

## 勞工退休基金運用情形

### 一、勞工退休基金 97 年 1 月迄今整體績效

截至 104 年 5 月底

|      |         |
|------|---------|
| 新制基金 | 3.2721% |
| 舊制基金 | 3.0653% |

註：舊制基金自 76 年 6 月之績效為 5.0140%

### 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

單位：新台幣萬元

| 至 104 年 5 月底止基金規模與收益          |      |                         |
|-------------------------------|------|-------------------------|
| 基金運用規模                        |      | 1 兆 3,712 億 8,102 萬元    |
| 104 年截至 5 月底止<br>運用總損益及評價後報酬率 | 自行運用 | 24 億 2,470 萬元<br>0.41%  |
|                               | 委託經營 | 167 億 9,893 萬元<br>2.25% |
|                               | 合 計  | 192 億 2,363 萬元<br>1.44% |

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÷104 年之日平均餘額）列示。

註 3：104 年 5 月之保證收益率為 1.3916%。

## 2. 舊制勞工退休基金

單位：新台幣萬元

| 至 104 年 5 月底止基金規模與收益          |      |                         |
|-------------------------------|------|-------------------------|
| 基金運用規模                        |      | 6,390 億 194 萬元          |
| 104 年截至 5 月底止<br>運用總損益及評價後報酬率 | 自行運用 | 61 億 9,380 萬元<br>2.04%  |
|                               | 委託經營 | 79 億 6,759 萬元<br>2.77%  |
|                               | 合 計  | 141 億 6,139 萬元<br>2.39% |

註：評價後報酬率係以當期報酬率（即收益÷104 年之日平均餘額）列示

## （二）資產配置

### 1. 新制勞工退休基金

截至 104 年 5 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>621,130,050,010</b>   | <b>45.30</b>  |
| 轉存金融機構         | 188,713,913,814          | 13.76         |
| 短期票券           | 62,034,911,858           | 4.52          |
| 公債、公司債及金融債券    | 181,955,890,120          | 13.27         |
| 貨幣型基金          | 0                        | 0.00          |
| 股票及受益憑證投資（含期貨） | 33,178,642,435           | 2.42          |
| 國外投資           | 155,246,691,783          | 11.33         |
| 固定收益           | 127,479,326,928          | 9.30          |
| 權益證券           | 20,039,119,916           | 1.46          |
| 另類投資           | 7,728,244,939            | 0.57          |
| <b>委託經營</b>    | <b>750,150,971,678</b>   | <b>54.70</b>  |
| 國內委託經營         | 273,017,196,527          | 19.91         |
| 國外委託經營         | 477,133,775,151          | 34.79         |
| 固定收益           | 169,181,156,787          | 12.33         |
| 權益證券           | 252,561,889,502          | 18.42         |
| 另類投資           | 55,390,728,862           | 4.04          |
| <b>合 計</b>     | <b>1,371,281,021,688</b> | <b>100.00</b> |

## 2. 舊制勞工退休基金

截至 104 年 5 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>348,597,823,418</b> | <b>54.55</b>  |
| 轉存金融機構            | 113,700,382,542        | 17.79         |
| 短期票券              | 20,889,329,530         | 3.27          |
| 公債、金融債券、公司債及證券化商品 | 78,727,298,196         | 12.32         |
| 股票及受益憑證投資(含期貨)    | 68,552,224,701         | 10.73         |
| 國外投資              | 66,728,588,449         | 10.44         |
| 固定收益              | 36,208,278,842         | 5.67          |
| 權益證券              | 24,638,216,565         | 3.85          |
| 另類投資              | 5,882,093,042          | 0.92          |
| <b>委託經營</b>       | <b>290,404,114,884</b> | <b>45.45</b>  |
| 國內委託經營            | 125,720,398,258        | 19.67         |
| 國外委託經營            | 164,683,716,626        | 25.78         |
| 固定收益              | 54,233,656,636         | 8.49          |
| 權益證券              | 97,846,823,924         | 15.32         |
| 另類投資              | 12,603,236,066         | 1.97          |
| <b>合 計</b>        | <b>639,001,938,302</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 104 年 5 月底

單位：新台幣元

| 項 目     | 金 額             | 占基金運用比例（%） |
|---------|-----------------|------------|
| 自 行 運 用 | 621,130,050,010 | 45.30      |
| 委 託 經 營 | 750,150,971,678 | 54.70      |

#### 2. 舊制勞工退休基金

截至 104 年 5 月底

單位：新台幣元

| 項 目     | 金 額             | 占基金運用比例（%） |
|---------|-----------------|------------|
| 自 行 運 用 | 348,597,823,418 | 54.55      |
| 委 託 經 營 | 290,404,114,884 | 45.45      |

#### (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 104 年 5 月底

單位：新台幣元

| 項 目     | 金 額             | 占基金運用比例（%） |
|---------|-----------------|------------|
| 國 內 投 資 | 738,900,554,754 | 53.88      |
| 國 外 投 資 | 632,380,466,934 | 46.12      |

##### 2. 舊制勞工退休基金

截至 104 年 5 月底

單位：新台幣元

| 項 目     | 金 額             | 占基金運用比例（%） |
|---------|-----------------|------------|
| 國 內 投 資 | 407,589,633,227 | 63.78      |
| 國 外 投 資 | 231,412,305,075 | 36.22      |

### 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 104 年 5 月底

| 項 目    | 收益率（%） |
|--------|--------|
| 國內權益證券 | 6.01   |

##### 2. 舊制勞工退休基金

截至 104 年 5 月底

| 項 目    | 收益率（%） |
|--------|--------|
| 國內權益證券 | 7.99   |

#### (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 104 年 5 月底

單位：新台幣元

| 項 目    | 金 額            | 比 例（%） |
|--------|----------------|--------|
| 國內權益證券 | 33,178,642,435 | 2.42   |

##### 2. 舊制勞工退休基金

截至 104 年 5 月底

單位：新台幣元

| 項 目    | 金 額            | 比 例（%） |
|--------|----------------|--------|
| 國內權益證券 | 68,552,224,701 | 10.73  |

註：不含貨幣型基金

#### 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 2）

單位：新台幣元

| 投信<br>名稱 | 委託金額          | 目前淨資產         | 104 年截至 5 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(102.9.27~104.5.31) |            |              |
|----------|---------------|---------------|--------------------------|-----------------------------|------------|--------------|
|          |               |               |                          | 投資報<br>酬率<br>(%)            | 委託經<br>營排名 | 大盤報酬<br>率(%) |
| 野村       | 7,804,845,205 | 9,913,522,311 | 6.90                     | 27.02                       | —          | 18.53        |

##### 97 年第一次委託經營（續約 2）

單位：新台幣元

| 投信<br>名稱 | 委託金額          | 目前淨資產         | 104 年截至 5 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(103.1.20~104.5.31) |            |              |
|----------|---------------|---------------|--------------------------|-----------------------------|------------|--------------|
|          |               |               |                          | 投資報<br>酬率<br>(%)            | 委託經<br>營排名 | 大盤報酬<br>率(%) |
| 野村       | 5,783,138,827 | 7,160,377,785 | 6.88                     | 23.81                       | —          | 12.86        |

##### 98 年第一次委託經營（續約）

單位：新台幣元

| 投信<br>名稱 | 委託金額          | 目前淨資產         | 104 年截至 5 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(101.7.14~104.5.31) |            |              |
|----------|---------------|---------------|--------------------------|-----------------------------|------------|--------------|
|          |               |               |                          | 投資報<br>酬率<br>(%)            | 委託經<br>營排名 | 大盤報酬<br>率(%) |
| 野村       | 3,421,364,679 | 4,836,393,723 | 6.95                     | 41.36                       | 1          | 36.55        |
| 保德信      | 3,423,163,553 | 4,504,607,808 | 4.19                     | 31.59                       | 2          |              |
| 合計       | 6,844,528,232 | 9,341,001,531 | 5.60                     | 36.47                       | —          |              |

## 98 年第一次委託經營（續約）A 帳戶

單位：新台幣元

| 投信<br>名稱 | 委託金額          | 目前淨資產         | 104 年截至 5 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(103.12.1~104.5.31) |            |              |
|----------|---------------|---------------|--------------------------|-----------------------------|------------|--------------|
|          |               |               |                          | 投資報<br>酬率<br>(%)            | 委託經<br>營排名 | 大盤報酬<br>率(%) |
| 野村       | 5,579,000,000 | 5,958,325,478 | 6.34                     | 6.80                        | —          | 5.59         |

## 99 年第一次委託經營（續約）

單位：新台幣元

| 投信<br>名稱 | 委託金額          | 目前淨資產         | 104 年截至 5 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(102.3.9~104.5.31) |            |              |
|----------|---------------|---------------|--------------------------|----------------------------|------------|--------------|
|          |               |               |                          | 投資報<br>酬率<br>(%)           | 委託經<br>營排名 | 大盤報酬<br>率(%) |
| 保德信      | 7,790,534,548 | 9,385,811,240 | 5.32                     | 20.48                      | —          | 21.03        |

## 99 年第二次委託經營（續約）

單位：新台幣元

| 投信<br>名稱 | 委託金額          | 目前淨資產         | 104 年截至 5 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(103.12.1~104.5.31) |            |              |
|----------|---------------|---------------|--------------------------|-----------------------------|------------|--------------|
|          |               |               |                          | 投資報<br>酬率<br>(%)            | 委託經<br>營排名 | 大盤報酬<br>率(%) |
| 國泰       | 6,366,621,977 | 6,718,309,182 | 3.92                     | 5.52                        | —          | 5.59         |



## 100 年第一次委託經營(相對報酬)

單位：新台幣元

| 投信<br>名稱 | 委託金額           | 目前淨資產          | 104 年截至 5 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(100.7.15~104.5.31) |        |                 |
|----------|----------------|----------------|--------------------------|-----------------------------|--------|-----------------|
|          |                |                |                          | 投資報酬率(%)                    | 委託經營排名 | 大盤/指標報酬率(%)     |
| 富邦       | 5,000,000,000  | 7,121,342,230  | 6.26                     | 27.92                       | 3      | 14.38/<br>34.18 |
| 復華       | 11,294,673,623 | 15,099,725,821 | 7.14                     | 31.50                       | 1      |                 |
| 滙豐中華     | 12,034,391,172 | 16,069,168,283 | 6.45                     | 31.01                       | 2      |                 |
| 合計       | 28,329,064,795 | 38,290,236,334 | 6.68                     | 30.16                       | —      |                 |

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 年第二次委託經營第一期

單位：新台幣元

| 投信<br>名稱 | 委託金額           | 目前淨資產          | 104 年截至 5 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(100.8.10~104.5.31) |        |          |
|----------|----------------|----------------|--------------------------|-----------------------------|--------|----------|
|          |                |                |                          | 投資報酬率(%)                    | 委託經營排名 | 大盤報酬率(%) |
| 保德信      | 3,000,000,000  | 3,824,309,647  | 4.07                     | 27.48                       | 2      | 29.47    |
| 統一       | 3,000,000,000  | 3,745,037,628  | 6.95                     | 24.83                       | 3      |          |
| 富邦       | 3,000,000,000  | 3,338,859,669  | 3.58                     | 11.30                       | 5      |          |
| 復華       | 3,000,000,000  | 4,070,990,988  | 6.86                     | 35.70                       | 1      |          |
| 摩根       | 3,000,000,000  | 3,515,122,663  | 6.86                     | 17.17                       | 4      |          |
| 合計       | 15,000,000,000 | 18,494,320,595 | 5.69                     | 23.30                       | —      |          |

## 100 年第二次委託經營第二期

單位：新台幣元

| 投信<br>名稱 | 委託金額           | 目前淨資產          | 104 年截至 5 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(100.11.23~104.5.31) |            |              |
|----------|----------------|----------------|--------------------------|------------------------------|------------|--------------|
|          |                |                |                          | 投資報酬<br>率(%)                 | 委託經<br>營排名 | 大盤報<br>酬率(%) |
| 保德信      | 2,000,000,000  | 2,606,472,335  | 4.11                     | 30.32                        | 3          | 38.59        |
| 統一       | 2,000,000,000  | 2,660,055,174  | 7.02                     | 33.00                        | 2          |              |
| 富邦       | 2,000,000,000  | 2,373,316,857  | 3.47                     | 18.67                        | 5          |              |
| 復華       | 2,000,000,000  | 2,896,882,646  | 6.91                     | 44.84                        | 1          |              |
| 滙豐中華     | 2,000,000,000  | 2,438,064,448  | 1.99                     | 21.90                        | 4          |              |
| 摩根       | 2,000,000,000  | 2,356,328,037  | 6.85                     | 17.82                        | 6          |              |
| 合計       | 12,000,000,000 | 15,331,119,497 | 5.09                     | 27.76                        | —          |              |

## 100 年第二次委託經營 A 帳戶

單位：新台幣元

| 投信<br>名稱 | 委託金額          | 目前淨資產         | 104 年截至 5 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(102.4.22~104.5.31) |            |              |
|----------|---------------|---------------|--------------------------|-----------------------------|------------|--------------|
|          |               |               |                          | 投資報酬<br>率(%)                | 委託經<br>營排名 | 大盤報<br>酬率(%) |
| 復華       | 4,511,827,956 | 5,614,833,276 | 6.29                     | 24.45                       | —          | 22.32        |

## 100 年第二次委託經營 B 帳戶

單位：新台幣元

| 投信<br>名稱 | 委託金額          | 目前淨資產         | 104 年截至 5 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(103.8.6~104.5.31) |            |              |
|----------|---------------|---------------|--------------------------|----------------------------|------------|--------------|
|          |               |               |                          | 投資報酬<br>率(%)               | 委託經<br>營排名 | 大盤報<br>酬率(%) |
| 復華       | 5,480,000,000 | 5,826,084,602 | 6.06                     | 6.32                       | —          | 6.12         |

## 101 年第一次委託經營(相對報酬)

單位：新台幣元

| 投信<br>名稱 | 委託金額           | 目前淨資產          | 104 年截至 5 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(101.4.18~104.5.31) |            |                     |
|----------|----------------|----------------|--------------------------|-----------------------------|------------|---------------------|
|          |                |                |                          | 投資報酬<br>率(%)                | 委託經<br>營排名 | 大盤/指<br>標報酬<br>率(%) |
| 國泰       | 4,500,000,000  | 5,939,578,982  | 7.31                     | 39.34                       | 1          | 27.88/<br>40.76     |
| 滙豐中華     | 9,546,945,283  | 11,841,325,636 | 5.43                     | 38.55                       | 2          |                     |
| 合計       | 14,046,945,283 | 17,780,904,618 | 6.05                     | 38.30                       | —          |                     |

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

單位：新台幣元

| 投信<br>名稱 | 委託金額           | 目前淨資產          | 104 年截至 5 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(101.7.16~104.5.31) |            |              |
|----------|----------------|----------------|--------------------------|-----------------------------|------------|--------------|
|          |                |                |                          | 投資報酬<br>率(%)                | 委託經<br>營排名 | 大盤報<br>酬率(%) |
| 野村       | 5,000,000,000  | 6,949,388,930  | 6.92                     | 38.99                       | 2          | 36.55        |
| 保德信      | 5,000,000,000  | 6,291,129,912  | 7.37                     | 25.82                       | 5          |              |
| 國泰       | 5,000,000,000  | 6,651,326,350  | 6.79                     | 33.03                       | 3          |              |
| 統一       | 5,000,000,000  | 7,165,642,913  | 3.07                     | 43.31                       | 1          |              |
| 富邦       | 5,000,000,000  | 6,428,286,397  | 6.23                     | 28.57                       | 4          |              |
| 滙豐中華     | 5,000,000,000  | 6,147,799,908  | 1.92                     | 22.96                       | 6          |              |
| 合計       | 30,000,000,000 | 39,633,574,410 | 5.34                     | 32.11                       | —          |              |

## 101 年第二次委託經營 A 帳戶

單位：新台幣元

| 投信<br>名稱 | 委託金額          | 目前淨資產         | 104 年截至 5 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(103.12.1~104.5.31) |            |              |
|----------|---------------|---------------|--------------------------|-----------------------------|------------|--------------|
|          |               |               |                          | 投資報酬<br>率(%)                | 委託經<br>營排名 | 大盤報<br>酬率(%) |
| 統一       | 5,199,929,852 | 5,560,029,324 | 5.37                     | 6.93                        | —          | 5.59         |

## 102 年第一次委託經營第一期

單位：新台幣元

| 投信<br>名稱 | 委託金額           | 目前淨資產          | 104 年截至 5 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(102.6.7~104.5.31) |            |              |
|----------|----------------|----------------|--------------------------|----------------------------|------------|--------------|
|          |                |                |                          | 投資報酬<br>率(%)               | 委託經<br>營排名 | 大盤報<br>酬率(%) |
| 國泰       | 2,500,000,000  | 2,975,736,162  | 4.14                     | 19.03                      | 4          | 19.82        |
| 統一       | 2,500,000,000  | 3,289,437,377  | 8.53                     | 31.58                      | 1          |              |
| 復華       | 2,500,000,000  | 3,034,107,667  | 6.40                     | 21.36                      | 3          |              |
| 德盛安聯     | 2,500,000,000  | 3,077,103,290  | 8.12                     | 23.08                      | 2          |              |
| 摩根       | 2,500,000,000  | 2,853,883,127  | 4.34                     | 14.16                      | 5          |              |
| 合計       | 12,500,000,000 | 15,230,267,623 | 6.35                     | 21.84                      | —          |              |

## 102 年第一次委託經營第二期

單位：新台幣元

| 投信<br>名稱 | 委託金額           | 目前淨資產          | 104 年截至 5 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(102.11.22~104.5.31) |            |              |
|----------|----------------|----------------|--------------------------|------------------------------|------------|--------------|
|          |                |                |                          | 投資報酬<br>率(%)                 | 委託經<br>營排名 | 大盤報<br>酬率(%) |
| 國泰       | 2,500,000,000  | 2,740,093,579  | 3.96                     | 9.60                         | 5          | 19.77        |
| 統一       | 2,500,000,000  | 3,075,425,726  | 8.23                     | 23.02                        | 1          |              |
| 復華       | 2,500,000,000  | 2,960,567,702  | 6.19                     | 18.42                        | 3          |              |
| 德盛安聯     | 2,500,000,000  | 3,008,076,424  | 8.31                     | 20.32                        | 2          |              |
| 摩根       | 2,500,000,000  | 2,786,482,997  | 4.35                     | 11.46                        | 4          |              |
| 合計       | 12,500,000,000 | 14,570,646,428 | 6.26                     | 16.57                        | —          |              |

## 102 年第二次委託經營(相對報酬)

單位：新台幣元

| 投信<br>名稱 | 委託金額           | 目前淨資產          | 104 年截至 5 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(103.1.20~104.5.31) |            |                     |
|----------|----------------|----------------|--------------------------|-----------------------------|------------|---------------------|
|          |                |                |                          | 投資報酬<br>率(%)                | 委託經<br>營排名 | 大盤/指<br>標報酬<br>率(%) |
| 保德信      | 3,000,000,000  | 3,491,916,135  | 5.63                     | 16.40                       | 4          | 12.86/<br>16.32     |
| 統一       | 3,000,000,000  | 3,467,433,772  | 5.02                     | 15.58                       | 5          |                     |
| 富邦       | 3,000,000,000  | 3,440,999,949  | 6.74                     | 14.70                       | 6          |                     |
| 復華       | 3,000,000,000  | 3,647,466,641  | 6.37                     | 21.58                       | 2          |                     |
| 群益       | 3,000,000,000  | 3,676,812,806  | 10.57                    | 22.56                       | 1          |                     |
| 滙豐中華     | 3,000,000,000  | 3,506,618,476  | 5.72                     | 16.89                       | 3          |                     |
| 合計       | 18,000,000,000 | 21,231,247,779 | 6.68                     | 17.95                       | —          |                     |

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<br>名稱 | 委託金額           | 目前淨資產          | 104 年截至 5 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(103.8.11~104.5.31) |            |              |
|----------|----------------|----------------|--------------------------|-----------------------------|------------|--------------|
|          |                |                |                          | 投資報酬<br>率(%)                | 委託經<br>營排名 | 大盤報<br>酬率(%) |
| 國泰       | 7,000,000,000  | 7,404,780,003  | 5.35                     | 5.78                        | 3          | 6.77         |
| 統一       | 7,000,000,000  | 7,427,821,672  | 6.00                     | 6.11                        | 1          |              |
| 復華       | 7,000,000,000  | 7,421,776,282  | 6.75                     | 6.03                        | 2          |              |
| 合計       | 21,000,000,000 | 22,254,377,957 | 6.03                     | 5.97                        | —          |              |

## 103 年第一次委託經營第二期

單位：新台幣元

| 投信<br>名稱 | 委託金額           | 目前淨資產          | 104 年截至 5 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(103.10.8~104.5.31) |            |              |
|----------|----------------|----------------|--------------------------|-----------------------------|------------|--------------|
|          |                |                |                          | 投資報酬<br>率(%)                | 委託經<br>營排名 | 大盤報<br>酬率(%) |
| 台新       | 7,000,000,000  | 7,394,738,265  | 4.49                     | 5.64                        | 3          | 7.30         |
| 保德信      | 7,000,000,000  | 7,396,167,843  | 4.33                     | 5.66                        | 2          |              |
| 群益       | 7,000,000,000  | 7,585,164,796  | 8.28                     | 8.36                        | 1          |              |
| 合計       | 21,000,000,000 | 22,376,070,904 | 5.69                     | 6.55                        | —          |              |

## 104 年第一次委託經營第一期

單位：新台幣元

| 投信<br>名稱 | 委託金額           | 目前淨資產          | 104 年截至 5 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(104.3.31~104.5.31) |            |              |
|----------|----------------|----------------|--------------------------|-----------------------------|------------|--------------|
|          |                |                |                          | 投資報酬<br>率(%)                | 委託經<br>營排名 | 大盤報<br>酬率(%) |
| 永豐       | 2,500,000,000  | 2,521,544,647  | 0.86                     | 0.86                        | 5          | 1.88         |
| 國泰       | 2,500,000,000  | 2,522,994,709  | 0.92                     | 0.92                        | 4          |              |
| 統一       | 2,500,000,000  | 2,549,466,112  | 1.98                     | 1.98                        | 3          |              |
| 復華       | 2,500,000,000  | 2,552,561,687  | 2.10                     | 2.10                        | 2          |              |
| 匯豐中華     | 2,500,000,000  | 2,517,746,433  | 0.71                     | 0.71                        | 6          |              |
| 德盛安聯     | 2,500,000,000  | 2,572,533,782  | 2.90                     | 2.90                        | 1          |              |
| 合計       | 15,000,000,000 | 15,236,847,370 | 1.58                     | 1.58                        | —          |              |

## 2. 舊制勞工退休基金

### 國內 98 年第二次委託經營(續)

單位：新台幣元

| 投信名稱 | 委託金額           | 目前淨資產          | 104 年截至 5 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(102.1.26~104.5.31) |            |              |
|------|----------------|----------------|--------------------------|-----------------------------|------------|--------------|
|      |                |                |                          | 投資<br>報酬率(%)                | 委託經<br>營排名 | 大盤<br>報酬率(%) |
| 保德信  | 3,380,116,383  | 4,016,411,715  | 0.91                     | 18.82                       | 3          | 26.44        |
| 富邦   | 3,208,581,038  | 4,072,503,932  | 7.58                     | 26.93                       | 2          |              |
| 統一   | 3,514,321,648  | 4,850,309,070  | 7.89                     | 38.02                       | 1          |              |
| 合計   | 10,103,019,069 | 12,939,224,717 | 5.53                     | 28.07                       | —          |              |

### 國內 98 年第二次委託經營(續)增額

單位：新台幣元

| 投信名稱 | 委託金額          | 目前淨資產         | 104 年截至 5 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(103.10.22~104.5.31) |            |              |
|------|---------------|---------------|--------------------------|------------------------------|------------|--------------|
|      |               |               |                          | 投資<br>報酬率(%)                 | 委託經<br>營排名 | 大盤<br>報酬率(%) |
| 統一   | 3,000,000,000 | 3,156,867,091 | 3.88                     | 5.23                         | —          | 12.09        |

### 國內 100 年第一次委託經營(續)

單位：新台幣元

| 投信名稱 | 委託金額           | 目前淨資產          | 104 年截至 5 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(104.3.17~104.5.31) |            |              |
|------|----------------|----------------|--------------------------|-----------------------------|------------|--------------|
|      |                |                |                          | 投資<br>報酬率(%)                | 委託經<br>營排名 | 大盤<br>報酬率(%) |
| 群益   | 6,094,525,480  | 6,387,289,768  | 4.80                     | 4.80                        | 2          | 1.98         |
| 復華   | 6,134,978,456  | 6,307,807,505  | 2.82                     | 2.82                        | 3          |              |
| 統一   | 6,511,946,664  | 6,839,454,586  | 5.03                     | 5.03                        | 1          |              |
| 合計   | 18,741,450,600 | 19,534,551,859 | 4.23                     | 4.23                        | —          |              |

## 國內 101 年第一次委託經營(相對報酬)

單位：新台幣元

| 投信名稱 | 委託金額          | 目前淨資產         | 104 年截至 5 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(101.10.30~104.5.31) |            |                 |
|------|---------------|---------------|--------------------------|------------------------------|------------|-----------------|
|      |               |               |                          | 投資<br>報酬率(%)                 | 委託經<br>營排名 | 大盤/指標<br>報酬率(%) |
| 匯豐中華 | 2,163,012,619 | 2,732,792,875 | 5.73                     | 43.76                        | —          | 36.80/45.15     |

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

單位：新台幣元

| 投信名稱 | 委託金額           | 目前淨資產          | 104 年截至 5 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(101.4.30~104.5.31) |            |              |
|------|----------------|----------------|--------------------------|-----------------------------|------------|--------------|
|      |                |                |                          | 投資<br>報酬率(%)                | 委託經<br>營排名 | 大盤<br>報酬率(%) |
| 保德信  | 5,000,000,000  | 6,047,967,047  | 4.76                     | 20.96                       | 6          | 29.68        |
| 群益   | 5,000,000,000  | 6,404,090,232  | 8.36                     | 28.08                       | 3          |              |
| 匯豐中華 | 5,000,000,000  | 6,158,660,271  | 1.71                     | 23.17                       | 5          |              |
| 野村   | 5,000,000,000  | 7,188,185,868  | 8.23                     | 43.76                       | 1          |              |
| 國泰   | 5,000,000,000  | 6,273,674,106  | 4.42                     | 25.47                       | 4          |              |
| 統一   | 5,000,000,000  | 6,573,357,835  | 7.07                     | 31.47                       | 2          |              |
| 合計   | 30,000,000,000 | 38,645,935,359 | 5.80                     | 28.82                       | —          |              |

## 國內 101 年第二次委託經營增額

單位：新台幣元

| 投信名稱 | 委託金額           | 目前淨資產          | 104 年截至 5 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(103.10.22~104.5.31) |            |              |
|------|----------------|----------------|--------------------------|------------------------------|------------|--------------|
|      |                |                |                          | 投資<br>報酬率(%)                 | 委託經<br>營排名 | 大盤<br>報酬率(%) |
| 野村   | 5,000,000,000  | 5,589,062,821  | 7.94                     | 11.78                        | 1          | 12.09        |
| 統一   | 5,000,000,000  | 5,269,906,596  | 3.73                     | 5.40                         | 2          |              |
| 合計   | 10,000,000,000 | 10,858,969,417 | 5.86                     | 8.59                         | —          |              |



# 國內 102 年第一次委託經營第一期

單位：新台幣元

| 信名稱  | 委託金額           | 目前淨資產          | 104 年截至 5 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(102.6.7~104.5.31) |            |              |
|------|----------------|----------------|--------------------------|----------------------------|------------|--------------|
|      |                |                |                          | 投資<br>報酬率(%)               | 委託經<br>營排名 | 大盤<br>報酬率(%) |
| 德盛安聯 | 2,500,000,000  | 3,077,284,792  | 8.13                     | 23.09                      | 2          | 19.82        |
| 復華   | 2,500,000,000  | 3,034,325,851  | 6.40                     | 21.37                      | 3          |              |
| 國泰   | 2,500,000,000  | 2,975,931,558  | 4.14                     | 19.04                      | 4          |              |
| 摩根   | 2,500,000,000  | 2,854,074,895  | 4.34                     | 14.16                      | 5          |              |
| 統一   | 2,500,000,000  | 3,289,669,790  | 8.53                     | 31.59                      | 1          |              |
| 合計   | 12,500,000,000 | 15,231,286,886 | 6.35                     | 21.85                      | —          |              |

# 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          | 104 年截至 5 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(102.11.22~104.5.31) |            |              |
|------|----------------|----------------|--------------------------|------------------------------|------------|--------------|
|      |                |                |                          | 投資<br>報酬率(%)                 | 委託經<br>營排名 | 大盤<br>報酬率(%) |
| 德盛安聯 | 2,500,000,000  | 3,008,235,408  | 8.31                     | 20.33                        | 2          | 19.77        |
| 復華   | 2,500,000,000  | 2,960,732,227  | 6.20                     | 18.43                        | 3          |              |
| 國泰   | 2,500,000,000  | 2,740,242,981  | 3.96                     | 9.61                         | 5          |              |
| 摩根   | 2,500,000,000  | 2,786,638,512  | 4.35                     | 11.47                        | 4          |              |
| 統一   | 2,500,000,000  | 3,075,610,043  | 8.23                     | 23.02                        | 1          |              |
| 合計   | 12,500,000,000 | 14,571,459,171 | 6.26                     | 16.57                        | —          |              |

### 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         | 104 年截至 5 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(104.3.16~104.5.31) |            |              |
|------|---------------|---------------|--------------------------|-----------------------------|------------|--------------|
|      |               |               |                          | 投資<br>報酬率(%)                | 委託經<br>營排名 | 大盤<br>報酬率(%) |
| 統一   | 5,118,273,278 | 5,212,395,926 | 1.84                     | 1.84                        | —          | 1.27         |
| 合計   | 5,118,273,278 | 5,212,395,926 | 1.84                     | 1.84                        | —          |              |

### 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          | 104 年截至 5 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(104.3.31~104.5.31) |            |              |
|------|----------------|----------------|--------------------------|-----------------------------|------------|--------------|
|      |                |                |                          | 投資<br>報酬率(%)                | 委託經<br>營排名 | 大盤<br>報酬率(%) |
| 永豐   | 2,500,000,000  | 2,521,549,901  | 0.86                     | 0.86                        | 5          | 1.88         |
| 國泰   | 2,500,000,000  | 2,523,001,180  | 0.92                     | 0.92                        | 4          |              |
| 統一   | 2,500,000,000  | 2,549,476,201  | 1.98                     | 1.98                        | 3          |              |
| 復華   | 2,500,000,000  | 2,552,573,862  | 2.10                     | 2.10                        | 2          |              |
| 匯豐中華 | 2,500,000,000  | 2,517,754,409  | 0.71                     | 0.71                        | 6          |              |
| 德盛安聯 | 2,500,000,000  | 2,572,542,896  | 2.90                     | 2.90                        | 1          |              |
| 合計   | 15,000,000,000 | 15,236,898,449 | 1.58                     | 1.58                        | —          |              |

## (二) 104 年度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：新台幣元

| 投信名稱        | 收回日期       | 收回委託金額 | 經理人     | 收回理由                      |
|-------------|------------|--------|---------|---------------------------|
| 102-1<br>富邦 | 104. 3. 13 | 50 億   | 胡 ○ ○ 等 | 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：

單位：新台幣元

| 投信名稱        | 收回日期       | 收回委託金額 | 經理人     | 收回理由                      |
|-------------|------------|--------|---------|---------------------------|
| 102-1<br>富邦 | 104. 3. 13 | 50 億   | 胡 ○ ○ 等 | 委託經營投資契約第 23 條規定，收回全數委託資產 |

## 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：

| 投信名稱 | 懲處資訊                                                                            |
|------|---------------------------------------------------------------------------------|
| 群益投信 | 新制勞退基金102-2全權委託帳戶從事「非避險」證券相關商品交易，交易分析報告及交易決定書有未載明停損（利）點，與金管會規定不符，裁處糾正。(104/1/9) |

### 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 全球股票型（續約）

單位：美元

| 投信名稱 | 委託金額        | 目前淨資產       | 104 年截至 5 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(101.5.21~104.5.31) |    |          |
|------|-------------|-------------|--------------------------|-----------------------------|----|----------|
|      |             |             |                          | 投資報酬率(%)                    | 排名 | 指標報酬率(%) |
| 坦伯頓  | 500,000,000 | 766,292,158 | 6.41                     | 65.00                       | —  | 55.72    |

### 97-1 全球債券型（續約）

單位：美元

| 投信名稱 | 委託金額          | 目前淨資產         | 104 年截至 5 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(101.6.4~104.5.31) |    |          |
|------|---------------|---------------|--------------------------|----------------------------|----|----------|
|      |               |               |                          | 投資報酬率(%)                   | 排名 | 指標報酬率(%) |
| 聯博   | 750,000,000   | 741,503,325   | -2.98                    | -1.13                      | 2  | -1.80    |
| 高盛   | 400,000,000   | 385,206,828   | -3.11                    | -3.70                      | 3  |          |
| 坦伯頓  | 650,000,000   | 736,969,642   | -1.48                    | 13.38                      | 1  |          |
| 合計   | 1,800,000,000 | 1,863,679,795 | -2.42                    | 3.54                       | —  |          |

### 97-2 全球增值債券型（續約）

單位：美元

| 投信名稱 | 委託金額          | 目前淨資產         | 104 年截至 5 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(102.1.7~104.5.31) |    |          |
|------|---------------|---------------|--------------------------|----------------------------|----|----------|
|      |               |               |                          | 投資報酬率(%)                   | 排名 | 指標報酬率(%) |
| 太平洋  | 615,416,988   | 606,093,057   | -1.67                    | -1.52                      | 1  | -3.53    |
| 高盛   | 479,694,715   | 452,446,168   | -3.00                    | -5.68                      | 2  |          |
| 合計   | 1,095,111,703 | 1,058,539,225 | -2.24                    | -3.34                      | —  |          |

### 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         | 104 年截至 5 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(102.2.5~104.5.31) |    |          |
|------|---------------|---------------|--------------------------|----------------------------|----|----------|
|      |               |               |                          | 投資報酬率(%)                   | 排名 | 指標報酬率(%) |
| 貝萊德  | 584,277,868   | 752,180,155   | 6.26                     | 40.02                      | 1  | 28.96    |
| 摩根   | 587,857,352   | 770,240,366   | 4.96                     | 31.03                      | 2  |          |
| 合計   | 1,172,135,220 | 1,522,420,521 | 5.60                     | 34.81                      | —  |          |

### 98-1 亞太（日本除外）股票型（續約）

單位：美元

| 投信名稱 | 委託金額        | 目前淨資產       | 104 年截至 5 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(102.11.18~104.5.31) |    |          |
|------|-------------|-------------|--------------------------|------------------------------|----|----------|
|      |             |             |                          | 投資報酬率(%)                     | 排名 | 指標報酬率(%) |
| 景順   | 571,501,358 | 624,116,872 | 7.61                     | 11.40                        | —  | 10.09    |

### 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       | 104 年截至 5 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(102.12.2~104.5.31) |    |          |
|------|-------------|-------------|--------------------------|-----------------------------|----|----------|
|      |             |             |                          | 投資報酬率(%)                    | 排名 | 指標報酬率(%) |
| 貝萊德  | 299,329,552 | 334,718,132 | 5.27                     | 11.82                       | 2  | 11.40    |
| 道富   | 449,680,272 | 494,181,264 | 5.10                     | 11.84                       | 1  |          |
| 合計   | 749,009,824 | 828,899,396 | 5.18                     | 11.83                       | —  |          |

### 99-1 全球新興市場股票型（續約）

單位：美元

| 投信名稱  | 委託金額          | 目前淨資產         | 104 年截至 5 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(103.8.25~104.5.31) |    |          |
|-------|---------------|---------------|--------------------------|-----------------------------|----|----------|
|       |               |               |                          | 投資報酬率(%)                    | 排名 | 指標報酬率(%) |
| 摩根士丹利 | 403,049,882   | 375,515,122   | 4.72                     | -6.83                       | 2  | -4.94    |
| 瑞萬通博  | 716,993,858   | 676,816,459   | 1.77                     | -5.60                       | 1  |          |
| 合計    | 1,120,043,740 | 1,052,331,581 | 2.80                     | -6.05                       | —  |          |

## 100-1 全球基本面指數被動股票型

單位：美元

| 投信名稱 | 委託金額          | 目前淨資產         | 104 年截至 5 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(100.7.1~104.5.31、<br>100.7.13~104.5.31) |    |          |
|------|---------------|---------------|--------------------------|--------------------------------------------------|----|----------|
|      |               |               |                          | 投資報酬率(%)                                         | 排名 | 指標報酬率(%) |
| 道富   | 500,000,000   | 614,188,406   | 4.96                     | 35.62                                            | 2  | 34.15    |
| 貝萊德  | 500,000,000   | 623,428,804   | 5.07                     | 38.68                                            | 1  | 37.97    |
| 合計   | 1,000,000,000 | 1,237,617,211 | 5.02                     | 37.15                                            | —  | —        |

註：其中道富委託日 100.7.1，貝萊德委託日 100.7.13。

## 100-1 全球不動產股票型

單位：美元

| 投信名稱           | 委託金額          | 目前淨資產         | 104 年截至 5 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(101.3.6~104.5.31) |    |          |
|----------------|---------------|---------------|--------------------------|----------------------------|----|----------|
|                |               |               |                          | 投資報酬率(%)                   | 排名 | 指標報酬率(%) |
| Cohen & Steers | 550,000,000   | 690,495,109   | 3.96                     | 42.82                      | 1  | 34.80    |
| 景順             | 600,000,000   | 743,841,733   | 1.81                     | 39.95                      | 2  |          |
| EII            | 400,000,000   | 512,686,115   | 2.62                     | 34.71                      | 3  |          |
| 合計             | 1,550,000,000 | 1,947,022,958 | 2.78                     | 39.05                      | —  |          |

## 101-1 全球新興市場債券型

單位：美元

| 投信名稱    | 委託金額          | 目前淨資產         | 104 年截至 5 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(101.7.31~104.5.31) |    |          |
|---------|---------------|---------------|--------------------------|-----------------------------|----|----------|
|         |               |               |                          | 投資報酬率(%)                    | 排名 | 指標報酬率(%) |
| Ashmore | 300,000,000   | 285,547,972   | -0.51                    | -1.70                       | 1  | -0.55    |
| Bluebay | 300,000,000   | 280,664,929   | -2.07                    | -4.41                       | 3  |          |
| 實港      | 300,000,000   | 277,167,450   | -0.40                    | -5.87                       | 4  |          |
| Pictet  | 300,000,000   | 284,213,237   | -0.84                    | -3.42                       | 2  |          |
| 合計      | 1,200,000,000 | 1,127,593,588 | -0.96                    | -3.85                       | —  |          |

## 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         | 104 年截至 5 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(102.4.18~104.5.31) |    |          |
|------|---------------|---------------|--------------------------|-----------------------------|----|----------|
|      |               |               |                          | 投資報酬率(%)                    | 排名 | 指標報酬率(%) |
| 道富   | 500,000,000   | 575,562,473   | 5.08                     | 14.85                       | 1  | 14.48    |
| 貝萊德  | 500,000,000   | 573,721,250   | 5.09                     | 14.46                       | 2  |          |
| 合計   | 1,000,000,000 | 1,149,283,723 | 5.09                     | 14.65                       | —  |          |

## 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         | 104 年截至 5 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(103.1.22~104.5.31) |    |          |
|------|---------------|---------------|--------------------------|-----------------------------|----|----------|
|      |               |               |                          | 投資報酬率(%)                    | 排名 | 指標報酬率(%) |
| 瑞萬通博 | 500,000,000   | 546,655,845   | 4.77                     | 12.46                       | 1  | 5.18     |
| MFS  | 500,000,000   | 518,650,524   | 4.62                     | 7.30                        | 3  |          |
| 威靈頓  | 500,000,000   | 525,406,676   | 5.29                     | 9.24                        | 2  |          |
| 合計   | 1,500,000,000 | 1,590,713,044 | 4.89                     | 9.68                        | —  |          |

## 102-1 全球信用債券型

單位：美元

| 投信名稱    | 委託金額          | 目前淨資產         | 104 年截至 5 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(103.4.25~104.5.31) |    |          |
|---------|---------------|---------------|--------------------------|-----------------------------|----|----------|
|         |               |               |                          | 投資報酬率(%)                    | 排名 | 指標報酬率(%) |
| Bluebay | 400,000,000   | 390,373,260   | -1.23                    | -2.17                       | 2  | -2.01    |
| 貝萊德     | 400,000,000   | 390,467,622   | -1.55                    | -2.20                       | 3  |          |
| 盧米斯     | 400,000,000   | 391,497,378   | -1.45                    | -1.92                       | 1  |          |
| 合計      | 1,200,000,000 | 1,172,338,260 | -1.41                    | -2.10                       | —  |          |



## 2. 舊制勞工退休基金

### 96 年續約國外委託經營(平衡型)

單位：美元

| 投信名稱 | 委託金額        | 目前淨資產       | 104 年截至 5 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(100.6.21~104.5.31) |    |              |
|------|-------------|-------------|--------------------------|-----------------------------|----|--------------|
|      |             |             |                          | 投資<br>報酬率(%)                | 排名 | 指標<br>報酬率(%) |
| 富達國際 | 425,533,349 | 589,348,584 | 3.12                     | 36.10                       | -  | 34.58        |

### 97 年續約國外委託經營(全球增值債券型)

單位：美元

| 投信名稱 | 委託金額          | 目前淨資產         | 104 年截至 5 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(102.1.6~104.5.31) |    |              |
|------|---------------|---------------|--------------------------|----------------------------|----|--------------|
|      |               |               |                          | 投資<br>報酬率(%)               | 排名 | 指標<br>報酬率(%) |
| 太平洋  | 731,384,466   | 716,704,966   | -1.46                    | -2.01                      | 1  | -3.53        |
| 盧米斯  | 712,476,555   | 684,620,417   | -2.29                    | -3.91                      | 2  |              |
| 合計   | 1,443,861,021 | 1,401,325,383 | -1.86                    | -2.95                      | —  |              |

### 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       | 104 年截至 5 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(102.2.5~104.5.31) |    |              |
|------|-------------|-------------|--------------------------|----------------------------|----|--------------|
|      |             |             |                          | 投資<br>報酬率(%)               | 排名 | 指標<br>報酬率(%) |
| 貝萊德  | 384,953,368 | 538,867,992 | 6.22                     | 39.98                      | -  | 28.96        |

## 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       | 104 年截至 5 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(102.11.17~104.5.31) |    |              |
|------|-------------|-------------|--------------------------|------------------------------|----|--------------|
|      |             |             |                          | 投資<br>報酬率(%)                 | 排名 | 指標<br>報酬率(%) |
| 景順   | 262,187,756 | 293,228,806 | 6.86                     | 11.84                        | —  | 10.09        |

## 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         | 104 年截至 5 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(101.3.6~104.5.31) |    |              |
|------|---------------|---------------|--------------------------|----------------------------|----|--------------|
|      |               |               |                          | 投資<br>報酬率(%)               | 排名 | 指標<br>報酬率(%) |
| 貝萊德  | 300,000,000   | 380,525,629   | 5.06                     | 41.76                      | 3  | 41.22        |
| 道富   | 300,000,000   | 381,841,972   | 4.99                     | 42.52                      | 1  |              |
| 瑞銀環球 | 300,000,000   | 379,798,346   | 5.09                     | 41.73                      | 4  |              |
| 野村   | 300,000,000   | 381,130,988   | 5.19                     | 42.27                      | 2  |              |
| 合計   | 1,200,000,000 | 1,523,296,935 | 5.08                     | 42.07                      | —  |              |

## 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       | 104 年截至 5 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(102.6.13~104.5.31) |    |              |
|------|-------------|-------------|--------------------------|-----------------------------|----|--------------|
|      |             |             |                          | 投資<br>報酬率(%)                | 排名 | 指標<br>報酬率(%) |
| 貝萊德  | 300,000,000 | 339,914,568 | 5.09                     | 18.59                       | —  | 18.64        |

## 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       | 104 年截至 5 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(103.1.22~104.5.31) |    |              |
|------|-------------|-------------|--------------------------|-----------------------------|----|--------------|
|      |             |             |                          | 投資<br>報酬率(%)                | 排名 | 指標<br>報酬率(%) |
| 瑞萬通博 | 150,000,000 | 167,561,282 | 4.77                     | 12.52                       | 1  | 5.18         |
| MFS  | 150,000,000 | 159,782,048 | 4.60                     | 7.45                        | 3  |              |
| 威靈頓  | 150,000,000 | 162,345,736 | 5.26                     | 9.35                        | 2  |              |
| 合計   | 450,000,000 | 489,689,066 | 4.88                     | 9.77                        | —  |              |

## 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       | 104 年截至 5 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(103.5.29~104.5.31) |    |              |
|----------------|-------------|-------------|--------------------------|-----------------------------|----|--------------|
|                |             |             |                          | 投資<br>報酬率(%)                | 排名 | 指標<br>報酬率(%) |
| Lazard         | 100,000,000 | 101,265,752 | 2.19                     | 2.17                        | 2  | 2.60         |
| Cohen & Steers | 100,000,000 | 102,932,784 | 3.08                     | 3.93                        | 1  |              |
| 合計             | 200,000,000 | 204,198,536 | 2.64                     | 3.05                        | —  |              |

## 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       | 104 年截至 5 月<br>累積投資報酬(%) | 委任迄今<br>(103.8.27~104.5.31) |    |              |
|------|-------------|-------------|--------------------------|-----------------------------|----|--------------|
|      |             |             |                          | 投資<br>報酬率(%)                | 排名 | 指標<br>報酬率(%) |
| PGI  | 100,000,000 | 104,499,049 | 2.01                     | 4.06                        | 1  | 2.03         |
| AMP  | 100,000,000 | 103,841,649 | 3.13                     | 3.39                        | 2  |              |
| 合計   | 200,000,000 | 208,340,698 | 2.56                     | 3.73                        | —  |              |

## (二)104 年度被提前收回之國外委外投資帳戶

基金國外委外投資被提前收回帳戶經理人名單及收回原因

1. 新制勞工退休基金：無

2. 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)

104 年 5 月 31 日

1. 避險：

| 種類     | 避險比例  |
|--------|-------|
| 權益證券避險 | 0%    |
| 匯率避險   | 7.16% |

2. 投資：無

## (二)舊制勞工退休基金自營部位

(依交易目的)

104 年 5 月 31 日

### 1. 避險：

| 種類     | 避險比例  |
|--------|-------|
| 權益證券避險 | 0%    |
| 匯率避險   | 0.61% |

### 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             | 營業收入          | 營業支出           |
|-----------|----------------|---------------|----------------|
| 104 年 5 月 | -3,096,207,798 | 8,497,296,762 | 11,593,504,560 |

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         | 營業收入        | 營業支出        |
|-----------|------------|-------------|-------------|
| 104 年 5 月 | 16,335,665 | 141,853,251 | 125,517,586 |

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

104 年 5 月份

單位：新台幣元

| 項 目     | 金 額             |
|---------|-----------------|
| 基金收入    | 225,909,516,973 |
| 基金支出    | 220,462,314,136 |
| 現金增(減)數 | 5,447,202,837   |

註：本表採現金基礎。

### (二)舊制勞工退休基金

104 年 5 月份

單位：新台幣元

| 項 目     | 金 額            |
|---------|----------------|
| 基金收入    | 31,586,510,428 |
| 基金支出    | 31,586,627,280 |
| 現金增(減)數 | -116,852       |

註：本表採現金基礎。