1 全球氣候轉型被動股票型

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	115年截至1月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (114.11.25~115.1.31)		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率(%)
貝萊德	100,000,000	104,599,098	1.28	4.60	1	4.35
HSBC	100,000,000	104,180,210	1.18	4.18	4	
道富	100,000,000	104,358,901	1.18	4.36	3	
UBS	100,000,000	104,366,161	1.18	4.37	2	
合計	400,000,000	417,504,370	1.20	4.38	—	

2. 舊制勞工退休基金

96 國際平衡型(續約 4)

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	114年截至1月 累積投資報酬率(%)	委任迄今 (113.6.24~115.1.31)		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率(%)
富達	753,144,454	941,333,254	2.33	24.99	—	21.78

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	115 年截至 1 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (111.1.6~115.1.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
PIMCO	1,003,724,736	986,966,879	0.94	-1.67	1	-5.21
盧米斯	1,018,693,762	975,526,311	1.00	-5.46	2	
合計	2,022,418,498	1,962,493,190	0.97	-3.54	—	

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	115 年截至 1 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (111.2.6~115.1.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
貝萊德	1,256,987,544	2,094,014,537	5.22	68.89	—	54.95

98-1 亞太(日本除外)主動股票型(續約 3)

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	114 年截至 1 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (111.11.17~115.1.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
景順	181,124,998	353,448,273	7.37	79.48	—	67.93

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	115 年截至 1 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (111.3.6~115.1.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
貝萊德	304,997,166	515,277,339	5.43	68.94	3	66.92
道富	360,436,214	612,930,137	5.47	70.05	1	
瑞銀	308,879,836	524,219,930	5.45	69.72	2	
Nomura	360,147,608	607,757,139	5.38	68.75	4	
合計	1,334,460,824	2,260,184,545	5.43	69.37	—	

101-1 全球低波動指數被動股票型(續約 2)

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	115 年截至 1 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (112.4.18~115.1.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
貝萊德	751,993,706	979,307,859	1.64	30.23	—	28.91

102-1 年 全球高股利增值股票型(續約 2)

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	115 年截至 1 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (113.1.22~115.1.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
瑞萬通博	414,056,068	495,950,742	4.28	19.78	3	38.33
MFS	315,296,707	435,125,203	6.05	38.00	2	
威靈頓	704,502,354	992,140,213	5.47	40.83	1	
合計	1,433,855,129	1,923,216,158	5.29	34.13	—	

102-2 全球基礎建設有價證券型(續約 2)

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	115 年截至 1 月 累積投資報酬 (%)	委任迄今 (113.5.29~115.1.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
Lazard	954,418,976	1,377,279,683	4.64	44.31	—	32.14

102-2 全球不動產有價證券型 (續約 2)

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	115 年截至 1 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (113.8.27~115.1.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
信安環球	708,888,643	734,579,991	3.09	3.62	2	6.20
Nomura	144,937,350	157,868,940	2.77	8.92	1	
合計	853,825,993	892,448,931	3.03	4.52	—	

註：Macquarie 於 114.12.1 更名為 Nomura。

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	115 年截至 1 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (110.7.20~115.1.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標/目標 報酬率(%)
Allianz	205,447,975	296,248,958	8.17	55.12	1	17.38/40.08
摩根	594,592,070	732,819,549	2.09	23.25	3	
DWS	341,387,682	439,167,442	2.64	31.06	2	
柏瑞	174,823,294	206,075,978	2.53	13.22	4	
合計	1,316,251,021	1,674,311,927	3.32	27.25	—	

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 (續約)

單位:美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	115 年截至 1 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (111.6.22~115.1.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
貝萊德	127,303,524	213,469,176	4.38	67.69	4	68.04
DWS	147,528,441	253,654,812	4.47	71.94	1	
道富	157,982,595	271,159,808	4.41	71.64	2	
北美信託	158,484,700	269,180,341	4.48	69.85	3	
合計	591,299,260	1,007,464,137	4.44	70.38	—	

106-1 絕對報酬債券型(續約)

單位:美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	115 年截至 1 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (111.7.25~115.1.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標/目標 報酬率(%)
American Century	319,635,794	386,199,506	0.54	20.82	3	16.83/25.65
富達	279,785,344	356,915,892	0.36	26.10	1	
TCW	328,000,470	402,718,020	0.39	22.78	2	
合計	927,421,608	1,145,833,418	0.43	23.20	—	

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(續約)

單位:美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	115 年截至 1 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (113.1.23~115.1.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標/目標 報酬率(%)
景順	116,977,839	168,224,978	2.75	43.81	1	9.26/19.40
威靈頓	107,476,614	141,119,926	2.26	31.30	3	
CPR	115,110,097	153,612,473	3.26	33.45	2	
合計	339,564,550	462,957,377	2.77	36.34	—	

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	115年截至1月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (110.9.8~115.1.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
CBRE	60,000,000	77,668,879	3.27	30.98	3	30.96
ClearBridge	60,000,000	84,646,631	5.66	44.77	1	
Magellan	60,000,000	71,165,175	4.00	33.04	2	
RREEF	60,000,000	76,867,528	3.41	29.66	4	
合計	240,000,000	310,348,213	4.11	34.16	—	

(二)115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)

115年1月31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

(二)舊制勞工退休基金自營部位

(依交易目的)

115年1月31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
115年1月份	261,986,944,328	264,552,549,017	2,565,604,689

(二)舊制勞工退休基金

單位：新臺幣元

	餘絀	收入	支出
115年1月份	73,709,614,798	73,968,926,353	259,311,555

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

115年1月份		單位：新臺幣元
項 目	金 額	
現金收入	150,460,679,100	
現金支出	150,982,158,673	
現金增(減)數		-521,479,573

(二)舊制勞工退休基金

115年1月份		單位：新臺幣元
項 目	金 額	
現金收入	32,025,711,641	
現金支出	32,025,631,680	
現金增(減)數		79,961