

勞工退休基金運用情形報告（100 年截至 4 月底止）

根據最新數據顯示，美國4月ISM製造業指數由3月的61.2下降至60.4，惟仍高於市場預期；歐元區製造業採購經理人指數（PMI）由3月的57.5，微幅上升至58.0，顯示目前製造業生產仍在擴張。

國際貨幣基金（IMF）4月公布的「世界經濟展望報告」指出，全球經濟面臨之風險包含歐洲國家主權債信問題、房地產市場低迷、石油價格上揚及新興經濟體資本市場過熱等。亞洲開發銀行（ADB）也提出警告，糧食價格及原油價格之持續攀升，將減弱亞洲地區之經濟復甦力道。根據環球透視機構（Global Insight）4月預測資料，預測今年全球經濟成長3.5%，較2月預測之成長3.7%降低0.2個百分點，其中先進經濟體由2月預測2.4%降為2.1%，新興經濟體維持6.4%成長，中東與北非地區則由5.1%大幅調降為4.2%。惟4月份在就業情勢趨於樂觀，及企業獲利良好有利金融市場表現等正面因素支撐下，全球經濟呈現擴張態勢。

4月單月MSCI新興市場指數上升2.83%，台股上漲3.74%，累計自今年初以迄4月底表現則分別為4.57%及0.39%。觀諸勞工退休基金截至100年4月底止整體新、舊制基金規模為1兆1,917億8,688萬元，其中舊制基金規模為5,482億2,113萬元，新制基金規模為6,435億6,575萬元。100年度截至4月底止，整體基金評價後收益數為133億8,742萬元，收益率為1.1586%，較上（3）月底增加133億7,845萬元。

面對詭譎多變的金融市場，勞工退休基金監理會將密切關注全球經濟情勢變動，審慎規劃基金投資布局，在兼顧投資收益與風險控管下，追求基金長期穩定之收益。

勞退基金 100 年截至 4 月底止運用情形分述如次：

一、舊制勞工退休基金規模與運用情形

(一)、基金規模與收益

單位：新台幣萬元；%

至 100 年 4 月底止基金規模與收益		
基金運用規模		5,482 億 2,113 萬元
本年度運用總損益 (評價後報酬率)	自行運用	13 億 5,980 萬元 0.41(%)
	委託經營	32 億 5,427 萬元 1.60(%)
	合 計	46 億 1,407 萬元 0.86(%)

註：評價後報酬率係以當期報酬率（即收益÷100 年之日平均餘額）列示

(二)、截至 100 年 4 月底資產配置

單位：新台幣元；%

項 目	餘 額	占基金運用比例
自行運用	335,470,030,198	61.19%
轉存金融機構	141,939,859,598	25.89%
短期票券	42,644,256,166	7.78%
公債、金融債券、公司債及證券化商品	61,359,988,376	11.19%
政府機關及公營事業經建貸款	1,500,000,000	0.27%
股票及受益憑證投資(含期貨)	50,494,090,493	9.21%
國外投資	37,531,835,565	6.85%
固定收益類	27,425,826,182	5.00%
權益證券	10,106,009,383	1.85%
國內委託經營	140,128,192,734	25.56%
國外委託經營	72,622,902,634	13.25%
固定收益類	37,175,444,346	6.78%
權益證券	35,447,458,288	6.47%
合 計	548,221,125,566	100.00%

(三)、國內股票投資比率表(市價法)

類股持股比率(截至 100.4.30)

自行運用		委託經營	
類股	市值/餘額	類股	市值/餘額
水泥工業	2.07%	水泥工業	2.44%
食品工業	2.06%	食品工業	1.58%
塑膠工業	12.33%	塑膠工業	9.18%
紡織纖維	1.40%	紡織纖維業	1.14%
電機機械	0.00%	電機機械	2.25%
電器電纜股	0.00%	電器電纜股	0.17%
化學工業	1.43%	化學工業	2.54%
生技醫療業	0.00%	生技醫療業	1.11%
玻璃陶瓷	0.00%	玻璃陶瓷	0.40%
造紙工業	0.00%	造紙工業	0.27%
鋼鐵工業	4.21%	鋼鐵工業	0.79%
橡膠工業	1.52%	橡膠工業	4.24%
汽車工業	0.00%	汽車工業	1.02%
半導體業	15.35%	半導體業	14.09%
電腦及週邊	12.26%	電腦及週邊	5.39%
光電業	3.04%	光電業	12.80%
通信網路業	6.38%	通信網路業	9.78%
電子零組件業	4.69%	電子零組件業	4.32%
電子通路業	3.29%	電子通路業	1.23%
資訊服務業	0.00%	資訊服務業	0.08%
其他電子業	4.27%	其他電子業	3.65%
建材營造	0.00%	建材營造	1.05%
航運業	0.00%	航運業	3.52%
觀光事業	0.45%	觀光事業	0.16%
金融保險	10.33%	金融保險	13.76%
貿易百貨	0.55%	貿易百貨	0.92%
油電燃氣業	1.68%	油電燃氣業	0.53%
其他	0.42%	其他	1.59%
開放型基金	0.00%		
ETF	12.27%		
合計	100.00%	合計	100.00%

註：社會責任投資(SRI)：本基金投資於遠見雜誌與天下雜誌等機構所評比遴選出之企業社會責任(CSR)得獎名單，計有 69.57%。

(四)、國內委託經營各受託投信績效統計

國內委託經營

單位：新台幣 億元

委託批次 (委託日期)	原委託金額	目前委託金額
98年委託經營 (98.4.28)	300 億元	300 億元
95年續約 (98.6.21)	30 億元	30 億元
98年第二次委託經營 (99.1.26)	300 億元	300 億元
99年第一次委託經營 (99.8.13)	320 億元	320 億元
97年續約(100.3.17)	102 億元	102 億元
100年第一次委託經營 (100.3.17)	300 億元	300 億元
合 計	1,352 億元	1,352 億元

98年委託經營

單位：新台幣元；%

投 信 名 稱	目 前 淨 資 產	投資報酬率（%）	
		本年截至4月 (100.1.1~100.4.30)	委任迄今 (98.4.28~100.4.30)
保德信投信	3,438,833,754	-2.76%	14.63%
匯豐中華投信	3,380,978,722	-2.71%	12.70%
群益投信	3,606,257,516	0.09%	20.21%
復華投信	3,517,582,469	-2.06%	17.25%
元大投信	3,608,127,988	2.54%	20.27%
安泰投信	3,220,121,204	-1.21%	7.34%
國泰投信	3,359,964,157	0.98%	12.00%
德盛安聯投信	3,358,502,553	-0.56%	11.95%
摩根富林明投信	3,816,041,609	1.20%	27.20%

寶來投信	3,635,268,375	-0.70%	21.18%
合 計	34,941,678,347	-0.51%	16.47%

註：各家委託金額均 30 億元，總委託投資金額 300 億元。

95 年續約

單位：新台幣元；%

投 信 名 稱	目 前 淨 資 產	投資報酬率（%）	
		本年截至 4 月 (100.1.1~100.4.30)	委任迄今 (98.6.21~100.4.30)
95 年委託續約安泰投信	3,858,232,521	-0.92%	28.61%
合 計	3,858,232,521	-0.92%	28.61%

註：該家委託金額 30 億元，總委託投資金額 30 億元。

98 年第二次委託經營

單位：新台幣元；%

投 信 名 稱	目 前 淨 資 產	投資報酬率（%）	
		本年截至 4 月 (100.1.1~100.4.30)	委任迄今 (99.1.26~100.4.30)
保德信投信	3,556,264,995	4.42%	18.54%
群益投信	3,316,271,984	0.17%	10.54%
復華投信	3,203,424,302	-1.96%	6.78%
元大投信	3,484,328,466	2.71%	16.14%
安泰投信	3,088,661,292	-0.71%	2.96%
國泰投信	3,163,488,320	1.67%	5.45%
富邦投信	3,474,292,495	5.74%	15.81%
摩根富林明投信	3,363,266,623	1.21%	12.11%
寶來投信	3,268,787,697	-2.20%	8.96%
統一投信	3,822,293,062	9.57%	27.41%
合 計	33,741,079,236	2.13%	12.47%

註：各家委託金額均 30 億元，總委託投資金額 300 億元。

99 年第一次委託經營

單位：新台幣元；%

投 信 名 稱	目 前 淨 資 產	投資報酬率（%）	
		本年截至 4 月 (100.1.31~100.4.30)	委任迄今 (99.8.13~100.4.30)
保德信投信	4,136,414,050	-1.48%	3.41%
群益投信	4,308,138,612	2.26%	7.70%
復華投信	4,113,368,097	-1.46%	2.83%
安泰投信	4,245,502,252	-1.95%	6.14%
國泰投信	4,260,471,987	-0.13%	6.51%
寶來投信	4,106,719,500	-2.45%	2.67%
永豐投信	4,156,194,889	-4.10%	3.90%
日盛投信	3,852,857,700	-5.32%	-3.68%
合 計	33,179,667,087	-1.82%	3.69%

註：各家委託金額均 40 億元，總委託投資金額 320 億元。

97 年續約

單位：新台幣元；%

投 信 名 稱	目 前 淨 資 產	投資報酬率（%）	
		本年截至 4 月 (100.3.17~100.4.30)	委任迄今 (100.3.17~100.4.30)
保德信投信	3,463,078,242	4.50%	4.50%
群益投信	3,584,095,099	3.23%	3.23%
元大投信	3,610,412,718	6.37%	6.37%
合 計	10,657,586,059	4.69%	4.69%

註：三家委託金額分別為 33 億元、35 億元、34 億元，總委託投資金額 102 億元。

100 年第一次委託經營

單位：新台幣元；%

投 信 名 稱	目 前 淨 資 產	投 資 報 酬 率 (%)	
		本 年 截 至 4 月 (100.3.17~100.4.30)	委 任 迄 今 (100.3.17~100.4.30)
保德信投信	5,024,856,658	0.50%	0.50%
群益投信	5,172,294,933	3.45%	3.45%
復華投信	5,167,614,356	3.35%	3.35%
安泰投信	5,095,315,888	1.91%	1.91%
國泰投信	5,057,985,831	1.16%	1.16%
統一投信	5,221,184,299	4.42%	4.42%
合 計	30,739,251,965	2.46%	2.46%

註：各家委託金額均 50 億元，總委託投資金額 300 億元。

(五)、國內委託投資績效統計

單位：新台幣元；%

項 目 委託批次	基金委託金額	委託資產淨值	損 益 金 額		投 資 報 酬 率 (%)	
			本 年 截 至 4 月 (100.1.1~100.4.30)	委 任 迄 今	本 年 截 至 4 月 (100.1.1~100.4.30)	委 任 迄 今
98 年委託 (98.4.28 委託)	30,000,000,000	34,941,678,347	-179,294,655	4,941,678,347	-0.51%	16.47%
95 年委託續約 (98.6.21 委託)	3,000,000,000	3,858,232,521	-35,997,421	858,232,521	-0.92%	28.61%
98 年第二次委託 (99.1.26 委託)	30,000,000,000	33,741,079,236	703,353,484	3,741,079,236	2.13%	12.47%
99 年第一次委託 (99.8.13 委託)	32,000,000,000	33,179,667,087	-615,430,071	1,179,667,087	-1.82%	3.69%
97 年委託續約 (100.3.17 委託)	10,180,218,965	10,657,586,059	477,367,094	477,367,094	4.69%	4.69%
100 年第一次委託 (100.3.17 委託)	30,000,000,000	30,739,251,965	739,251,965	739,251,965	2.46%	2.46%

註：同期間台股報酬率 100 年 1 月 1 日至 100 年 4 月 30 日止為 0.39%；98 年 4 月 28 日至 100 年 4 月 30 日止為 57.89%；98 年 6 月 21 日至 100 年 4 月 30 日止為 44.56%；99 年 1 月 26 日至 100 年 4 月 30 日止為 14.41%；99 年 8 月 13 至 100 年 4 月 30 日止為 15.05%；100 年 3 月 17 日至 100 年 4 月 30 日止為 8.21%。

(六)、國外委託經營各受託投信績效統計

國外委託經營

單位：美元

委託批次 (委託日期)	委託金額
96 年國外委託經營 國際平衡型 (96.6.21)	8 億美元
97 年國外委託經營 全球增值債券型 (98.1.6)	9 億美元
97 年國外委託經營 全球增值股票型 (98.2.5)	4 億美元
98 年國外委託經營 亞太增值股票型 (98.11.17)	2 億美元
合 計	23 億美元

96 年國外委託經營(國際平衡型) 單位：美元；%

受託機構名稱	目前淨資產	投資報酬率(%)	
		本年截至 4 月 (100.1.1~100.4.30)	委任迄今 (96.6.21~100.4.30)
景順德國	210,734,690.49 元	5.32%	5.37%
瑞銀環球	220,766,499.13 元	4.57%	10.38%
富達國際	235,650,953.59 元	3.67%	17.83%
德盛安聯	216,477,399.20 元	6.23%	8.24%
合 計	883,629,542.41 元	4.91%	10.45%

註：各家委託金額均 2 億美元，總委託投資金額 8 億美元。

97 年國外委託經營(全球增值債券型) 單位：美元；%

受託機構名稱	目前淨資產	投資報酬率（%）	
		本年截至 4 月 (100.1.1~100.4.30)	委任迄今 (98.1.6~100.4.30)
太平洋	528,780,207.52 元	4.54%	23.12%
盧米斯	531,218,478.22 元	4.64%	23.82%
合 計	1,059,998,685.74 元	4.59%	23.47%

註：各家委託金額均 4.5 億美元，總委託投資金額 9 億美元。

97 年國外委託經營(全球增值股票型) 單位：美元；%

受託機構名稱	目前淨資產	投資報酬率（%）	
		本年截至 4 月 (100.1.1~100.4.30)	委任迄今 (98.2.5~100.4.30)
貝萊德	352,444,611.34 元	9.77%	76.22%
德意志資產	348,045,609.01 元	9.98%	74.02%
合 計	700,490,220.35 元	9.87%	75.12%

註：各家委託金額均 2 億美元，總委託投資金額 4 億美元。

98 年國外委託經營(亞太增值股票型) 單位：美元；%

受託機構名稱	目前淨資產	投資報酬率（%）	
		本年截至 4 月 (100.1.1~100.4.30)	委任迄今 (98.11.17~100.4.30)
景順	250,225,717.68 元	4.97%	25.11%
合 計	250,225,717.68 元	4.97%	25.11%

註：委託金額為 2 億美元，總委託投資金額 2 億美元。

(七)、國外委託投資績效

單位：美元；%

項 目 委託批次	基金委託金額	委託資產淨值	損益金額		投資報酬率(%)	
			本年截至4月 (100.1.1~100.4.30)	委任迄今	本年截至4月 (100.1.1~100.4.30)	委任 迄今
96年國外委託 國際平衡型 (96.6.21委託)	800,000,000.00	883,629,542.41	41,351,661.37	83,629,542.41	4.91%	10.45%
97年國外委託 全球增值債券型 (98.1.6委託)	900,000,000.00	1,059,998,685.74	46,537,778.69	159,998,685.74	4.59%	23.47%
97年國外委託 全球增值股票型 (98.2.5委託)	400,000,000.00	700,490,220.35	62,942,850.37	300,490,220.35	9.87%	75.12%
98年國外委託 亞太增值股票型 (98.11.17委託)	200,000,000.00	250,225,717.68	11,848,325.12	50,225,717.68	4.97%	25.11%

註：1. 同期間指標報酬率 100 年 1 月 1 日至 100 年 4 月 30 日 96 國際平衡型為 5.14%；97 年全球增值債券型為 4.38%；97 年全球增值股票型為 8.69%；98 年亞太增值股票型為 6.43%。

2. 委託至今同期間指標報酬率 96 年 6 月 21 日至 100 年 4 月 30 日 96 國際平衡型為 8.28%。98 年 1 月 6 日至 100 年 4 月 30 日 97 年全球增值債券型為 19.28%；98 年 2 月 5 日至 100 年 4 月 30 日 97 年全球增值股票型為 78.20%；98 年 11 月 17 日至 100 年 4 月 30 日 98 年亞太增值股票型為 26.28%；

3. 未含美元兌新台幣之兌換損益。

二、新制勞工退休基金規模與運用情形

勞工退休金新制於 94 年 7 月 1 日開辦，截至 100 年 4 月開單之提繳事業單位家數達 422,189 家，提繳勞退新制勞工人數達 5,246,891 人。

(一)、基金規模與收益

單位：新台幣萬元；%

至 100 年 4 月底止基金規模與收益		
基金運用規模		6,435 億 6,575 萬元
本年度運用總損益 (評價後報酬率)	自行運用	18 億 9,165 萬元 (0.63%)
	委託經營	68 億 8,170 萬元 (2.16%)
	合 計	87 億 7,335 萬元 (1.41%)

註 1：評價後報酬率係以當期報酬率（即收益÷100 年之日平均餘額）列示。

註 2：100 年 4 月之保證收益率為 1.2233%。

(二)、截至 100 年 4 月底資產配置

單位：新台幣元；%

項 目	餘 額	占基金運用比例
自行運用	320,596,099,533	49.82%
轉存金融機構	159,581,690,735	24.80%
短期票券	35,247,638,862	5.48%
公債、公司債及金融債券	59,491,688,444	9.24%
貨幣型基金	16,851,896,269	2.62%
股票及受益憑證投資（含期貨）	3,217,616,999	0.50%
國外投資	46,205,568,224	7.18%
固定收益類	42,460,208,995	6.60%
權益證券	3,745,359,229	0.58%
國內委託經營	172,347,959,859	26.78%

國外委託經營	150,621,690,626	23.40%
固定收益類	52,061,352,459	8.09%
權益證券	98,560,338,167	15.31%
合 計	643,565,750,018	100.00%

(三)、國內股票投資比率表（市價法）
類股持股比率(截至 100.4.30 止)

委託經營	
類股	市值/餘額（%）
水泥工業股	2.36
食品工業股 1	1.52
塑膠工業股	7.87
紡織纖維股	1.21
電機機械股	2.15
電器電纜股	0.18
化學工業股	2.39
生技醫療業股	0.34
玻璃陶瓷股	0.54
造紙工業股	0.28
鋼鐵工業股	1.71
橡膠工業股	3.17
汽車工業股	0.77
半導體業股	15.52
電腦及週邊設備業股	6.54
光電業股	12.89
通信網路業股	8.57
電子零組件業股	4.84
電子通路業股	1.13
資訊服務業股	0.10
其他電子業股	2.64
建材營造股	0.99
航運業股	4.01
觀光股	0.13
金融保險股	15.19
貿易百貨股	1.47
上市油電燃氣業股	0.47
憑證	0.01
其他	1.01
合計	100.00

註：社會責任投資(SRI)：本基金投資於遠見雜誌與天下雜誌等機構所評比遴選出之企業社會責任(CSR)得獎名單，計有 67.39%。

(四)、國內委託經營各受託投信績效統計

國內委託經營

單位：新台幣億元

委託批次 (委託日期)	原委託金額	目前委託金額	說明
97年第二次委託 (97.10.8)	300 億元	300 億元	
98年第一次委託 (98.7.14)	240 億元	240 億元	
99年第一次委託 (99.3.9)	320 億元	320 億元	
96年第一次委託安泰續約(99.9.27)	70 億元	70 億元	96年第一次委託及96年第一次委託安泰A帳戶於99年9月到期收回，並就績效較佳之安泰續約，金額為70億元。
99年第二次委託 (99.11.30)	350 億元	350 億元	
97年第一次委託續約(100.1.18)	274.92 億元	274.92 億元	97年第一次委託及97年第一次委託寶來A、日盛A帳戶於100年1月到期收回，並就績效較佳之七帳戶採現況續約接續操作(2個A帳戶個別併入原委託帳戶)。
97年第一次委託續約A帳戶 (100.3.17)	40 億元	40 億元	97年第一次委託續約於100年3月增額提撥安泰A帳戶及保德信A帳戶各20億元。
98年第一次委託A帳戶(100.3.17)	40 億元	40 億元	98年第一次委託於100年3月增額提撥永豐A帳戶及保德信A帳戶各20億元。
合計	1,634.92 億元	1,634.92 億元	

96年第一次委託經營安泰(續約)

單位：新台幣元；%

投信名稱	目前淨資產	投資報酬率(%)	
		本年截至4月 (100.1.1~100.4.30)	委任迄今 (99.9.27~100.4.30)
安泰	7,451,556,511	2.98	6.45
合計	7,451,556,511	2.98	6.45

註：委託投資金額為70億元。

97 年第一次委託經營（續約）

單位：新台幣元；%

投信名稱	目前淨資產	投資報酬率(%)	
		本年截至 4 月 (100.1.18~100.4.30)	委任迄今 (100.1.18~100.4.30)
元大	2,892,313,295	-0.42	-0.42
日盛	4,752,776,861	-4.35	-4.35
安泰	3,345,905,270	1.45	1.45
保德信	2,930,708,832	-0.30	-0.30
國泰	2,947,865,520	0.10	0.10
群益	2,910,613,206	4.60	4.60
寶來	7,542,438,257	-1.46	-1.46
合計	27,322,621,241	-0.62	-0.62

註：97 年第 1 次委託經營 9 帳戶於 100 年 1 月 17 日到期，其中 7 帳戶自到期翌日採現況續約接續操作(寶來 A、日盛 A 帳戶個別併入原委託帳戶)，委託金額為 27,492,422,150 元。

97 年第一次委託經營（續約）A 帳戶

單位：新台幣元；%

投信名稱	目前淨資產	投資報酬率(%)	
		本年截至 4 月 (100.3.17~100.4.30)	委任迄今 (100.3.17~100.4.30)
安泰	2,025,112,430	1.26	1.26
保德信	2,013,443,485	0.67	0.67
合計	4,038,555,915	0.96	0.96

註：97 年第 1 次委託經營(續約)於 100 年 3 月 17 日增額提撥安泰 A、保德信 A 帳戶各 20 億元，總委託金額為 40 億元。

97 年第二次委託經營

單位：新台幣元；%

投信名稱	目前淨資產(元)	投資報酬率(%)	
		本年截至 4 月 (100.1.1~100.4.30)	委任迄今 (97.10.8~100.4.30)
元大	3,817,018,434	2.71	27.23
永豐	3,591,248,696	-0.23	19.71
安泰	3,754,026,537	-0.70	25.13
保誠	3,792,040,060	2.11	26.40
國泰	3,933,261,283	1.31	31.11
富邦	3,980,884,979	4.37	32.70
復華	3,644,543,406	-0.45	21.48
匯豐中華	3,646,820,710	-2.21	21.56
群益	4,011,874,407	2.68	33.73
寶來	3,890,542,208	-1.26	29.68
合計	38,062,260,720	0.84	26.87

註：各家委託金額均 30 億元，總委託投資金額 300 億元。

98 年第一次委託經營

單位：新台幣元；%

投信名稱	目前淨資產	投資報酬率(%)	
		本年截至 4 月 (100.1.1~100.4.30)	委任迄今 (98.7.14~100.4.30)
永豐	3,723,977,498	0.98	24.13
安泰	3,631,845,567	2.78	21.06
保德信	3,779,792,938	3.96	25.99
國泰	3,319,132,774	1.26	10.64
復華	3,474,860,516	1.33	15.83
群益	3,526,711,963	0.21	17.56
匯豐中華	3,173,251,994	-3.30	5.78
寶來	3,157,178,551	-4.02	5.24
合計	27,786,751,801	0.48	15.78

註：各家委託金額均 30 億元，總委託投資金額 240 億元。

98 年第一次委託經營 A 帳戶

單位：新台幣元；%

投信名稱	目前淨資產	投資報酬率(%)	
		本年截至 4 月 (100.3.17~100.4.30)	委任迄今 (100.3.17~100.4.30)
永豐	2,052,073,733	2.60	2.60
保德信	2,039,813,535	1.99	1.99
合計	4,091,887,268	2.30	2.30

註：98 年第 1 次委託經營於 100 年 3 月 17 日增額提撥永豐 A、保德信 A 帳戶各 20 億元，總委託金額為 40 億元。

99 年第一次委託經營

單位：新台幣元；%

投信名稱	目前淨資產	投資報酬率(%)	
		本年截至 4 月 (100.1.1~100.4.30)	委任迄今 (99.3.9~100.4.30)
安泰	4,514,015,630	2.98	12.85
保德信	4,828,489,770	5.37	20.71
國泰	4,258,646,763	1.41	6.47
富邦	4,409,458,437	4.48	10.24
復華	4,442,319,501	-0.67	11.06
群益	4,608,258,286	1.57	15.21
摩根富林明	4,417,940,287	1.21	10.45
寶來	3,984,972,572	-3.66	-0.38
合計	35,464,101,246	1.63	10.83

註：各家委託金額均 40 億元，總委託投資金額 320 億元。

99 年第二次委託經營

單位：新台幣元；%

投信名稱	目前淨資產	投資報酬率(%)	
		本年截至 4 月 (100.1.1~100.4.30)	委任迄今 (99.11.30~100.4.30)
日盛	4,935,542,247	-1.31	-1.29
永豐	4,889,028,940	-2.38	-2.22
國泰	5,223,257,459	2.76	4.47
富邦	5,333,510,182	4.73	6.67
復華	5,043,179,850	-0.30	0.86
匯豐中華	5,057,283,918	-5.53	1.15
寶來	5,088,130,285	0.19	1.76
合計	35,569,932,881	-0.29	1.63

註：各家委託金額均 50 億元，總委託投資金額 350 億元。

(五)、國內委託經營績效統計

單位：新台幣元；%

委託批次 項目	基金委託金額	委託資產淨值	損益金額		投資報酬率(%)	
			本年截至 4 月 (100.1.1~100.4.30)	委任迄今	本年截至 4 月 (100.1.1~100.4.30)	委任迄今
97 年第二次委託 (97.10.8 委託)	30,000,000,000	38,062,260,720	317,693,618	8,062,260,720	0.84	26.87
98 年第一次委託 (98.7.14 委託)	24,000,000,000	27,786,751,801	131,944,427	3,786,751,801	0.48	15.78
99 年第一次委託 (99.3.9 委託)	32,000,000,000	35,464,101,246	567,703,778	3,464,101,246	1.63	10.83
96 年第一次委託安泰 (續)(99.9.27 委託)	7,000,000,000	7,451,556,511	215,960,711	451,556,511	2.98	6.45
99 年第二次委託 (99.11.30 委託)	35,000,000,000	35,569,932,881	-105,135,612	569,932,881	-0.29	1.63
97 年第一次委託 (續)(100.1.18 委託)	27,492,422,150	27,322,621,241	-169,800,909	-169,800,909	-0.62	-0.62
97 年第一次委託(續)A 帳戶(100.3.17 委託)	4,000,000,000	4,038,555,915	38,555,915	38,555,915	0.96	0.96
98 年第一次委託 A 帳 戶(100.3.17 委託)	4,000,000,000	4,091,887,268	91,887,268	91,887,268	2.30	2.30

註：同期間台股報酬率，97 年 10 月 8 日至 100 年 4 月 30 日為 63.05%，98 年 7 月 14 日至 100 年 4 月 30 日止為 37.93%，99 年 3 月 9 日至 100 年 4 月 30 日止為 16.05%，99 年 9 月 27 日至 100 年 4 月 30 日止為 10.30%，99 年 11 月 30 日至 100 年 4 月 30 日止為 7.66%，100 年 1 月 18 日至 100 年 4 月 30 日為 0.93%，100 年 3 月 17 日至 100 年 4 月 30 日為 8.21%。

(六)、國外委託經營各受託機構績效統計

國外委託經營

單位：美元

委託批次 (委託日期)	委託金額	說明
97-1 全球股票型 (97.5.20)	10 億美元	99 年 1 月 14 日坦伯頓帳戶增額委任 2.5 億美元。
97-1 全球債券型 (97.6.3)	10 億美元	99 年 10 月 20 日聯博及高盛帳戶各增額委任 1.25 億美元。
97-2 全球增值債券型 (98.1.6)	6 億美元	
97-2 全球增值股票型 (98.2.5)	4 億美元	
98-1 亞太(日本除外)股票型 (98.11.17)	8 億美元	100 年 1 月 27 日德盛安聯及景順帳戶各增額委任 1 億美元。
98-1 全球被動股票型 (98.11.30)	4 億美元	
99-1 全球新興市場股票型 (99.8.24)	7.5 億美元	99 年 8 月 24 日及 99 年 12 月 1 日各撥款 3.75 億美元。
合 計	49.5 億美元	

97 -1 全球股票型

單位：美元；%

受託機構名稱	目前淨資產	投資報酬率(%)	
		本年截至 4 月 (100.1.1~100.4.30)	委任迄今 (97.5.20~100.4.30)
聯博	197,577,417.28	7.41	-20.97
牛頓	213,817,942.83	9.58	-14.47
坦伯頓	531,607,676.38	11.05	-1.01
合 計	943,003,036.49	9.94	-12.35

註：坦伯頓帳戶於 99.1.14 增額委任 2.5 億美元，委任金額計 5 億美元，餘各家委託金額均 2.5 億美元，總委託投資金額 10 億美元。

97-1 全球債券型

單位：美元；%

受託機構名稱	目前淨資產	投資報酬率(%)	
		本年截至 4 月 (100.1.1~100.4.30)	委任迄今 (97.6.3~100.4.30)
聯博	432,432,934.30	4.73	21.80
高盛	429,589,322.84	3.95	21.06
坦伯頓	314,612,155.44	4.91	25.85
合 計	1,176,634,412.58	4.49	22.57

註：聯博及高盛帳戶於 99.10.20 各增額委任 1.25 億美元，委任金額 3.75 億美元，餘委託金額為 2.5 億美元，總委託投資金額 10 億美元。

97-2 全球增值債券型

單位：美元；%

受託機構名稱	目前淨資產	投資報酬率(%)	
		本年截至 4 月 (100.1.1~100.4.30)	委任迄今 (98.1.6~100.4.30)
太平洋	371,663,428.46	4.88	23.89
高盛	361,611,515.37	4.24	20.53
合 計	733,274,943.83	4.56	22.21

註：各家委託金額均 3 億美元，總委託投資金額 6 億美元。

97-2 全球增值股票型

單位：美元；%

受託機構名稱	目前淨資產	投資報酬率(%)	
		本年截至 4 月 (100.1.1~100.4.30)	委任迄今 (98.2.5~100.4.30)
貝萊德	352,158,538.30	9.75	76.08
摩根富林明	358,253,011.49	9.01	79.13
合 計	710,411,549.79	9.37	77.60

註：各家委託金額均 2 億美元，總委託投資金額 4 億美元。

98-1 亞太（日本除外）股票型

單位：美元；%

受託機構名稱	目前淨資產	投資報酬率(%)	
		本年截至 4 月 (100.1.1~100.4.30)	委任迄今 (98.11.17~100.4.30)
德盛安聯	354,699,385.52	4.12	24.91
景順	354,293,399.00	4.88	25.00
摩根士丹利	245,870,768.26	5.86	22.94
合 計	954,863,552.78	4.84	24.17

註：德盛安聯及景順帳戶於 100.1.27 各增額委任 1 億美元，委任金額 3 億美元，餘委託金額為 2 億美元，總委託投資金額 8 億美元。

98-1 全球被動股票型

單位：美元；%

受託機構名稱	目前淨資產	投資報酬率(%)	
		本年截至 4 月 (100.1.1~100.4.30)	委任迄今 (98.11.30~100.4.30)
貝萊德	249,769,867.58	8.65	24.89
道富	248,869,489.43	8.68	24.43
合 計	498,639,357.01	8.67	24.66

註：各家委託金額均 2 億美元，總委託投資金額 4 億美元

99-1 全球新興市場股票型

單位：美元；%

受託機構名稱	目前淨資產	投資報酬率(%)	
		本年截至 4 月 (100.1.1~100.4.30)	委任迄今 (99.8.24~100.4.30)
摩根士丹利	284,607,281.23	3.21	19.50
美盛	290,285,050.29	3.47	21.55
瑞萬通博	281,743,118.15	5.00	16.72
合 計	856,635,449.67	3.88	19.25

註：各家委託金額均 2.50 億美元，8 月 24 日及 12 月 1 日各撥款 3.75 億美元，總委託投資金額 7.50 億美元。

(七)、國外委託投資績效

單位：美元；%

項 目 委託批次	基金委託金額	委託資產淨值	損益金額		投資報酬率(%)	
			本年截至 4 月 (100.1.1~100.4.30)	委任迄今	本年截至 4 月 (100.1.1~ 100.4.30)	委任 迄今
97-1 全球股票型 (97.5.20 委託)	1,000,000,000.00	943,003,036.49	85,234,612.87	-56,996,963.51	9.94	-12.35
97-1 全球債券型 (97.6.3 委託)	1,000,000,000.00	1,176,634,412.58	50,587,776.45	176,634,412.58	4.49	22.57
97-2 全球增值 債券型 (98.1.6 委託)	600,000,000.00	733,274,943.86	31,985,484.71	133,274,943.86	4.56	22.21
97-2 全球增值 股票型 (98.2.5 委託)	400,000,000.00	710,411,549.79	60,876,608.44	310,411,549.79	9.37	77.60
98-1 亞太 (日本除外) 股票型 (98.11.17 委託)	800,000,000.00	954,863,552.78	44,282,046.10	154,863,552.78	4.84	24.17
98-1 全球被動 股票型 (98.11.30 委託)	400,000,000.00	498,639,357.01	39,763,903.89	98,639,357.01	8.67	24.66
99-1 全球新興 市場股票型 (99.08.24 委託)	750,000,000.00	856,635,449.67	31,991,095.01	106,635,449.67	3.88	19.25

註：1.同期間指標報酬率 100 年 1 月 1 日至 100 年 4 月 30 日 97-1 全球股票型為 8.64%、97-1 全球債券型為 4.38%、97-2 全球增值債券型為 4.38%、97-2 全球增值股票型為 8.69%、98-1 亞太（日本除外）股票型為 6.43%、98-1 全球被動股票型為 8.69%、99-1 全球新興市場股票型為 4.78%。

2.委託至今同期間指標報酬率 97 年 5 月 20 日至 100 年 4 月 30 日 97-1 全球股票型為-3.35%；97 年 6 月 3 日至 100 年 4 月 30 日 97-1 全球債券型為 19.00%；98 年 1 月 6 日至 100 年 4 月 30 日 97-2 全球增值債券型為 19.28%；98 年 2 月 5 日至 100 年 4 月 30 日 97-2 全球增值股票型為 78.20%；98 年 11 月 17 日至 100 年 4 月 30 日 98-1 亞太（日本除外）股票型為 26.28%；98 年 11 月 30 日至 100 年 4 月 30 日 98-1 全球被動股票型為 25.63%；99 年 8 月 24 日至 100 年 4 月 30 日 99-1 全球新興市場股票型為 23.06%。

3.未含美元兌新台幣之兌換損益。