

勞工保險基金 國外委託經營績效統計表
102年6月30日

第一梯次(續約)國外委託經營績效統計表

單位：美元

	第一梯次(續約) (自98年11月1日起)	第一梯次 (續約)加碼 (自99年7月1日起)	第一梯次 (續約)加碼 (自100年2月1日起)
委託經營金額	350,000,000	79,276,014	100,000,000
委託經營月底資產淨值	463,568,647	127,208,117	104,376,839
累積總損益	113,568,647	47,932,103	4,376,839
委託經營總報酬率	32.45%	60.46%	4.38%

(一) 第一梯次續約：始自98年11月1日

委託經理人	委託投資金額	目前資產淨值	今年以來 帳戶報酬率	帳戶 累積報酬率	指標 累計報酬率	超越指標幅度	超越指標幅度 排名
全球債券型委託							
PIMCO	100,000,000	116,102,146	-5.72%	16.10%	7.02%	9.08%	1
Alliance Bernstein	100,000,000	112,347,597	-5.27%	12.35%	7.02%	5.32%	2
小計	200,000,000	228,449,743	-5.50%	14.22%	7.02%	7.20%	
全球股票型委託							
Wellington	150,000,000	235,118,904	12.54%	56.75%	40.48%	16.26%	1
合計	350,000,000	463,568,647	2.86%	32.45%			

(二) 第一梯次續約加碼【全球股票型委託】：始自99年7月1日

委託經理人	委託投資金額	目前資產淨值	今年以來 帳戶報酬率	帳戶 累積報酬率	指標 累計報酬率	超越指標幅度	超越指標幅度 排名
Wellington (II)	79,276,014	127,208,117	12.49%	60.46%	47.05%	13.41%	1

(三) 第一梯次續約加碼【全球債券型委託】：始自100年2月1日

委託經理人	委託投資金額	目前資產淨值	今年以來 帳戶報酬率	帳戶 累積報酬率	指標 累計報酬率	超越指標幅度	超越指標幅度 排名
Alliance Bernstein (II)	100,000,000	104,376,839	-5.31%	4.38%	2.58%	1.80%	1

附註：

1. 本表資訊採「市價法」評估；資產淨值因四捨五入問題致有尾數差。
2. 本基金第一梯次(續約)之委託起始日期為98年11月1日；另本梯次共辦理兩次加碼，加碼起始日期分別為99年7月1日、100年2月1日。
3. 全球股票型委託市場指標為MSCI World Index；全球債券型委託市場指標為Barclays Capital Global Aggregate A- or better Bond Index。

第三梯次國外委託經營績效統計表

單位：美元

	第三梯次 (自99年2月1日起)	第三梯次 加碼 (自101年1月1日起)
委託經營金額	600,000,000	200,000,000
委託經營月底資產淨值	684,840,105	203,635,779
累積總損益	84,840,105	3,635,779
委託經營總報酬率	14.14%	1.82%

(一) 第三梯次：始自99年2月1日

委託經理人	委託投資金額	目前資產淨值	今年以來 帳戶報酬率	帳戶 累積報酬率	指標 累計報酬率	超越指標幅度	超越指標幅度 排名
全球債券型委託							
Standish Mellon	200,000,000	225,538,260	-4.83%	12.77%	10.25%	2.52%	2
Wellington	200,000,000	223,656,610	-5.53%	11.83%	10.25%	1.58%	3
PIMCO	200,000,000	235,645,235	-5.53%	17.82%	10.25%	7.57%	1
合計	600,000,000	684,840,105	-5.30%	14.14%	10.25%	3.89%	

(二) 第三梯次加碼：始自101年1月1日

委託經理人	委託投資金額	目前資產淨值	今年以來 帳戶報酬率	帳戶 累積報酬率	指標 累計報酬率	超越指標幅度	超越指標幅度 排名
全球債券型委託							
PIMCO	200,000,000	203,635,779	-5.55%	1.82%	-0.72%	2.54%	1

附註

1. 本表資訊採「市價法」評估。資產淨值因四捨五入問題致有尾數差。
2. 第三梯次為全球債券型委託，市場指標為Barclays Capital Global Aggregate Bond Index。

第四梯次國外委託經營績效統計表

單位：美元

	第四梯次 (自100年11月1日起)
委託經營金額	600,000,000
委託經營月底資產淨值	760,918,839
累積總損益	160,918,839
委託經營總報酬率	26.82%

委託經理人	委託投資金額	目前資產淨值	今年以來 帳戶報酬率	帳戶 累積報酬率	指標 累計報酬率	超越指標幅度	超越指標幅度 排名
全球股票型委託							
MFS	200,000,000	277,266,441	11.60%	38.63%	22.45%	16.18%	1
BlackRock	200,000,000	253,205,845	9.55%	26.60%	25.52%	1.08%	2
Amundi	200,000,000	230,446,553	5.16%	15.22%	25.22%	-10.00%	3
合計	600,000,000	760,918,839	8.90%	26.82%			

附註

1. 本表資訊採「市價法」評估。資產淨值因四捨五入問題致有尾數差。
2. 本梯次委託採分批撥款，MFS之撥款日期為100年11月1日，BlackRock之撥款日期為100年12月1日，Amundi之撥款日期為101年1月3日。
3. 本梯次為全球股票型委託，市場指標為MSCI World Index。

101年度國外委託經營績效統計表

單位：美元

	101年度國外委託 (自101年10月1日起)
委託經營金額	450,000,000
委託經營月底資產淨值	425,480,040
累積總損益	-24,519,960
委託經營總報酬率	-5.45%

委託經理人	委託投資金額	目前資產淨值	今年以來 帳戶報酬率	帳戶 累積報酬率	指標 累計報酬率	超越指標幅度	超越指標幅度 排名
全球新興市場債券型委託							
Stone Harbor	150,000,000	140,087,373	-8.38%	-6.61%	-3.87%	-2.74%	3
BlueBay	150,000,000	144,507,999	-6.75%	-3.66%	-3.67%	0.01%	1
Templeton	150,000,000	140,884,668	-7.67%	-6.08%	-3.67%	-2.41%	2
合計	450,000,000	425,480,040	-7.59%	-5.45%			

附註

1. 本表資訊採「市價法」評估。資產淨值因四捨五入問題致有尾數差。
2. 本梯次委託採分批撥款，Stone Harbor之撥款日期為101年10月1日，Bluebay與Templeton之撥款日期均為101年11月1日。
3. 本梯次為全球新興市場債券型委託，市場指標為JPMorgan GBI-EM Global Diversified, Investment Grade Index。

101年度續約國外委託經營績效統計表

單位：美元

	101年度續約國外委託 (自101年10月1日起)
委託經營金額	850,105,447
委託經營月底資產淨值	807,523,528
累積總損益	-42,581,919
委託經營總報酬率	-5.01%

委託經理人	委託投資金額	目前資產淨值	今年以來 帳戶報酬率	帳戶 累積報酬率	指標 累計報酬率	超越指標幅度	超越指標幅度 排名
全球新興市場股票型委託							
Vontobel	309,910,147	309,198,623	-4.83%	-0.23%	-5.01%	4.78%	1
被動式全球債券型委託							
SSgA	273,853,877	252,584,025	-6.09%	-7.77%	-7.65%	-0.12%	2
Vanguard	266,341,424	245,740,880	-6.06%	-7.73%	-7.65%	-0.08%	1
小計	540,195,301	498,324,904	-6.08%	-7.75%	-7.65%	-0.10%	
合計	850,105,447	807,523,528	-5.60%	-5.01%			

附註

1. 本表資訊採「市價法」評估。資產淨值因四捨五入問題致有尾數差。
2. 全球新興市場股票型委託市場指標為FTSE AW Emerging Markets ex Taiwan。
3. 被動式全球債券型委託市場指標為Barclays Capital Global Treasury Index。