勞工退休基金運用情形

一、勞工退休基金整體績效

（一）113 年截至 1 月底績效

基金與指標	新制基金	舊制基金	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
收益率/報酬率	1.37%	1.32%	1.23%	-0.23%	0.59%	-1.38%

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(112 年)績效

基金與指標	新制基金	舊制基金	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
收益率/報酬率	12.60%	14.83%	1.21%	26.83%	22.20%	5.72%

（三）近三年(110～112 年)平均績效

基金與指標	新制基金	舊制基金	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
收益率/報酬率	5.26%	6.50%	0.96%	6.77%	5.75%	-5.51%

（四）近五年(108～112 年)平均績效

基金與指標	新制基金	舊制基金	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
收益率/報酬率	6.51%	7.90%	0.81%	13.01%	11.72%	-0.32%

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

113 年 1 月底止基金規模與收益			
基金運用規模			4 兆 457 億 5,079 萬元
113 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	10 億 4,371 萬元 1.58%
		國內權益證券 及國外投資	121 億 5,340 萬元 1.47%
	委託經營		411 億 5,721 萬元 1.74%
	合　　計		543 億 5,432 萬元 1.37%

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 3：113 年 1 月之保證收益率為 1.5866%。

2. 舊制勞工退休基金

113 年 1 月底止基金規模與收益			
基金運用規模			1 兆 24 億 4,371 萬元
113 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 5,101 萬元 1.46%
		國內權益證券 及國外投資	19 億 9,925 萬元 0.93%
	委託經營		87 億 305 萬元 1.68%
	合　　計		110 億 5,331 萬元 1.32%

註：評價後報酬率係以當期報酬率（即收益÷113 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

113 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	**1,625,729,974,873**	**40.18**
轉存金融機構	460,840,716,060	11.39
短期票券	87,248,280,935	2.16
公債、公司債、金融債券及特別股	227,315,292,643	5.62
股票及受益憑證投資（含期貨）	238,717,218,137	5.90
國外投資	611,608,467,098	15.11
固定收益	493,704,861,096	12.20
權益證券	58,747,959,963	1.45
另類投資	59,155,646,039	1.46
委託經營	**2,420,020,815,915**	**59.82**
國內委託經營	551,717,915,017	13.64
國外委託經營	1,868,302,900,898	46.18
固定收益	486,752,977,236	12.03
權益證券	958,616,618,990	23.70
另類投資	422,933,304,672	10.45
合　　計	**4,045,750,790,788**	**100.00**

2.舊制勞工退休基金

113 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	**499,728,914,510**	**49.85**
轉存金融機構	154,793,508,104	15.44
短期票券	52,167,479,789	5.20
公債、金融債券、公司債及證券化商品	78,644,503,162	7.85
股票及受益憑證投資(含期貨)	114,927,260,379	11.46
國外投資	99,196,163,076	9.90
固定收益	51,296,829,724	5.12
權益證券	37,965,928,677	3.79
另類投資	9,933,404,675	0.99
委託經營	**502,714,794,335**	**50.15**
國內委託經營	104,280,180,227	10.40
國外委託經營	398,434,614,108	39.75
固定收益	97,175,739,525	9.70
權益證券	206,300,834,421	20.58
另類投資	94,958,040,162	9.47
合　　計	**1,002,443,708,845**	**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

113 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	1,625,729,974,873	40.18
委 託 經 營	2,420,020,815,915	59.82

2.舊制勞工退休基金

113 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	499,728,914,510	49.85
委 託 經 營	502,714,794,335	50.15

(四)基金國內投資與國外投資比率

1.新制勞工退休基金

113 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	1,565,839,422,792	38.71
國 外 投 資	2,479,911,367,996	61.29

2.舊制勞工退休基金

113 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	504,812,931,661	50.35
國 外 投 資	497,630,777,184	49.65

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

113 年截至 1 月底

項　　目	收益率（%）
國內權益證券	0.84

2.舊制勞工退休基金

113 年截至 1 月底

項　　目	收益率（%）
國內權益證券	-0.10

(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

113 年 1 月 31 日　　單位：新臺幣元

項　　目	金　　額	比　　率（%）
國內權益證券	238,717,218,137	5.90

2.舊制勞工退休基金

113 年 1 月 31 日　　單位：新臺幣元

項　　目	金　　額	比　　率（%）
國內權益證券	114,927,260,379	11.46

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 5)　　單位：新臺幣元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	113 年截至 1 月累積投資報酬(%)	委任迄今（111.9.27~113.1.31）		
				投資報酬率（%）	排名	目標報酬率（%）
野村	28,072,603,831	36,261,478,139	4.59	29.17	—	8.50

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。

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	113 年截至 1 月累積投資報酬(%)	委任迄今（112.1.30~113.1.31）		
				投資報酬率（%）	排名	目標報酬率（%）
野村	6,829,066,771	8,455,777,884	4.03	23.82	—	6.39

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 4)

單位：新臺幣元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	113 年截至 1 月累積投資報酬(%)	委任迄今（110.7.16~113.1.31）		
				投資報酬率(%)	排名	目標報酬率(%)
野村	19,093,323,980	20,760,297,735	3.38	8.73	2	14.40
保德信	6,277,574,114	6,982,211,884	1.62	11.22	1	
合計	25,370,898,094	27,742,509,619	2.93	9.35	—	

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 4 年年底股票集中市場平均殖利率加計 200 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	113 年截至 1 月累積投資報酬(%)	委任迄今（111.12.5~113.1.31）		
				投資報酬率(%)	排名	目標報酬率(%)
國泰	10,445,113,310	11,260,541,310	-2.00	7.81	—	7.34

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	113 年截至 1 月累積投資報酬(%)	委任迄今（112.7.15~113.1.31）		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率(%)
復華	29,101,525,086	30,412,994,025	-0.21	4.51	—	5.82

註：本批次為相對報酬型，以臺灣就業 99 指數為指定指標。

101 年第一次委託經營(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	113 年截至 1 月累積投資報酬(%)	委任迄今（109.4.20~113.1.31）		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率(%)
國泰	8,014,871,501	15,515,338,221	-0.11	93.58	1	94.69
滙豐	9,927,481,593	19,345,582,271	0.69	87.24	2	
合計	17,942,353,094	34,860,920,492	0.33	89.88	—	

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。

101 年第二次委託經營(續約 2)

單位：新臺幣元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	113 年截至 1 月累積投資報酬(%)	委任迄今（109.7.20~113.1.31）		
				投資報酬率(%)	排名	目標報酬率(%)
野村	9,057,257,704	13,045,981,093	4.86	44.04	2	20.37
統一	12,294,643,442	17,865,156,538	1.99	45.31	1	
合計	21,351,901,146	30,911,137,631	3.18	44.77	—	

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 4 年年底股票集中市場平均殖利率加計 200 個基本點為基準。

102 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	113 年截至 1 月累積投資報酬(%)	委任迄今（111.1.24~113.1.31）		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率(%)
統一	14,437,134,744	16,416,370,006	2.22	13.71	1	11.68
復華	19,009,802,076	19,801,921,384	1.16	4.17	2	
合計	33,446,936,820	36,218,291,390	1.64	8.29	—	

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 年第一次委託經營第二期(續約 2)

單位：新臺幣元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	113 年截至 1 月累積投資報酬(%)	委任迄今（111.10.11~113.1.31）		
				投資報酬率(%)	排名	目標報酬率(%)
台新	15,841,461,125	19,725,675,626	0.82	24.52	—	8.27

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。

103 年第二次委託經營(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	113 年截至 1 月累積投資報酬(%)	委任迄今(110.12.1~113.1.31)		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率(%)
國泰	14,836,482,661	17,477,349,392	-1.26	19.19	5	22.36
統一	11,353,734,691	13,733,509,083	-1.54	20.96	1	
復華	10,890,868,617	13,078,840,330	-1.52	20.09	2	
滙豐	10,790,827,015	12,940,886,781	-1.14	19.92	3	
安聯	15,017,345,063	17,763,427,374	-1.63	19.54	4	
合計	62,889,258,047	74,994,012,960	-1.42	19.88	—	

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	113 年截至 1 月累積投資報酬(%)	委任迄今(112.4.6~113.1.31)		
				投資報酬率(%)	排名	目標報酬率(%)
復華	4,799,121,512	5,412,312,133	1.63	12.78	1	5.24
安聯	3,601,238,896	3,868,468,842	-0.32	7.42	2	
合計	8,400,360,408	9,280,780,975	0.81	10.48	—	

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	113 年截至 1 月累積投資報酬(%)	委任迄今(112.2.7~113.1.31)		
				投資報酬率(%)	排名	目標報酬率(%)
安聯	14,088,712,403	17,193,574,571	4.45	22.04	1	6.25
國泰	6,318,453,600	6,941,330,439	-1.99	9.86	4	
群益	6,382,621,945	7,361,198,505	-0.71	15.33	2	
滙豐	7,096,535,878	7,926,628,672	0.29	11.70	3	
合計	33,886,323,826	39,422,732,187	1.45	16.34	—	

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	113 年截至 1 月累積投資報酬(%)	委任迄今（112.10.24~113.1.31）		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率(%)
台新	8,254,694,051	9,144,177,480	-0.06	10.78	1	10.47
安聯	12,775,472,416	14,061,938,835	-0.19	10.07	5	
保德信	9,403,481,285	10,412,208,131	0.35	10.73	2	
統一	12,635,490,783	13,895,528,670	-0.39	9.97	6	
國泰	10,445,956,159	11,465,867,580	-0.16	9.76	7	
復華	7,235,716,436	7,971,926,710	-0.21	10.17	4	
群益	4,439,275,178	4,915,452,984	0.35	10.73	3	
合計	65,190,086,308	71,867,100,390	-0.09	10.24	—	

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

單位：新臺幣元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	113 年截至 1 月累積投資報酬(%)	委任迄今（108.5.24~113.1.31）		
				投資報酬率(%)	排名	目標報酬率(%)
安聯	6,000,000,000	10,614,551,481	4.65	84.89	1	28.07
施羅德	6,000,000,000	10,046,649,092	4.83	73.32	5	
統一	6,000,000,000	10,655,201,969	1.11	84.76	2	
野村	11,000,000,000	16,773,867,314	4.87	82.34	3	
國泰	11,000,000,000	16,905,950,230	1.52	76.67	4	
復華	6,000,000,000	8,869,973,201	1.70	56.58	6	
合計	46,000,000,000	73,866,193,287	3.11	76.23	—	

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	113 年截至 1 月累積投資報酬(%)	委任迄今（110.5.13~113.1.31）		
				投資報酬率（%）	排名	目標報酬率（%）
台新	8,000,000,000	9,373,641,659	0.69	17.17	2	15.81
安聯	8,000,000,000	9,149,074,344	2.04	14.36	4	
保德信	8,000,000,000	8,776,155,960	1.61	9.70	5	
國泰	8,000,000,000	9,698,874,476	2.41	21.24	1	
野村	8,000,000,000	9,359,495,054	4.73	16.99	3	
合計	40,000,000,000	46,357,241,493	2.29	15.89	—	

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	113 年截至 1 月累積投資報酬(%)	委任迄今（111.5.13~113.1.31）		
				投資報酬率（%）	排名	指標報酬率（%）
安聯	3,000,000,000	4,596,738,218	-1.48	47.80	3	57.68
保德信	3,000,000,000	4,652,764,617	-1.71	50.79	1	
野村	3,000,000,000	4,717,557,706	-1.10	49.54	2	
國泰	3,000,000,000	4,603,628,277	-1.49	47.35	4	
富邦	3,000,000,000	4,549,715,346	-1.32	44.62	5	
合計	15,000,000,000	23,120,404,164	-1.42	48.02	—	

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	113 年截至 1 月累積投資報酬(%)	委任迄今（110.12.15~113.1.31）		
				投資報酬率（%）	排名	目標報酬率（%）
安聯	6,000,000,000	6,757,551,931	3.63	9.86	3	13.34
保德信	6,000,000,000	7,200,915,624	1.64	16.52	1	
國泰	6,000,000,000	6,751,371,976	1.33	10.64	2	
第一金	6,000,000,000	6,609,654,534	0.16	6.45	6	
野村	6,000,000,000	6,675,696,773	4.72	6.98	5	
富邦	6,000,000,000	6,704,512,404	2.17	7.54	4	
合計	36,000,000,000	40,699,703,242	2.25	9.67	—	

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	113 年截至 1 月累積投資報酬(%)	委任迄今（112.10.5~113.1.31）		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率(%)
安聯	2,000,000,000	2,041,100,054	-0.21	2.06	7	2.06
施羅德	2,000,000,000	2,106,099,331	3.81	5.30	4	
國泰	2,000,000,000	2,203,620,424	1.05	10.18	1	
第一金	2,000,000,000	2,084,482,533	0.17	4.22	6	
野村	2,000,000,000	2,101,217,546	4.51	5.06	5	
華南永昌	2,000,000,000	2,147,962,556	1.56	7.40	2	
滙豐	2,000,000,000	2,107,733,185	0.94	5.39	3	
合計	14,000,000,000	14,792,215,629	1.67	5.66	—	

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。

2.舊制勞工退休基金

國內 98 年第二次委託經營(續約 4)

單位：新臺幣元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	113 年截至 1 月累積投資報酬(%)	委任迄今(111.1.28~113.1.31)		
				投資報酬率(%)	排名	目標報酬率(%)
富邦	12,256,867,963	12,931,765,900	2.81	5.51	2	12.26
統一	10,364,185,361	11,753,553,915	0.94	13.41	1	
合計	22,621,053,324	24,685,319,815	1.91	9.13	—	

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 4 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 101 年第一次委託經營(相對報酬)(續約 2)

單位：新臺幣元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	113 年截至 1 月累積投資報酬(%)	委任迄今(109.11.2~113.1.31)		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率(%)
匯豐	3,685,000,000	6,716,187,318	0.68	54.66	—	59.53

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 2)

單位：新臺幣元

投信名稱	委託金額	目前淨資產	113 年截至 1 月累積投資報酬(%)	委任迄今(109.05.04~113.1.31)		
				投資報酬率(%)	排名	目標報酬率(%)
野村	19,272,822,959	30,771,406,703	4.87	59.66	—	21.68

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 4 年年底股票集中市場平均殖利率加計 200 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	113 年截至 1 月累積投資報酬(%)	委任迄今 (112.4.6~113.1.31)		
				投資報酬率(%)	排名	目標報酬率(%)
復華	4,800,107,976	5,413,440,244	1.63	12.78	1	5.24
安聯	3,601,947,821	3,869,270,951	-0.32	7.42	2	
合計	8,402,055,797	9,282,711,195	0.81	10.48	—	

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。

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	113 年截至 1 月累積投資報酬(%)	委任迄今 (112.2.7~113.1.31)		
				投資報酬率(%)	排名	目標報酬率(%)
安聯	14,089,937,312	17,195,286,131	4.45	22.04	1	6.25
國泰	6,319,107,110	6,942,242,316	-1.99	9.86	4	
群益	6,384,957,618	7,364,534,182	-0.71	15.34	2	
滙豐	7,097,524,598	7,927,879,954	0.29	11.70	3	
合計	33,891,526,638	39,429,942,583	1.44	16.34	—	

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	113 年截至 1 月累積投資報酬(%)	委任迄今 (111.5.13~113.1.31)		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率(%)
安聯	1,000,000,000	1,532,370,792	-1.48	47.85	3	57.68
保德信	1,000,000,000	1,550,988,275	-1.71	50.79	1	
野村	1,000,000,000	1,572,598,211	-1.10	49.55	2	
國泰	1,000,000,000	1,534,659,517	-1.49	47.38	4	
富邦	1,000,000,000	1,516,554,915	-1.32	44.71	5	
合計	5,000,000,000	7,707,171,710	-1.42	48.06	—	

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	113 年截至 1 月累積投資報酬(%)	委任迄今（112.10.5~113.1.31）		
				投資報酬率(%)	排名	目標報酬率(%)
安聯	500,000,000	509,951,331	-0.18	1.99	7	2.06
施羅德	500,000,000	526,514,326	3.81	5.30	4	
國泰	500,000,000	550,856,113	1.05	10.17	1	
第一金	500,000,000	521,126,134	0.17	4.23	6	
野村	500,000,000	525,372,663	4.54	5.07	5	
華南永昌	500,000,000	537,132,215	1.58	7.43	2	
滙豐	500,000,000	526,938,450	0.94	5.39	3	
合計	3,500,000,000	3,697,891,232	1.68	5.65	—	

（二）113 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	113 年截至 1 月累積投資報酬(%)	委任迄今（110.6.7~113.1.31）		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率(%)
聯博	907,613,021	766,007,656	-1.38	-15.60	2	-15.85
富蘭克林坦伯頓	1,151,737,838	1,069,430,480	-1.73	-12.04	1	
合計	2,059,350,859	1,835,438,136	-1.58	-13.85	—	

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	113 年截至 1 月累積投資報酬(%)	委任迄今（111.1.6~113.1.31）		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率(%)
PIMCO	2,158,967,886	1,958,555,663	-1.90	-11.59	—	-12.69

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	113 年截至 1 月累積投資報酬(%)	委任迄今（111.2.6~113.1.31）		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率(%)
貝萊德	1,734,805,538	1,881,798,749	0.43	8.47	1	5.31
摩根	1,485,120,883	1,608,572,525	0.75	8.31	2	
合計	3,219,926,421	3,490,371,274	0.57	8.40	—	

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	113 年截至 1 月累積投資報酬(%)	委任迄今（111.11.17~113.1.31）		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率(%)
景順	656,507,639	678,605,674	-5.08	3.37	—	3.74

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	113 年截至 1 月累積投資報酬(%)	委任迄今（111.12.4~113.1.31）		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率(%)
貝萊德	1,141,092,316	1,330,577,973	0.59	18.02	2	17.58
道富	1,513,655,177	1,766,814,606	0.66	18.19	1	
合計	2,654,747,493	3,097,392,579	0.63	18.12	—	

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	113 年截至 1 月累積投資報酬(%)	委任迄今（110.7.1~113.1.31）		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率(%)
道富	934,565,605	1,044,712,197	0.01	11.79	1	10.51
貝萊德	939,726,931	1,049,270,434	-0.09	11.66	2	
合計	1,874,292,536	2,093,982,631	-0.04	11.72	—	

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	113 年截至 1 月累積投資報酬(%)	委任迄今（111.3.6~113.1.31）		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率(%)
Cohen & Steers	2,410,932,432	2,109,797,748	-4.14	-13.48	1	-14.98
景順	1,487,127,452	1,279,432,678	-4.60	-13.97	2	
合計	3,898,059,884	3,389,230,426	-4.31	-13.65	—	

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	113 年截至 1 月累積投資報酬(%)	委任迄今（111.7.31~113.1.31）		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率(%)
Pictet	618,843,493	684,027,103	-1.37	11.05	—	11.53

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	113 年截至 1 月累積投資報酬(%)	委任迄今（112.4.18~113.1.31）		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率(%)
道富	1,113,392,347	1,166,446,600	1.63	4.77	2	4.41
貝萊德	1,132,011,599	1,188,069,477	1.63	4.95	1	
合計	2,245,403,946	2,354,516,077	1.63	4.86	—	

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	113 年截至 1 月累積投資報酬(%)	委任迄今（113.1.22~113.1.31）		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率(%)
瑞萬通博	1,716,000,834	1,731,399,670	0.90	0.90	3	1.68
MFS	1,114,480,846	1,136,184,925	1.95	1.95	1	
威靈頓	1,427,914,919	1,448,674,376	1.45	1.45	2	
合計	4,258,396,599	4,316,258,971	1.36	1.36	—	

102-1 全球信用主動債券型 （續約）

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	113 年截至 1 月累積投資報酬(%)	委任迄今（108.4.25~113.1.31）		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率(%)
RBC	1,036,338,464	1,112,394,403	-0.28	11.54	1	2.13
貝萊德	687,231,657	684,158,603	-0.78	2.42	3	
盧米斯	892,703,100	912,925,644	-0.77	5.18	2	
合計	2,616,273,221	2,709,478,650	-0.57	6.30	—	

104-1 全球高品質被動股票型（續約）

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	113 年截至 1 月累積投資報酬(%)	委任迄今（109.8.11~113.1.31）		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率(%)
北美信託	1,696,617,127	2,345,594,698	2.58	45.29	2	43.96
LGIM	1,705,083,447	2,351,639,981	2.60	45.05	3	
Geode	1,675,075,832	2,323,931,186	2.58	45.52	1	
合計	5,076,776,406	7,021,165,865	2.58	45.29	—	

104-2 全球基礎建設有價證券型（續約）

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	113 年截至 1 月累積投資報酬(%)	委任迄今（109.9.25~113.1.31）		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率(%)
Magellan	1,437,520,518	1,706,106,691	-1.66	18.68	2	23.82
RREEF	926,848,763	1,132,920,396	-2.96	22.23	1	
合計	2,364,369,281	2,839,027,087	-2.18	20.08	—	

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	113 年截至 1 月累積投資報酬(%)	委任迄今（109.11.13~113.1.31）		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率(%)
Brandywine	821,176,083	713,797,896	-3.17	-14.77	2	-15.47
盧米斯	471,104,127	429,377,728	-2.12	-12.02	1	
合計	1,292,280,210	1,143,175,624	-2.78	-13.89	—	

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	113 年截至 1 月累積投資報酬(%)	委任迄今（110.7.20~113.1.31）		
				投資報酬率(%)	排名	指標/目標報酬率(%)
Allianz	578,698,278	574,776,201	0.33	-2.29	2	7.57/20.25
摩根	1,645,715,430	1,599,533,707	0.22	-2.81	3	
DWS	975,711,371	1,018,384,011	0.35	4.14	1	
柏瑞	765,326,657	704,642,546	-0.72	-7.93	4	
合計	3,965,451,736	3,897,336,465	0.10	-2.09	—	

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	113 年截至 1 月累積投資報酬(%)	委任迄今（110.8.24~113.1.31）		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率(%)
貝萊德	949,175,052	932,013,441	-0.49	-1.81	—	-1.50

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	113 年截至 1 月累積投資報酬(%)	委任迄今（111.6.22~113.1.31）		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率(%)
貝萊德	601,552,002	727,669,079	0.84	23.01	4	22.54
DWS	648,715,051	805,010,380	1.06	24.37	1	
道富	749,045,562	905,258,037	1.05	24.34	2	
北美信託	702,047,560	851,468,417	0.97	23.07	3	
合計	2,701,360,175	3,289,405,913	0.98	23.72	—	

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	113 年截至 1 月累積投資報酬(%)	委任迄今（111.7.25~113.1.31）		
				投資報酬率(%)	排名	指標/目標報酬率(%)
American Century	427,360,620	456,855,414	0.21	6.90	3	7.07/10.88
富達	965,211,657	1,080,613,460	0.22	11.96	1	
TCW	1,039,618,153	1,117,425,180	0.40	7.47	2	
合計	2,432,190,430	2,654,894,054	0.29	9.20	—	

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	113 年截至 1 月累積投資報酬(%)	委任迄今（113.1.23~113.1.31）		
				投資報酬率(%)	排名	指標/目標報酬率(%)
景順	786,698,949	789,900,842	0.41	0.41	3	0.13/0.25
威靈頓	787,219,463	788,638,081	0.18	0.18	4	
CPR	778,885,217	787,427,638	1.10	1.10	1	
道富	706,462,703	711,870,220	0.77	0.77	2	
合計	3,059,266,332	3,077,836,781	0.61	0.61	—	

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

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	113 年截至 1 月累積投資報酬(%)	委任迄今（108.12.18~113.1.31）		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率(%)
Amundi	400,000,000	457,646,373	-0.61	5.09	4	7.88
DWS	400,000,000	426,103,137	-2.63	0.02	5	
Nomura	400,000,000	507,597,101	-2.14	17.21	3	
荷寶	300,000,000	422,563,679	-0.02	23.71	1	
道富	300,000,000	412,499,549	-0.28	19.81	2	
合計	1,800,000,000	2,226,409,839	-1.18	12.40	—	

109-1 全球美元公司增值債券型

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	113 年截至 1 月累積投資報酬(%)	委任迄今（110.1.13~113.1.31）		
				投資報酬率（%）	排名	指標報酬率（%）
DWS	600,000,000	584,951,407	-0.09	-8.42	4	-7.59
INSIGHT	700,000,000	701,165,548	0.20	-6.75	1	
摩根	400,000,000	375,008,824	0.02	-8.08	3	
PIMCO	480,000,000	460,000,127	0.03	-8.03	2	
WESTERN	400,000,000	370,228,587	-0.12	-8.92	5	
合計	2,580,000,000	2,491,354,493	0.03	-8.03	—	

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	113 年截至 1 月累積投資報酬(%)	委任迄今（110.9.8~113.1.31）		
				投資報酬率（%）	排名	指標報酬率（%）
CBRE	350,000,000	339,201,460	-3.38	-2.56	2	-2.06
Clearbridge	450,000,000	443,784,250	-3.11	0.74	1	
Magellan	350,000,000	338,657,672	-2.62	-4.70	4	
RREEF	350,000,000	334,182,535	-2.24	-4.20	3	
合計	1,500,000,000	1,455,825,917	-2.86	-2.60	—	

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	113 年截至 1 月累積投資報酬(%)	委任迄今（110.10.15~113.1.31）		
				投資報酬率(%)	排名	指標/目標報酬率(%)
富達	400,000,000	360,468,058	0.08	-10.25	5	7.56/19.05
摩根	400,000,000	382,298,278	0.22	-4.60	4	
Ninety One	400,000,000	396,904,905	-2.13	-1.30	1	
Schroders	400,000,000	395,182,694	0.35	-1.61	2	
T. Rowe Price	400,000,000	391,246,121	0.17	-3.34	3	
合計	2,000,000,000	1,926,100,056	-0.28	-4.21	—	

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	113 年截至 1 月累積投資報酬(%)	委任迄今（112.4.28~113.1.31）		
				投資報酬率(%)	排名	指標/目標報酬率(%)
匯豐	200,000,000	221,827,423	0.99	13.81	3	13.92
LGIM	200,000,000	221,902,560	0.61	13.42	4	
摩根士坦利	200,000,000	218,190,469	0.32	10.87	5	
Schroders	200,000,000	222,850,088	1.25	15.22	2	
威靈頓	200,000,000	224,783,315	1.77	15.65	1	
合計	1,000,000,000	1,109,553,855	0.99	13.79	—	

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	113 年截至 1 月累積投資報酬(%)	委任迄今(112.7.19~113.1.31)		
				投資報酬率(%)	排名	指標/目標報酬率(%)
盧米斯	300,000,000	315,870,673	0.68	5.20	1	2.83/4.18
Ninety One	300,000,000	316,043,147	0.65	4.21	4	
PIMCO	300,000,000	317,177,449	0.40	4.28	3	
PGIM	300,000,000	310,701,390	0.65	4.51	2	
T. Rowe Price	300,000,000	299,869,551	0.39	0.41	6	
威靈頓	300,000,000	306,070,992	0.76	2.90	5	
合計	1,800,000,000	1,865,733,202	0.59	3.60	—	

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。

2. 舊制勞工退休基金

96 國際平衡型(續約 3)

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	113 年截至 11 月累積投資報酬率(%)	委任迄今(108.6.24~113.1.31)		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率(%)
富達	686,579,222	918,669,109	-0.05	27.16	—	28.50

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	113 年截至 1 月累積投資報酬(%)	委任迄今(111.1.6~113.1.31)		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率(%)
PIMCO	1,003,724,736	886,520,322	-1.97	-11.68	1	-12.69
盧米斯	948,693,762	825,998,464	-1.52	-12.93	2	
合計	1,952,418,498	1,712,518,786	-1.76	-12.29	—	

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	113 年截至 1 月累積投資報酬(%)	委任迄今(111.2.6~113.1.31)		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率(%)
貝萊德	1,156,987,544	1,255,264,394	0.42	8.49	—	5.31

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	113 年截至 1 月累積投資報酬(%)	委任迄今(111.11.17~113.1.31)		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率(%)
景順	281,124,998	290,319,287	-5.07	3.27	—	3.74

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	113 年截至 1 月累積投資報酬(%)	委任迄今(111.3.6~113.1.31)		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率(%)
貝萊德	304,997,166	344,676,458	-0.07	13.01	3	11.87
道富	360,436,214	408,034,629	0.05	13.21	2	
瑞銀	308,879,836	349,908,330	-0.03	13.28	1	
Nomura	360,147,608	406,526,333	-0.14	12.88	4	
合計	1,334,460,824	1,509,145,750	-0.05	13.09	—	

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	113 年截至 1 月累積投資報酬(%)	委任迄今(112.4.18~113.1.31)		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率(%)
貝萊德	751,993,706	789,607,388	1.64	5.00	—	4.41

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	113 年截至 1 月累積投資報酬(%)	委任迄今 (113.1.22~113.1.31)		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率(%)
瑞萬通博	414,056,068	417,751,407	0.89	0.89	3	1.68
MFS	315,296,707	321,409,764	1.94	1.94	1	
威靈頓	704,502,355	714,740,836	1.45	1.45	2	
合計	1,433,855,129	1,453,902,007	1.40	1.40	—	

102-2 全球基礎建設有價證券型(續約)

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	113 年截至 1 月累積投資報酬(%)	委任迄今 (108.5.29~113.1.31)		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率(%)
Lazard	713,987,041	951,196,284	-0.31	34.24	—	16.63

102-2 全球不動產有價證券型（續約）

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	113 年截至 1 月累積投資報酬(%)	委任迄今 (108.8.27~113.1.31)		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率(%)
信安環球	610,886,182	624,492,300	-4.29	-1.11	2	-4.91
Macquarie	126,937,100	129,722,596	-3.56	2.19	1	
合計	737,823,282	754,214,896	-4.17	-0.49	—	

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	113 年截至 1 月累積投資報酬(%)	委任迄今(110.7.20~113.1.31)		
				投資報酬率(%)	排名	指標/目標報酬率(%)
Allianz	155,447,975	152,130,858	0.32	-2.13	2	7.57/20.25
摩根	594,592,070	580,080,073	0.23	-2.44	3	
DWS	311,387,682	324,494,214	0.34	4.21	1	
柏瑞	254,823,294	234,495,098	-0.72	-7.98	4	
合計	1,316,251,021	1,291,200,243	0.09	-1.90	—	

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	113 年截至 1 月累積投資報酬(%)	委任迄今(111.6.22~113.1.31)		
				投資報酬率(%)	排名	指標報酬率(%)
貝萊德	127,303,524	156,349,427	0.85	22.82	4	22.54
DWS	147,528,441	183,373,530	1.06	24.30	2	
道富	157,982,595	196,536,283	1.05	24.40	1	
北美信託	158,484,700	194,776,182	0.96	22.90	3	
合計	591,299,260	731,035,422	0.99	23.63	—	

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	113 年截至 1 月累積投資報酬(%)	委任迄今(111.7.25~113.1.31)		
				投資報酬率(%)	排名	指標/目標報酬率(%)
American Century	319,635,794	341,700,915	0.21	6.90	3	7.07/10.88
富達	299,785,344	337,111,129	0.30	12.45	1	
TCW	328,000,470	352,911,101	0.42	7.59	2	
合計	947,421,608	1,031,723,145	0.31	8.90	—	

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	113 年截至 1 月累積投資報酬(%)	委任迄今 (113.1.23~113.1.31)		
				投資報酬率(%)	排名	指標/目標報酬率(%)
景順	116,977,839	117,456,318	0.41	0.41	2	0.13/0.25
威靈頓	107,476,614	107,669,696	0.18	0.18	3	
CPR	115,110,097	116,371,993	1.10	1.10	1	
合計	339,564,550	341,498,007	0.57	0.57	—	

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	113 年截至 1 月累積投資報酬(%)	委任迄今 (110.9.8~113.1.31)		
				投資報酬率(%)	排名	指標/目標報酬率(%)
CBRE	30,000,000	29,249,421	-3.39	-2.50	2	-2.06
ClearBridge	30,000,000	30,260,800	-3.11	0.87	1	
Magellan	30,000,000	28,756,028	-2.63	-4.15	4	
RREEF	30,000,000	28,915,502	-2.23	-3.62	3	
合計	120,000,000	117,181,751	-2.85	-2.35	—	

(二)113 年度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）

113 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）

113 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
113 年 1 月份	54,433,663,069	115,851,748,041	61,418,084,972

(二)舊制勞工退休基金

單位：新臺幣元

	餘絀	收入	支出
113 年 1 月份	11,053,314,622	15,122,513,943	4,069,199,321

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

113 年 1 月份　　單位：新臺幣元

項　　目	金　　額
現金收入	140,014,319,334
現金支出	148,545,004,363
現金增(減)數	-8,530,685,029

(二)舊制勞工退休基金

113 年 1 月份　　單位：新臺幣元

項　　目	金　　額
現金收入	31,002,145,565
現金支出	31,001,936,830
現金增(減)數	208,735