

勞工退休基金運用情形報告（102 年截至 1 月底止）

隨著 2013 年的展開，全球經濟在各國政府景氣刺激方案下，表現不弱，展現好的開端，其中美國 1 月製造業指數，延續上升趨勢，較上月大幅上升 2.4 至 53.1，為 9 個月來最高值；另非製造業指數，較上個月微幅下降 0.5 至 55.2，失業率則是微幅上升 0.1% 至 7.9%。而歐元區製造業指數較上月上升 1.8 至 47.9，服務業指數則持續上升，較上個月上升 0.8 至 48.6，雖處於萎縮階段，惟萎縮力道已趨緩，近期公布的 12 月失業率則略為下降 0.1% 至 11.7%；另中國 12 月製造業指數微幅下降 0.2 至 50.4，非製造業指數則延續上升走勢達 56.2，均處擴張階段；而日本在政府擴大刺激政策後製造業及服務業指數亦紛紛上揚。

1 月全球股市在美國財政懸崖危機暫時化解後跳空走升，再因美股企業財報優於預期而持續走高。1 月單月 MSCI 世界、新興市場及台股指數分別上漲 4.61%、1.53% 及 1.95%。觀諸勞工退休基金截至 102 年 1 月底止，整體新、舊制基金規模為 1 兆 4,951 億 7,745 萬元，其中舊制基金規模為 5,900 億 9,635 萬元，新制基金規模為 9,050 億 8,110 萬元。102 年截至 1 月底，整體基金評價後收益數為 219 億 469 萬元，收益率為 1.4955%，新、舊制基金均優於法定最低保證收益率。

展望未來，全球各項景氣已逐步復甦，其中亞洲成長動能更顯強勁，台灣部分也因受惠民間消費及出口成長，主計處於 2 月調高今年全年經濟成長預測至 3.59%。然而美國自動減支機制延後 2 個月之期限即將到期，增稅及減支協議仍未達共識，市場充滿不確定性。加上日本銀行宣示無限期購買資產計畫後，各國央行嚴陣以待，並陸續提出警告過度寬

鬆的貨幣政策恐引起全球性貨幣競賽，並招致資產泡沫化之風險。勞退基金監理會面對經濟成長趨勢及市場投資風險升溫，將更審慎辦理投資布局，適時調整資產配置，在控制一定之風險下，擇優布局後市良好之投資標的，以維持基金長期穩建之績效。

*** 基金整體績效**

新制勞工退休基金 97 年 1 月迄今整體績效

截至 102 年 1 月底

收益率
1.86%

舊制勞工退休基金 75 年 9 月迄今整體績效

截至 102 年 1 月底

收益率
4.94%

*** 基金運用概況表**

新制勞工退休基金

1. 基金規模與投資績效

單位：新台幣萬元；%

至 102 年 1 月底止基金規模與收益		
基金運用規模		9,050 億 8,110 萬元
102 年截至 1 月底止 運用總損益及評價後報酬率	自行運用	18 億 4,363 萬元 0.43%
	委託經營	121 億 3,300 萬元 2.61%
	合 計	139 億 7,663 萬元 1.57%

註 1：評價後報酬率係以當期報酬率（即收益÷102 年之日平均餘額）列示。

註 2：102 年 1 月之保證收益率為 1.3916%。

資產配置

截至 102 年 1 月底

單位：新台幣元；%

項 目	餘 額	占基金運用比例(%)
自行運用	429,763,829,837	47.48
轉存金融機構	211,969,702,356	23.42
短期票券	53,166,729,901	5.87
公債、公司債及金融債券	92,536,845,196	10.23
貨幣型基金	—	—
股票及受益憑證投資(含期貨)	6,953,144,736	0.77
國外投資	65,137,407,648	7.19
固定收益	59,920,365,747	6.62
權益證券	3,200,352,112	0.35
另類投資	2,016,689,789	0.22
委託經營	475,317,269,552	52.52
國內委託經營	197,786,778,150	21.85
國外委託經營	277,530,491,402	30.67
固定收益	122,974,407,321	13.59
權益證券	119,766,434,468	13.23
另類投資	34,789,649,613	3.85
合 計	905,081,099,389	100.00

舊制勞工退休基金

1.基金規模與投資績效

單位：新台幣萬元；%

至 102 年 1 月底止基金規模與收益		
基金運用規模		5,900 億 9,635 萬元
102 年截至 1 月底止 運用總損益及評價後報酬率	自行運用	33 億 414 萬元 0.88%
	委託經營	46 億 2,392 萬元 2.30%
	合 計	79 億 2,806 萬元 1.38%

註：1.評價後報酬率係以當期報酬率(即收益÷102年之日平均餘額)列示

資產配置

截至 102 年 1 月底

單位：新台幣元；%

項 目	餘 額	占基金運用比例(%)
自行運用	398,207,400,960	67.47
轉存金融機構	154,249,006,485	26.14
短期票券	51,269,541,535	8.69
公債、金融債券、公司債及證券化商品	60,432,143,789	10.24
貨幣型基金	17,650,240,644	2.99
股票及受益憑證投資(含期貨)	43,793,708,629	7.42
國外投資	70,812,759,878	11.99
固定收益類	48,518,540,761	8.22
權益證券	17,722,451,892	3.00
另類投資	4,571,767,225	0.77
委託經營	191,888,948,279	32.53
國內委託經營	96,510,922,802	16.36
國外委託經營	95,378,025,477	16.17
固定收益類	59,516,364,910	10.09
權益證券	35,861,660,567	6.08
合 計	590,096,349,239	100.00

2.基金自營投資與委外投資比例

新制勞工退休基金

截至 102 年 1 月底

單位：新台幣元；%

項 目	金 額	占基金運用比例 (%)
自行運用	429,763,829,837	47.48
委託經營	475,317,269,552	52.52

舊制勞工退休基金

截至 102 年 1 月底

單位：新台幣元；%

項 目	金 額	占基金運用比例 (%)
自行運用	398,207,400,960	67.47
委託經營	191,888,948,279	32.53

3.基金國內投資與國外投資比例

新制勞工退休基金

截至 102 年 1 月底

單位：新台幣元；%

項 目	金 額	占基金運用比例 (%)
國 內 投 資	562,413,200,339	62.14
國 外 投 資	342,667,899,050	37.86

舊制勞工退休基金

截至 102 年 1 月底

單位：新台幣元；%

項 目	金 額	占基金運用比例 (%)
國 內 投 資	423,905,563,884	71.84
國 外 投 資	166,190,785,355	28.16

* 基金自營投資概況

1. 基金自營投資績效 (股票)

新制勞工退休基金

截至 102 年 1 月底

單位：%

項 目	收益率 (%)
國內權益證券 (ETF)	1.62

舊制勞工退休基金

截至 102 年 1 月底

單位：%

項 目	收益率 (%)
國內權益證券	1.74

2.基金自營股票及受益憑證投資比例概況

新制勞工退休基金

截至 102 年 1 月底

單位：新台幣元；%

項 目	金 額	比 例 (%)
國內權益證券 (ETF)	6,953,144,736	0.77

舊制勞工退休基金

截至 102 年 1 月底

單位：新台幣元；%

項 目	金 額	比 例 (%)
國內權益證券	43,793,708,629	7.42

註：不含貨幣型基金

*基金國內委外投資概況表

1.基金國內委外投資績效、績效指標及排名表

新制勞工退休基金

96年第一次委託經營安泰（續約）

單位：新台幣元；%

投信名稱	委託金額	目前淨資產	102年截至1月 累積投資報酬(%) (102.1.1~ 102.1.31)	委任迄今 (99.9.27~102.1.31)		
				投資報酬率 (%)	委託經營排名	大盤/指標 報酬率(%)
安泰	7,000,000,000	7,361,183,323	0.77	5.16	1	-3.88
合計	7,000,000,000	7,361,183,323	0.77	5.16	1	

97年第一次委託經營（續約）

單位：新台幣元；%

投信名稱	委託金額	目前淨資產	102年截至1月 累積投資報酬(%) (102.1.1~ 102.1.31)	委任迄今 (100.1.18~102.1.31)		
				投資報酬率 (%)	委託經營排名	大盤/指標 報酬率(%)
日盛	4,968,884,136	4,717,113,432	1.14	-5.07	3	-12.05
安泰	3,298,075,210	3,302,184,460	0.79	0.12	1	
保德信	2,939,416,481	2,726,656,124	0.75	-7.24	4	
國泰	2,944,902,854	2,680,594,585	-0.58	-8.98	5	
群益	2,782,544,958	2,762,507,402	2.04	-0.72	2	
合計	16,933,823,639	16,189,056,003	0.87	-4.40	—	

97 年第一次委託經營（續約）A 帳戶

單位：新台幣元；%

投信名稱	委託金額	目前淨資產	102 年截至 1 月 累積投資報酬(%) (102. 1. 1~ 102. 1. 31)	委任迄今 (100. 3. 17~102. 1. 31)		
				投資報酬率(%)	委託經營排名	大盤/指標報酬率(%)
安泰	2,000,000,000	2,008,178,761	0.82	0.41	1	-5.70
保德信	2,000,000,000	1,969,255,824	0.71	-1.54	2	
合計	4,000,000,000	3,977,434,585	0.76	-0.56	—	

97 年第二次委託經營（續約）

單位：新台幣元；%

投信名稱	委託金額	目前淨資產	102 年截至 1 月 累積投資報酬(%) (102. 1. 1~ 102. 1. 31)	委任迄今 (100. 10. 8~102. 1. 31)		
				投資報酬率(%)	委託經營排名	大盤/指標報酬率(%)
富邦	6,747,919,987	6,783,473,486	0.90	0.53	2	8.85
群益	7,256,147,326	7,611,928,264	1.99	4.90	1	
合計	14,004,067,313	14,395,401,750	1.48	2.79	—	

98 年第一次委託經營（續約）

單位：新台幣元；%

投信名稱	委託金額	目前淨資產	102 年截至 1 月 累積投資報酬(%) (102. 1. 1~ 102. 1. 31)	委任迄今 (100. 7. 14~102. 1. 31)		
				投資報酬率(%)	委託經營排名	大盤/指標報酬率(%)
安泰	3,421,364,679	3,580,007,136	0.74	4.64	2	10.50
保德信	3,423,163,553	3,647,047,267	1.47	6.54	1	
合計	6,844,528,232	7,227,054,403	1.11	5.59	—	

99 年第一次委託經營

單位：新台幣元；%

投信名稱	委託金額	目前淨資產	102 年截至 1 月 累積投資報酬(%) (102.1.1~ 102.1.31)	委任迄今 (99.3.9~102.1.31)		
				投資報酬率 (%)	委託經營排名	大盤/指標 報酬率(%)
安泰	4,000,000,000	4,457,796,002	0.74	11.44	2	1.13
保德信	4,000,000,000	4,647,589,715	1.41	16.19	1	
國泰	4,000,000,000	3,888,786,627	-0.54	-2.78	7	
富邦	4,000,000,000	4,051,374,430	0.74	1.28	5	
復華	4,000,000,000	4,027,528,501	0.72	0.69	6	
群益	4,000,000,000	4,373,409,909	1.24	9.34	3	
摩根	4,000,000,000	4,074,287,795	1.04	1.86	4	
合計	28,000,000,000	29,520,772,979	0.78	5.43	—	

99 年第一次委託經營 A 帳戶

單位：新台幣元；%

投信名稱	委託金額	目前淨資產	102 年截至 1 月 累積投資報酬(%) (102.1.1~ 102.1.31)	委任迄今 (100.5.12~102.1.31)		
				投資報酬率 (%)	委託經營排名	大盤/指標 報酬率(%)
保德信	3,968,544,959	3,602,356,015	1.11	-9.23	1	-12.97
合計	3,968,544,959	3,602,356,015	1.11	-9.23	—	

99 年第二次委託經營

單位：新台幣元；%

投信 名稱	委託金額	目前淨資產	102 年截至 1 月 累積投資報酬(%) (102.1.1~ 102.1.31)	委任迄今 (99.11.30~102.1.31)		
				投資報酬 率(%)	委託經 營排名	大盤/指 標報酬率 (%)
日盛	5,000,000,000	4,448,049,384	1.70	-11.04	4	-6.18
永豐	5,000,000,000	4,490,970,340	0.34	-10.18	3	
國泰	5,000,000,000	5,381,638,018	1.27	7.63	1	
富邦	5,000,000,000	5,075,013,737	1.18	1.50	2	
滙豐 中華	5,000,000,000	4,442,358,350	1.31	-11.15	5	
元大 寶來 (原寶 來)	5,000,000,000	4,382,833,912	1.63	-12.34	6	
合計	30,000,000,000	28,220,863,741	1.24	-5.93	—	

100 年第一次委託經營

單位：新台幣元；%

投信 名稱	委託金額	目前淨資產	102 年截至 1 月 累積投資報酬 (%) (102.1.1~ 102.1.31)	委任迄今 (100.7.15~102.1.31)		
				投資報酬 率(%)	委託經 營排名	大盤/指 標報酬率 (%)
元大 寶來 (原元 大)	5,000,000,000	5,273,419,449	2.16	5.47	2	-7.44/ -5.01
國泰	5,000,000,000	5,204,364,029	1.90	4.09	5	
富邦	5,000,000,000	5,161,512,647	2.36	3.23	6	
復華	5,000,000,000	5,339,287,382	2.93	6.79	1	
滙豐中 華	6,000,000,000	6,308,607,415	2.77	5.14	3	
元大 寶來 (原寶 來)	5,000,000,000	5,244,103,347	2.26	4.88	4	
合計	31,000,000,000	32,531,294,269	2.41	4.94	—	

註：本次委託為相對報酬委託經營，採就業 99 指數為指定指標，自委託日起算大盤/指定指標報酬率為 -7.44% / -5.01%，自建倉期滿起算則為 -9.83%/-9.05%。

100 年第二次委託經營第一期

單位：新台幣元；%

投信名稱	委託金額	目前淨資產	102 年截至 1 月 累積投資報酬 (%) (102.1.1~ 102.1.31)	委任迄今 (100.8.10~102.1.31)		
				投資報酬 率(%)	委託經 營排名	大盤/指 標報酬 率(%)
保德信	3,000,000,000	3,036,710,431	0.79	1.22	2	4.76
統一	3,000,000,000	2,839,043,052	0.80	-5.37	4	
富邦	3,000,000,000	2,799,627,589	0.82	-6.68	5	
復華	3,000,000,000	3,050,208,708	2.37	1.67	1	
摩根	3,000,000,000	2,895,278,974	-0.64	-3.49	3	
合計	15,000,000,000	14,620,868,754	0.83	-2.53	—	

100 年第二次委託經營第二期

單位：新台幣元；%

投信名稱	委託金額	目前淨資產	102 年截至 1 月 累積投資報酬 (%) (102.1.1~ 102.1.31)	委任迄今 (100.11.23~102.1.31)		
				投資報酬 率(%)	委託經 營排名	大盤/指 標報酬 率(%)
保德信	2,000,000,000	2,060,741,797	0.86	3.04	3	12.14
統一	2,000,000,000	2,021,956,865	0.70	1.10	4	
富邦	2,000,000,000	1,996,769,731	0.83	-0.16	5	
復華	2,000,000,000	2,163,184,186	2.40	8.16	1	
滙豐 中華	2,000,000,000	2,083,436,995	1.18	4.17	2	
摩根	2,000,000,000	1,941,086,632	-0.64	-2.95	6	
合計	12,000,000,000	12,267,176,206	0.91	2.23	—	

101 年第一次委託

單位：新台幣元；%

投信名稱	委託金額	目前淨資產	102 年截至 1 月 累積投資報酬 (%) (102.1.1~ 102.1.31)	委任迄今 (101.4.18~102.1.31)		
				投資報酬 率(%)	委託經 營排名	大盤/指 標報酬 率(%)
國泰	1,000,000,000	1,070,490,210	1.57	7.05	3	3.48/ 7.35
富邦	1,000,000,000	1,068,715,946	1.95	6.87	4	
滙豐 中華	1,000,000,000	1,073,939,397	2.83	7.39	2	
元大 寶來 (原寶 來)	1,000,000,000	1,084,040,724	2.05	8.40	1	
合計	4,000,000,000	4,297,186,277	2.10	7.43	—	

註：本次委託為相對報酬委託經營，採加權股價報酬指數為指定指標。

101 年第二次委託經營

單位：新台幣元；%

投信名稱	委託金額	目前淨資產	102 年截至 1 月 累積投資報酬 (%) (102.1.1~ 102.1.31)	委任迄今 (101.7.16~102.1.31)		
				投資報酬 率(%)	委託經 營排名	大盤/指 標報酬 率(%)
安泰	5,000,000,000	5,159,613,914	0.72	3.19	6	10.5
保德信	5,000,000,000	5,213,317,997	1.36	4.27	3	
國泰	5,000,000,000	5,191,193,747	0.51	3.82	4	
統一	5,000,000,000	5,188,824,004	0.47	3.78	5	
富邦	5,000,000,000	5,214,604,011	0.89	4.29	2	
滙豐 中華	5,000,000,000	5,263,492,845	1.41	5.27	1	
合計	30,000,000,000	31,231,046,518	0.89	4.10	—	

舊制勞工退休基金

國內 97 年第 1 次委託(續)

單位：新台幣元；%

投信名稱	委託金額	目前淨資產	102 年截至 1 月 累積投資報酬(%) (102.1.1~102.1.31)	委任迄今 (100.3.17~102.1.31)		
				投資 報酬率(%)	排名	大盤/指標 報酬率(%)
保德信	3,313,984,536	3,218,275,900	0.84	-2.89	1	-5.70
群益	3,472,017,296	3,335,421,041	1.31	-3.93	2	
合計	6,786,001,832	6,553,696,941	1.08	-3.42	—	

國內 98 年第 2 次委託(續)

投信名稱	委託金額 (新台幣元)	目前淨資產 (新台幣元)	102 年截至 1 月 累積投資報酬(%) (102.1.1~102.1.31)	委任迄今 (102.1.26~102.1.31)		
				投資 報酬率(%)	排名	大盤/指標 報酬率(%)
保德信	3,380,116,383	3,419,253,040	1.16	1.16	3	2.31
富邦	3,208,581,038	3,256,248,447	1.49	1.49	2	
統一	3,514,321,648	3,572,182,884	1.65	1.65	1	
合計	10,103,019,069	10,247,684,371	1.43	1.43	—	

國內 99 年第 1 次委託

單位：新台幣元；%

投信名稱	委託金額	目前淨資產	102 年截至 1 月 累積投資報酬(%) (102.1.1~102.1.31)	委任迄今 (99.8.13~102.1.31)		
				投資 報酬率(%)	排名	大盤/指標 報酬率(%)
保德信	4,000,000,000	3,691,482,946	0.28	-7.71	5	0.26
群益	4,000,000,000	3,734,857,533	1.18	-6.63	4	
復華	4,000,000,000	3,650,511,684	1.15	-8.74	6	
國泰	4,000,000,000	4,049,722,436	0.65	1.24	1	
元大寶來	4,000,000,000	3,482,610,665	1.43	-12.93	7	
永豐	4,000,000,000	3,828,761,233	0.29	-4.28	3	
日盛	4,000,000,000	3,878,104,073	1.21	-3.05	2	
合計	28,000,000,000	26,316,050,570	0.87	-6.01	—	

國內 100 年第 1 次委託

單位：新台幣元；%

投信名稱	委託金額	目前淨資產	102 年截至 1 月 累積投資報酬(%) (102.1.1~102.1.31)	委任迄今 (100.3.17~102.1.31)		
				投資 報酬率(%)	排名	大盤/指標 報酬率(%)
保德信	5,000,000,000	4,842,128,783	0.78	-3.16	4	-5.70
群益	5,000,000,000	4,953,321,289	1.28	-0.93	3	
復華	5,000,000,000	4,799,636,711	2.19	-4.01	5	
國泰	5,000,000,000	4,975,403,051	0.71	-0.49	1	
統一	5,000,000,000	4,972,225,945	0.45	-0.56	2	
合計	25,000,000,000	24,542,715,779	1.07	-1.83	—	

國內 101 年第 1 次委託

單位：新台幣元；%

投信名稱	委託金額	目前淨資產	102 年截至 1 月 累積投資報酬(%) (102.1.1~102.1.31)	委任迄今 (101.10.30~102.1.31)		
				投資 報酬率(%)	排名	大盤/指標 報酬率(%)
匯豐中華	500,000,000	543,706,464	2.94	8.74	2	10.69
元大寶來	500,000,000	545,009,322	1.97	9.00	1	
合計	1,000,000,000	1,088,715,786	2.45	8.87	—	

國內 101 年第 2 次委託

單位：新台幣元；%

投信名稱	委託金額	目前淨資產	102 年截至 1 月 累積投資報酬(%) (102.1.1~102.1.31)	委任迄今 (101.4.30~102.1.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	大盤/指標報 酬率(%)
保德信	5,000,000,000	5,216,302,945	1.50	4.33	3	4.94
群益	5,000,000,000	5,308,557,932	1.86	6.17	1	
匯豐中華	5,000,000,000	5,283,992,595	1.04	5.68	2	
安泰	5,000,000,000	5,206,735,418	1.40	4.13	4	
國泰	5,000,000,000	5,192,824,357	0.78	3.86	5	
統一	5,000,000,000	5,075,770,447	0.81	1.52	6	
合計	30,000,000,000	31,284,183,694	1.24	4.28	—	

2. 被提前收回之國內委外投資帳戶

(1)、基金國內委外投資被提前收回帳戶經理人名單及收回原因

新制勞工退休基金

單位：元

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

舊制勞工退休基金：無

(2)委託業者被主管機關懲處之相關資訊

新制勞工退休基金：無

舊制勞工退休基金：無

*基金國外委外投資概況表

1.基金國外委外投資績效、績效指標及排名表

新制勞工退休基金

97 -1 全球股票型續約

單位：美元；%

投信名稱	目前淨資產	委託金額 (億美元)	102年截至1月 累積投資報酬(%) (102.1.1~102.1. 31)	委任迄今 (101.5.21~102.1.31)		
				投資報酬 率(%)	委託經 營排名	大盤/指標 報酬率(%)
坦伯頓	509,748,634.45	4	5.66	27.43	1	20.99
合計	509,748,634.45	4	5.66	27.43	—	

97-1 全球債券型續約

單位：美元；%

投信名稱	目前淨資產	委託金額 (億美元)	102年截至1月 累積投資報酬(%) (102.1.1~102.1. 31)	委任迄今 (101.6.4~102.1.31)		
				投資報酬 率(%)	委託經 營排名	大盤/指標 報酬率(%)
聯博	770,158,580.41	7.5	-0.96	2.69	2	2.02
高盛	410,185,830.65	4	-1.09	2.55	3	
坦伯頓	715,607,455.99	6.5	0.04	10.09	1	
合計	1,907,655,275.41	18	-0.67	5.33	—	

97-2 全球增值債券型續約

單位：美元；%

投信名稱	目前淨資產	委託金額 (億美元)	102年截至1月 累積投資報酬(%) (102.1.1~102.1.31)	委任迄今 (98.1.6~102.1.31)		
				投資報酬率 (%)	委託經營 排名	大盤/ 指標 報酬 率(%)
太平洋	618,826,292.01	6.15	0.54	0.54	1	0.23
高盛	479,493,447.98	4.79	-0.04	-0.04	2	
合計	1,098,319,739.99	10.95	0.28	0.28	—	

97-2 全球增值股票型

單位：美元；%

投信名稱	目前淨資產	委託金額 (億美元)	102年截至1月 累積投資報酬(%) (102.1.1~102.1.31)	委任迄今 (98.2.5~102.1.31)		
				投資報酬 率(%)	委託經 營排名	大盤/ 指標 報酬 率(%)
貝萊德	385,497,473.27	2	5.39	92.75	1	84.52
摩根	589,707,696.03	4	4.72	87.73	2	
合計	975,205,169.30	6	4.98	89.40	—	

98-1 亞太（日本除外）股票型

單位：美元；%

投信名稱	目前淨資產	委託金額 (億美元)	102年截至1月 累積投資報酬(%) (102.1.1~102.1.31)	委任迄今 (98.11.17~102.1.31)		
				投資報酬 率(%)	委託經 營排名	大盤/ 指標 報酬 率(%)
德盛安聯	343,654,993.19	3	2.74	21.02	2	25.73
景順	356,815,087.50	3	2.63	25.89	1	
摩根士丹利	233,279,401.81	2	2.86	16.64	3	
合計	933,749,482.50	8	2.73	21.42	—	

98-1 全球被動股票型

單位：美元；%

投信名稱	目前淨資產	委託金額 (億美元)	102年截至1月 累積投資報酬(%) (102.1.1~102.1. 31)	委任迄今 (98.11.30~102.1.31)		
				投資報酬 率(%)	委託經 營排名	大盤/指標 報酬率(%)
貝萊德	259,039,819.20	2	4.43	29.52	1	30.09
道富	258,814,207.22	2	4.58	29.41	2	
合計	517,854,026.42	4	4.50	29.46	—	

99-1 全球新興市場股票型

單位：美元；%

投信名稱	目前淨資產	委託金額 (億美元)	102年截至1月 累積投資報酬(%) (102.1.1~102.1. 31)	委任迄今 (99.8.24~102.1.31)		
				投資報酬 率(%)	委託經 營排名	大盤/指標 報酬率(%)
摩根士丹利	277,663,114.97	2.5	2.05	16.58	2	13.93
美盛	245,003,474.26	2.5	0.73	2.59	3	
瑞萬通博	548,109,821.70	4.5	1.85	32.90	1	
合計	1,070,776,410.93	9.5	1.64	19.90	—	

100-1 全球基本面指數股票型

單位：美元；%

投信名稱	目前淨資產	委託金額 (億美元)	102年截至1月 累積投資報酬(%) (102.1.1~102.1. 31)	委任迄今 (100.7.1~102.1.31、 100.7.13~102.1.31)		
				投資報酬 率(%)	委託經 營排名	大盤/指標 報酬率(%)
道富	315,234,918.53	3	5.25	5.08	2	4.8
貝萊德	323,605,158.23	3	5.29	7.86	1	
合計	638,840,076.76	6	5.27	6.47	—	

註：其中道富委託日100.7.1~105.6.30，貝萊德委託日100.7.13~105.7.12，委任迄今大盤/
指標報酬率分別為4.80%及7.78%。

100-1 全球不動產股票型

單位：美元；%

投信名稱	目前淨資產	委託金額 (億美元)	102年截至1月 累積投資報酬(%) (102.1.1~102.1. 31)	委任迄今 (101.3.6~102.1.31)		
				投資報酬 率(%)	委託經 營排名	大盤/指標 報酬率(%)
Cohen & Steers	350,893,300.61	3	3.84	19.01	2	18.35
Invesco 景順	509,502,940.81	4.5	3.01	21.58	1	
EII	448,369,389.25	4	2.33	17.81	3	
合計	1,308,765,630.67	11.5	3.00	19.39	—	

101-1 新興市場債券型

單位：美元；%

投信名稱	目前淨資產	委託金額 (億美元)	102年截至1月 累積投資報酬(%) (102.1.1~102.1. 31)	委任迄今 (101.7.31~102.1.31)		
				投資報酬 率(%)	委託經 營排名	大盤/指標 報酬率(%)
Ashmore	309,950,575.97	3	0.65	6.70	1	5.21
Bluebay	306,783,726.35	3	0.11	4.49	2	
Stone Harbour	305,290,219.97	3	-0.16	3.69	4	
Pictet	305,407,414.85	3	-0.19	3.78	3	
合計	1,227,431,937.14	12	0.10	4.66	—	

舊制勞工退休基金

96年續約國外委託經營(平衡型)

投信名稱	委託金額 (美元)	目前淨資產 (美元)	102年截至1月 累積投資報酬(% (102.1.1~102.1.31)	委任迄今 (100.6.21~102.1.31)		
				投資 報酬率(%)	排名	大盤/指標 報酬率(%)
富達國際	425,533,349.13	496,415,809.61	3.43	14.64	-	11.23

97年續約國外委託經營(全球增值債券型)

投信名稱	委託金額 (美元)	目前淨資產 (美元)	102年截至1月 累積投資報酬(% (102.1.1~102.1.31)	委任迄今 (98.1.6~102.1.31)		
				投資 報酬率(%)	排名	大盤/指標 報酬率(%)
太平洋	731,384,465.68	735,088,963.44	0.51	0.51	1	0.23
盧米斯	712,476,555.58	714,187,664.26	0.24	0.24	2	
合計	1,443,861,021.26	1,449,276,627.70	0.38	0.38	—	

97年國外委託經營(全球增值股票型)

投信名稱	委託金額 (美元)	目前淨資產 (美元)	102年截至1月 累積投資報酬(% (102.1.1~102.1.31)	委任迄今 (98.2.5~102.1.31)		
				投資 報酬率(%)	排名	大盤/指標 報酬率(%)
貝萊德	200,000,000	386,158,005.16	5.37	93.08	1	84.52
德意志資產	200,000,000	359,000,843.39	4.42	79.50	2	
合計	400,000,000	745,158,848.55	4.91	86.29	—	

98 年國外委託經營(亞太(日本除外)股票型)

投信名稱	委託金額 (美元)	目前淨資產 (美元)	102 年截至 1 月 累積投資報酬(%) (102.1.1~102.1.31)	委任迄今 (98.11.17~102.1.31)		
				投資 報酬率(%)	排名	大盤/指標 報酬率(%)
景順	200,000,000	252,039,562.44	2.60	26.02	-	25.73

100 年國外委託經營(全球基本面指數股票型)

投信名稱	委託金額 (美元)	目前淨資產 (美元)	102 年截至 1 月 累積投資報酬(%) (102.1.1~102.1.31)	委任迄今 (101.3.6~102.1.31)		
				投資 報酬率(%)	排名	大盤/指標 報酬率(%)
貝萊德	100,000,000	110,335,523.22	5.23	10.34	4	10.33
道富	100,000,000	110,394,025.37	5.28	10.39	3	
瑞銀環球	100,000,000	110,783,943.95	5.22	10.78	1	
野村	100,000,000	110,627,200.65	5.30	10.63	2	
合計	400,000,000	442,140,693.19	5.26	10.54	—	

2. 國外委外投資被提前收回帳戶經理人名單及收回原因

新制勞工退休基金：無。

舊制勞工退休基金：無。

* 基金投資衍生性金融商品概況表

新制勞工退休基金自營部位

(依交易目的)

102年1月31日

一、避險：

種類	避險比例
權益證券避險	0%
匯率避險	14.53%

二、投資：無

舊制勞工退休基金自營部位

(依交易目的)

102年1月31日

一、避險：

種類	避險比例
權益證券避險	0%
匯率避險	6.60%

二、投資：無