

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 10 月底績效

基金與指標	新制基金	舊制基金	臺灣 10 年期 公債殖利率	臺灣加權 股價指數	MSCI 全球 股票指數	Bloomberg 全球債券指數
收益率/報酬率	14.59%	17.92%	1.49%	27.27%	16.00%	0.12%

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	臺灣 10 年期 公債殖利率	臺灣加權 股價指數	MSCI 全球 股票指數	Bloomberg 全球債券指數
收益率/報酬率	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	臺灣 10 年期 公債殖利率	臺灣加權 股價指數	MSCI 全球 股票指數	Bloomberg 全球債券指數
收益率/報酬率	5.26%	5.83%	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	臺灣 10 年期 公債殖利率	臺灣加權 股價指數	MSCI 全球 股票指數	Bloomberg 全球債券指數
收益率/報酬率	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 10 月底止基金規模與收益			
基金運用規模			4 兆 5,105 億 9,692 萬元
113 年截至 10 月底止 運用收益數及收益率	自行運用	國內固定收益	113 億 3,424 萬元 1.65%
		國內權益證券 及國外投資	1,965 億 6,626 萬元 21.59%
	委託經營		4,161 億 8,446 萬元 16.38%
	合 計		6,240 億 8,496 萬元 14.59%

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 10 月之保證收益率為 1.7108%。

2. 舊制勞工退休基金

113 年 10 月底止基金規模與收益			
基金運用規模			10,469 億 57 萬元
113 年截至 10 月底止 運用收益數及收益率	自行運用	國內固定收益	37 億 1,533 萬元 1.55%
		國內權益證券 及國外投資	809 億 492 萬元 36.78%
	委託經營		731 億 7,938 萬元 14.03%
	合 計		1,577 億 9,963 萬元 17.92%

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 10 月 31 日

單位：新臺幣元

項 目	餘 額	占基金運用比率(%)
自行運用	1,839,757,660,401	40.79
轉存金融機構	528,585,954,576	11.72
短期票券	99,608,573,531	2.21
公債、公司債、金融債券及特別股	239,487,405,144	5.31
股票及受益憑證投資(含期貨)	230,731,695,592	5.12
國外投資	741,344,031,558	16.43
固定收益	633,839,008,881	14.05
權益證券	55,594,433,243	1.23
另類投資	51,910,589,434	1.15
委託經營	2,670,839,263,651	59.21
國內委託經營	617,469,395,168	13.69
國外委託經營	2,053,369,868,483	45.52
固定收益	551,181,050,101	12.22
權益證券	1,052,478,400,090	23.33
另類投資	449,710,418,292	9.97
合 計	4,510,596,924,052	100.00

2. 舊制勞工退休基金

113 年 10 月 31 日

單位：新臺幣元

項 目	餘 額	占基金運用比率(%)
自行運用	502,646,410,744	48.01
轉存金融機構	152,865,213,322	14.60
短期票券	56,675,147,879	5.42
公債、金融債券、公司債及證券化商品	77,409,258,453	7.39
股票及受益憑證投資(含期貨)	123,329,123,638	11.78
國外投資	92,367,667,452	8.82
固定收益	48,420,052,919	4.63
權益證券	35,315,274,251	3.37
另類投資	8,632,340,282	0.82
委託經營	544,254,157,672	51.99
國內委託經營	117,908,135,866	11.26
國外委託經營	426,346,021,806	40.73
固定收益	103,417,682,972	9.88
權益證券	216,237,608,163	20.66
另類投資	106,690,730,671	10.19
合 計	1,046,900,568,416	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 10 月 31 日

單位：新臺幣元

項 目	金 額	占基金運用比率(%)
自行運用	1,839,757,660,401	40.79
委託經營	2,670,839,263,651	59.21

2. 舊制勞工退休基金

113 年 10 月 31 日

單位：新臺幣元

項 目	金 額	占基金運用比率(%)
自行運用	502,646,410,744	48.01
委託經營	544,254,157,672	51.99

(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 10 月 31 日

單位：新臺幣元

項 目	金 額	占基金運用比率(%)
國 內 投 資	1,715,883,024,011	38.05
國 外 投 資	2,794,713,900,041	61.95

2. 舊制勞工退休基金

113 年 10 月 31 日

單位：新臺幣元

項 目	金 額	占基金運用比率(%)
國 內 投 資	528,186,879,158	50.45
國 外 投 資	518,713,689,258	49.55

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 10 月底

項 目	收益率(%)
國內權益證券	58.92

2. 舊制勞工退休基金

113 年截至 10 月底

項 目	收益率(%)
國內權益證券	55.42

(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 10 月 31 日 單位：新臺幣元

項 目	金 額	比 率 (%)
國內權益證券	230,731,695,592	5.12

2. 舊制勞工退休基金

113 年 10 月 31 日 單位：新臺幣元

項 目	金 額	比 率 (%)
國內權益證券	123,329,123,638	11.78

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 10 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (111.9.27~113.10.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	目標報酬率 (%)
野村	28,072,603,831	42,284,993,741	21.96	50.63	—	13.08

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 10 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (112.1.30~113.10.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	目標報酬率 (%)
野村	6,829,066,771	10,247,195,100	26.07	50.05	—	10.96

註：本批次為絕對報酬型，契約目標報酬率係以臺灣證交所公告之最近 5 年年底股票集中市場平均殖利率加計 250 個基本點為基準。

98 年第一次委託經營(續約 5)

單位：新臺幣元

投信 名稱	委託金額	目前淨資產	113 年截至 10 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (113.7.16~113.10.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	目標報酬率 (%)
野村	25,455,695,879	24,616,199,392	-3.30	-3.30	2	1.80
保德信	7,430,070,832	7,372,286,725	-0.78	-0.78	1	
合計	32,885,766,711	31,988,486,117	-2.73	-2.73	—	

註：本批次為絕對報酬型，契約目標報酬率係以臺灣證交所公告之最近 5 年年底股票集中市場平均殖利率加計 250 個基本點為基準。

99 年第二次委託經營(續約 3)

單位：新臺幣元

投信 名稱	委託金額	目前淨資產	113 年截至 10 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (111.12.5~113.10.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	目標報酬率 (%)
國泰	10,445,113,310	12,936,524,320	12.59	23.85	—	11.92

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 10 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (112.7.15~113.10.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
復華	29,101,525,086	36,354,276,291	19.29	24.92	—	24.94

註：本批次為相對報酬型，以臺灣就業 99 指數為指定指標。

101 年第二次委託經營(續約 3)

單位：新臺幣元

投信 名稱	委託金額	目前淨資產	113 年截至 10 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (113.7.20~113.10.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	目標報酬率 (%)
野村	15,198,354,580	15,611,511,802	2.72	2.72	1	1.74
統一	20,913,151,881	20,222,807,472	-3.30	-3.30	2	
合計	36,111,506,461	35,834,319,274	-0.77	-0.77	—	

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 5 年年底股票集中市場平均殖利率加計 250 個基本點為基準。

102 年第二次委託經營(續約 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 10 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (111.1.24~113.10.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
統一	14,437,134,744	21,486,650,943	33.79	48.83	1	41.80
復華	18,009,802,076	24,599,557,658	31.38	35.29	2	
合計	32,446,936,820	46,086,208,601	32.48	41.15	—	

註：本批次為相對報酬型，以臺灣加權股價報酬指數為指定指標。

103 年第一次委託經營(續約 2) 單位：新臺幣元

投信 名稱	委託金額	目前淨資產	113 年截至 10 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (111.10.11~113.10.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	目標報酬率 (%)
台新	15,841,461,125	22,274,543,734	13.85	40.61	—	12.84

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 10 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (110.12.1~113.10.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
國泰	14,836,482,661	21,760,193,425	22.94	48.40	5	52.52
統一	11,353,734,691	17,192,673,960	23.26	51.43	1	
復華	10,890,868,617	16,391,847,819	23.43	50.51	2	
滙豐	10,790,827,015	16,118,311,077	23.13	49.37	3	
安聯	15,017,345,063	22,086,460,005	22.31	48.63	4	
合計	62,889,258,047	93,549,486,286	22.97	49.55	—	

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 10 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (112.4.6~113.10.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	目標報酬率 (%)
復華	4,799,121,512	6,467,938,083	21.45	34.77	1	9.81
安聯	3,601,238,896	4,643,315,403	19.64	28.94	2	
合計	8,400,360,408	11,111,253,486	20.69	32.27	—	

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。

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 10 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (112.2.7~113.10.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	目標報酬率 (%)
安聯	14,088,712,403	19,942,682,970	21.15	41.55	1	10.82
國泰	6,318,453,600	8,052,530,309	13.70	27.44	4	
群益	6,382,621,945	8,144,003,715	9.85	27.60	3	
滙豐	7,096,535,878	9,062,355,015	14.66	27.70	2	
合計	33,886,323,826	45,201,572,009	16.32	33.39	—	

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。

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 10 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (112.10.24~113.10.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
台新	8,254,694,051	12,372,083,031	35.21	49.88	1	49.62
安聯	12,775,472,416	18,965,884,167	34.61	48.46	5	
保德信	9,403,481,285	14,074,856,497	35.66	49.68	2	
統一	12,635,490,783	18,752,372,171	34.43	48.41	6	
國泰	10,445,956,159	15,386,285,190	33.98	47.29	7	
復華	7,235,716,436	10,762,512,515	34.72	48.74	4	
群益	4,439,275,178	6,612,092,953	34.99	48.95	3	
合計	65,190,086,308	96,926,086,524	34.74	48.68	—	

註：本批次為相對報酬型，以臺灣永續報酬指數為指定指標。

107 年第二次委託經營（續約）

單位：新臺幣元

投信 名稱	委託金額	目前淨資產	113 年截至 10 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (113.5.24~113.10.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	目標報酬率 (%)
安聯	11,613,817,760	12,304,143,552	5.94	5.94	4	2.69
施罗德	11,400,361,947	12,056,830,379	5.76	5.76	5	
統一	11,638,402,860	11,984,788,996	2.98	2.98	6	
野村	18,601,693,072	20,142,642,591	8.28	8.28	2	
國泰	19,457,627,824	20,911,799,986	7.47	7.47	3	
復華	9,724,896,734	10,587,504,549	8.87	8.87	1	
合計	82,436,800,197	87,987,710,053	6.73	6.73	—	

註：本批次為絕對報酬型，契約目標報酬率係以臺灣證交所公告之最近 5 年年底股票集中市場平均殖利率加計 250 個基本點為基準。

109 年第一次委託經營

單位：新臺幣元

投信 名稱	委託金額	目前淨資產	113 年截至 10 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (110.5.13~113.10.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	目標報酬率 (%)
台新	8,000,000,000	10,654,599,545	14.45	33.18	4	20.01
安聯	8,000,000,000	10,849,905,105	21.01	35.62	3	
保德信	8,000,000,000	9,924,442,580	14.90	24.06	5	
國泰	8,000,000,000	12,098,666,573	27.75	51.23	1	
野村	8,000,000,000	10,981,475,475	22.88	37.27	2	
合計	40,000,000,000	54,509,089,278	20.28	36.27	—	

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 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 10 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (111.5.13~113.10.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
安聯	3,000,000,000	4,893,313,376	4.87	57.34	4	68.02
保德信	3,000,000,000	5,012,699,343	5.90	62.45	1	
野村	3,000,000,000	5,058,344,652	6.05	60.34	2	
國泰	3,000,000,000	4,959,023,057	6.11	58.72	3	
富邦	3,000,000,000	4,823,843,268	4.63	53.33	5	
合計	15,000,000,000	24,747,223,696	5.52	58.44	—	

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 10 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (110.12.15~113.10.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	目標報酬率 (%)
安聯	8,000,000,000	10,012,919,569	21.58	28.89	3	17.91
保德信	8,000,000,000	9,626,080,158	7.02	22.69	5	
國泰	8,000,000,000	10,303,509,284	23.78	35.15	1	
第一金	8,000,000,000	8,553,156,673	0.39	6.70	6	
野村	8,000,000,000	9,907,809,367	22.37	25.01	4	
富邦	8,000,000,000	10,198,119,821	23.47	29.96	2	
合計	48,000,000,000	58,601,594,872	16.26	24.70	—	

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 10 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (112.10.5~113.10.31)		
				投資 報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
安聯	2,000,000,000	2,437,838,681	19.19	21.89	4	6.63
施罗德	2,000,000,000	2,507,348,764	23.59	25.37	2	
國泰	2,000,000,000	2,677,986,059	22.81	33.90	1	
第一金	2,000,000,000	2,070,279,463	-0.51	3.51	7	
野村	2,000,000,000	2,460,007,749	22.35	23.00	3	
華南 永昌	2,000,000,000	2,253,358,081	6.55	12.67	6	
滙豐	2,000,000,000	2,335,450,063	11.84	16.77	5	
合計	14,000,000,000	16,742,268,860	15.07	19.59	—	

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 10 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (111.1.28~113.10.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	目標報酬率 (%)
富邦	12,256,867,963	15,426,378,622	22.65	25.86	2	16.79
統一	10,364,185,361	13,129,697,094	12.75	26.68	1	
合計	22,621,053,324	28,556,075,716	17.89	26.24	—	

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 10 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (109.11.2~113.10.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
滙豐	3,685,000,000	8,561,492,680	28.34	97.15	—	108.20

註：本批次為相對報酬型，以臺灣加權股價報酬指數為指定指標。

國內 101 年第二次委託經營(續約 3)

單位：新臺幣元

投信 名稱	委託金額	目前淨資產	113 年截至 10 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (113.05.04~113.10.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	目標報酬率 (%)
野村	27,357,530,009	30,980,864,420	13.24	13.24	—	3.02

註：本批次為絕對報酬型，契約目標報酬率係以臺灣證交所公告之最近 5 年年底股票集中市場平均殖利率加計 250 個基本點為基準。

國內 104 年第一次委託經營(續約 2)

單位：新臺幣元

投信 名稱	委託金額	目前淨資產	113 年截至 10 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (112.4.6~113.10.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	目標報酬率 (%)
復華	4,800,107,976	6,469,325,027	21.46	34.77	1	9.81
安聯	3,601,947,821	4,644,234,124	19.64	28.94	2	
合計	8,402,055,797	11,113,559,151	20.69	32.27	—	

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。

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 10 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (112.2.7~113.10.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	目標報酬率 (%)
安聯	14,089,937,312	19,944,980,735	21.15	41.55	1	10.82
國泰	6,319,107,110	8,053,673,375	13.70	27.45	4	
群益	6,384,957,618	8,151,464,211	9.90	27.67	3	
滙豐	7,097,524,598	9,063,824,066	14.66	27.70	2	
合計	33,891,526,638	45,213,942,387	16.32	33.41	—	

註：本批次為絕對報酬型，112.2.7 加碼安聯 30 億元，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 10 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (111.5.13~113.10.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
安聯	1,000,000,000	1,631,289,129	4.88	57.40	4	68.02
保德信	1,000,000,000	1,671,026,795	5.90	62.46	1	
野村	1,000,000,000	1,686,256,052	6.05	60.35	2	
國泰	1,000,000,000	1,653,184,255	6.12	58.77	3	
富邦	1,000,000,000	1,608,001,023	4.63	53.43	5	
合計	5,000,000,000	8,249,757,254	5.52	58.48	—	

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 10 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (112.10.5~113.10.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	目標報酬率 (%)
安聯	500,000,000	607,869,303	18.98	21.57	4	6.63
施羅德	500,000,000	626,953,815	23.62	25.39	2	
國泰	500,000,000	669,911,095	22.89	33.98	1	
第一金	500,000,000	517,552,828	-0.52	3.51	7	
野村	500,000,000	615,124,036	22.39	23.02	3	
華南 永昌	500,000,000	563,373,683	6.54	12.67	6	
滙豐	500,000,000	583,881,127	11.85	16.78	5	
合計	3,500,000,000	4,184,665,887	15.06	19.56	—	

(二) 113 年 10 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 10 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (110.6.7~113.10.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
聯博	907,613,021	770,337,257	-0.82	-15.12	2	-14.88
富蘭克林 坦伯頓	1,251,737,838	1,170,832,989	-1.62	-11.94	1	
合計	2,159,350,859	1,941,170,246	-1.30	-13.60	—	

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 10 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (111.1.6~113.10.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
PIMCO	2,158,967,886	1,986,499,971	-0.50	-10.33	—	-11.68

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 10 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (111.2.6~113.10.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
貝萊德	1,734,805,538	2,196,563,491	17.23	26.62	1	21.45
JPMorgan	1,485,120,883	1,850,529,818	15.90	24.60	2	
合計	3,219,926,421	4,047,093,309	16.62	25.69	—	

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 10 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (111.11.17~113.10.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
景順	656,507,639	812,519,452	13.65	23.76	—	24.18

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 10 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (111.12.4~113.10.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
貝萊德	1,141,092,316	1,532,052,712	15.82	35.89	2	35.59
道富	1,513,655,177	2,044,351,345	16.47	36.76	1	
合計	2,654,747,493	3,576,404,057	16.19	36.39	—	

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 10 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (110.7.1~113.10.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
道富	934,565,605	1,180,611,835	13.02	26.33	1	24.31
貝萊德	939,726,931	1,180,431,366	12.40	25.61	2	
合計	1,874,292,536	2,361,043,201	12.71	25.97	—	

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 10 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (111.3.6~113.10.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
Cohen & Steers	2,485,932,432	2,451,054,781	7.55	-2.93	1	-6.08
景順	1,567,127,452	1,464,971,838	2.80	-7.29	2	
合計	4,053,059,884	3,916,026,619	5.72	-4.59	—	

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 10 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (111.7.31~113.10.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
Pictet	618,843,493	701,085,026	1.09	13.82	—	14.72

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 10 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (112.4.18~113.10.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
道富	1,163,392,347	1,346,242,299	12.59	16.07	2	15.56
貝萊德	1,252,011,599	1,446,167,804	12.63	16.31	1	
合計	2,415,403,946	2,792,410,103	12.61	16.19	—	

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 10 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (113.1.22~113.10.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
瑞萬通博	1,716,000,834	1,871,863,594	9.08	9.08	3	12.40
MFS	1,114,480,846	1,254,582,086	12.57	12.57	1	
威靈頓	1,427,914,919	1,597,284,889	11.86	11.86	2	
合計	4,258,396,599	4,723,730,569	10.93	10.93	—	

102-1 全球信用主動債券型（續約 2）

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	113 年截至 10 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (113.4.25~113.10.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
RBC	1,086,559,371	1,156,025,595	6.39	6.39	1	5.57
貝萊德	670,392,768	707,780,853	5.58	5.58	2	
盧米斯	891,561,542	941,230,585	5.57	5.57	3	
合計	2,648,513,681	2,805,037,033	5.91	5.91	—	

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 10 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (109.8.11~113.10.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
北美信託	1,796,617,127	2,850,514,524	19.82	69.72	1	67.41
LGIM	1,795,083,447	2,842,338,904	19.67	69.18	3	
Geode	1,775,075,832	2,820,622,421	19.63	69.70	2	
合計	5,366,776,406	8,513,475,849	19.70	69.53	—	

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 10 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (109.9.25~113.10.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
Magellan	1,287,520,518	1,708,928,671	8.05	30.40	2	42.42
RREEF	926,848,763	1,334,372,634	14.29	43.97	1	
合計	2,214,369,281	3,043,301,305	10.74	35.94	—	

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 10 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (109.11.13~113.10.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
Brandywine	821,176,083	695,209,044	-5.69	-16.99	2	-14.70
盧米斯	471,104,127	432,427,127	-1.42	-11.39	1	
合計	1,292,280,210	1,127,636,171	-4.10	-15.06	—	

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 10 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (110.7.20~113.10.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標/目標報酬率(%)
Allianz	678,698,278	723,248,638	8.05	5.23	3	11.67/28.11
JPMorgan	1,645,715,430	1,747,807,344	9.51	6.20	2	
DWS	1,025,711,371	1,119,655,234	5.15	9.12	1	
柏瑞	765,326,657	740,905,418	4.39	-3.19	4	
合計	4,115,451,736	4,331,616,634	7.19	4.85	—	

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 10 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (110.8.24~113.10.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
貝萊德	949,175,052	1,034,499,147	10.45	8.99	—	8.02

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 10 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (111.6.22~113.10.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
貝萊德	601,552,002	794,865,065	10.15	34.36	4	34.39
DWS	648,715,051	886,970,268	11.35	37.04	2	
道富	749,045,562	998,056,183	11.40	37.09	1	
北美信託	702,047,560	935,093,121	10.89	35.16	3	
合計	2,701,360,175	3,614,984,637	10.98	35.97	—	

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 10 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (111.7.25~113.10.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標/目標 報酬率(%)
American Century	427,360,620	475,682,239	4.34	11.31	3	11.15/16.83
富達	965,211,657	1,077,104,305	5.40	17.75	1	
TCW	1,039,618,153	1,167,664,549	4.91	12.30	2	
合計	2,432,190,430	2,720,451,093	5.01	14.34	—	

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 10 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (113.1.23~113.10.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標/目標 報酬率(%)
景順	786,698,949	894,083,099	13.65	13.65	2	3.94/7.82
威靈頓	787,219,463	880,458,499	11.84	11.84	4	
CPR	778,885,217	889,894,097	14.25	14.25	1	
道富	706,462,703	797,195,003	12.84	12.84	3	
合計	3,059,266,332	3,461,630,698	13.15	13.15	—	

註：本批次為絕對報酬型，契約目標報酬率係以 US 3-Month T-Bill（指標報酬率）加計 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 10 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (108.12.18~113.10.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
Amundi	350,000,000	442,224,930	6.66	12.77	4	19.59
DWS	300,000,000	373,472,934	7.89	10.82	5	
Nomura	400,000,000	543,021,712	4.68	25.39	3	
荷寶	300,000,000	462,385,091	9.40	35.36	1	
道富	300,000,000	448,547,731	8.43	30.28	2	
合計	1,650,000,000	2,269,652,398	7.25	22.00	—	

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 10 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (110.1.13~113.10.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
DWS	600,000,000	603,731,024	3.11	-5.48	4	-4.61
Insight	700,000,000	723,794,532	3.44	-3.74	1	
JPMorgan	400,000,000	389,093,799	3.77	-4.63	2	
PIMCO	480,000,000	475,931,017	3.50	-4.84	3	
Western	400,000,000	382,848,921	3.29	-5.82	5	
合計	2,580,000,000	2,575,399,293	3.40	-4.92	—	

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 10 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (110.9.8~113.10.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
CBRE	350,000,000	391,698,221	11.57	12.52	3	13.56
Clearbridge	450,000,000	500,834,517	9.34	13.69	1	
Magellan	350,000,000	377,431,885	8.53	6.21	4	
RREEF	350,000,000	393,571,326	15.14	12.82	2	
合計	1,500,000,000	1,663,535,949	11.00	11.30	—	

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 10 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (110.10.15~113.10.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標/目標 報酬率(%)
富達	400,000,000	397,759,918	10.43	-0.97	5	11.66/26.91
JPMorgan	400,000,000	417,738,560	9.51	4.25	3	
Ninety One	400,000,000	417,509,208	2.95	3.83	4	
Schroders	400,000,000	430,976,027	9.44	7.30	1	
T. Rowe Price	400,000,000	426,783,737	9.27	5.44	2	
合計	2,000,000,000	2,090,767,450	8.24	3.97	—	

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 10 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (112.4.28~113.10.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
滙豐	200,000,000	258,228,577	17.56	32.49	3	31.81
LGIM	200,000,000	257,533,284	16.76	31.63	4	
摩根士丹利	200,000,000	253,543,810	16.57	28.83	5	
Schroders	200,000,000	256,691,352	16.63	32.71	2	
威靈頓	200,000,000	261,310,769	18.31	34.45	1	
合計	1,000,000,000	1,287,307,792	17.17	32.02	—	

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 10 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (112. 7. 19~113. 10. 31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標/目標 報酬率(%)
盧米斯	500,000,000	537,188,809	6.14	10.91	1	6.75/9.98
Ninety One	500,000,000	536,392,415	5.89	9.64	3	
PIMCO	500,000,000	533,109,824	4.60	8.64	4	
PGIM	500,000,000	533,454,121	6.50	10.59	2	
T. Rowe Price	500,000,000	511,088,467	3.15	3.17	6	
威靈頓	500,000,000	520,622,904	4.42	6.64	5	
合計	3,000,000,000	3,171,856,540	5.13	8.28	—	

註：本批次為絕對報酬型，契約目標報酬率係以 US 3-Month T-Bill(指標報酬率)加計 250 個基本點為基準。

112-1 全球被動股票型

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	113 年截至 10 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (113. 6. 27~113. 10. 31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
Amundi	100,000,000	103,928,002	3.93	3.93	4	4.03
LGIM	100,000,000	103,974,656	3.97	3.97	2	
道富	100,000,000	103,979,161	3.98	3.98	1	
北美信託	100,000,000	103,946,514	3.95	3.95	3	
合計	400,000,000	415,828,333	3.96	3.96	—	

2. 舊制勞工退休基金

96 國際平衡型(續約 4)

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	113 年截至 10 月 累積投資報酬率(%)	委任迄今 (113.6.24~113.10.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
富達	753,144,454	796,949,905	5.82	5.82	—	3.45

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 10 月 累積投資報酬率(%)	委任迄今 (111.1.6~113.10.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
PIMCO	1,003,724,736	899,832,293	-0.50	-10.35	1	-11.68
盧米斯	1,018,693,762	907,303,309	-0.55	-12.07	2	
合計	2,022,418,498	1,807,135,602	-0.51	-11.17	—	

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 10 月 累積投資報酬率(%)	委任迄今 (111.2.6~113.10.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
貝萊德	1,156,987,544	1,464,306,331	17.14	26.56	—	21.45

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 10 月 累積投資報酬率(%)	委任迄今 (111.11.17~113.10.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
景順	231,124,998	290,551,068	13.30	23.26	—	24.18

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 10 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (111.3.6~113.10.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
貝萊德	304,997,166	387,645,640	12.39	27.10	3	25.85
道富	360,436,214	460,205,961	12.84	27.68	1	
瑞銀	308,879,836	393,535,218	12.43	27.41	2	
Nomura	360,147,608	457,274,530	12.32	26.97	4	
合計	1,334,460,824	1,698,661,349	12.50	27.29	—	

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 10 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (112.4.18~113.10.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
貝萊德	751,993,706	875,168,418	12.65	16.38	—	15.56

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 10 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (113.1.22~113.10.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
瑞萬通博	414,056,068	451,594,716	9.07	9.07	3	12.40
MFS	315,296,707	354,613,777	12.47	12.47	1	
威靈頓	704,502,354	787,968,578	11.85	11.85	2	
合計	1,433,855,129	1,594,177,071	11.18	11.18	—	

102-2 全球基礎建設有價證券型(續約 2)

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	113 年截至 10 月 累積投資報酬 (%)	委任迄今 (113.5.29~113.10.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
Lazard	954,418,976	1,007,069,521	5.52	5.52	—	12.02

102-2 全球不動產有價證券型（續約 2）

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	113 年截至 10 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (113.8.27~113.10.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
信安環球	708,888,643	695,863,392	-1.84	-1.84	2	-1.82
Macquarie	144,937,350	144,127,033	-0.56	-0.56	1	
合計	853,825,993	839,990,425	-1.62	-1.62	—	

105-1 全球多元資產型（續約）

單位：美元

受託機構	委託金額	目前淨資產	113 年截至 10 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (110.7.20~113.10.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標/目標 報酬率(%)
Allianz	155,447,975	163,773,107	8.00	5.36	3	11.67/28.11
摩根	594,592,070	634,237,028	9.59	6.67	2	
DWS	311,387,682	340,019,740	5.14	9.19	1	
柏瑞	254,823,294	246,545,818	4.38	-3.25	4	
合計	1,316,251,021	1,384,575,693	7.33	5.19	—	

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 10 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (111.6.22~113.10.31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
貝萊德	127,303,524	170,545,754	10.01	33.97	4	34.39
DWS	147,528,441	201,980,693	11.31	36.91	2	
道富	157,982,595	216,427,070	11.28	36.99	1	
北美信託	158,484,700	213,934,992	10.90	34.99	3	
合計	591,299,260	802,888,509	10.91	35.78	—	

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 10 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (111. 7. 25~113. 10. 31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標/目標 報酬率(%)
American Century	319, 635, 794	355, 588, 117	4. 28	11. 25	3	11. 15/16. 83
富達	279, 785, 344	334, 601, 111	5. 44	18. 22	1	
TCW	328, 000, 470	369, 775, 607	5. 23	12. 74	2	
合計	927, 421, 608	1, 059, 964, 835	4. 98	13. 97	—	

註 1：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。

註 2：113.10.1 富達減碼 0.2 億美元。

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 10 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (113. 1. 23~113. 10. 31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標/目標 報酬率(%)
景順	116, 977, 839	132, 944, 004	13. 65	13. 65	2	3. 94/7. 82
威靈頓	107, 476, 614	120, 212, 194	11. 85	11. 85	3	
CPR	115, 110, 097	131, 529, 699	14. 26	14. 26	1	
合計	339, 564, 550	384, 685, 897	13. 29	13. 29	—	

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 10 月 累積投資報酬(%)	委任迄今 (110. 9. 8~113. 10. 31)		
				投資報酬率 (%)	排名	指標報酬率 (%)
CBRE	60, 000, 000	66, 883, 816	11. 77	12. 79	3	13. 56
ClearBridge	60, 000, 000	67, 189, 652	10. 37	14. 91	1	
Magellan	30, 000, 000	32, 043, 159	8. 50	6. 81	4	
RREEF	60, 000, 000	67, 300, 566	15. 15	13. 52	2	
合計	210, 000, 000	233, 417, 193	11. 61	12. 18	—	

(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 10 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 10 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 10 月份	8,943,455,490	89,392,328,001	80,448,872,511

(二)舊制勞工退休基金

單位：新臺幣元

	餘絀	收入	支出
113 年 10 月份	5,396,576,446	5,558,739,240	162,162,794

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 10 月份		單位：新臺幣元
項 目	金 額	
現金收入	142,796,875,683	
現金支出	142,097,533,919	
現金增(減)數		699,341,764

(二)舊制勞工退休基金

113 年 10 月份		單位：新臺幣元
項 目	金 額	
現金收入	27,697,126,650	
現金支出	27,696,846,365	
現金增(減)數		280,285