

勞保基金 國外委託經營績效統計表
102年9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	492,196,785	139,953,921	106,831,757
累積總損益	142,196,785	60,677,907	6,831,757
委託經營總報酬率	40.63%	76.54%	6.83%

(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	118,593,226	-3.70%	18.59%	9.76%	8.83%	1
Alliance Bernstein	100,000,000	114,924,420	-3.09%	14.92%	9.76%	5.16%	2
小計	200,000,000	233,517,646	-3.40%	16.76%	9.76%	7.00%	
全球股票型委託							
Wellington	150,000,000	258,679,139	23.82%	72.45%	51.97%	20.48%	1
合計	350,000,000	492,196,785	9.22%	40.63%			

(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	139,953,921	23.76%	76.54%	59.08%	17.46%	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	106,831,757	-3.08%	6.83%	5.20%	1.63%	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。

勞保基金 國外委託經營績效統計表
102年9月30日

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	700,228,253	209,021,988
累積總損益	100,228,253	9,021,988
委託經營總報酬率	16.70%	4.51%

(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	230,309,225	-2.82%	15.15%	13.33%	1.82%	2
Wellington	200,000,000	228,410,273	-3.52%	14.21%	13.33%	0.88%	3
PIMCO	200,000,000	241,508,756	-3.18%	20.75%	13.33%	7.42%	1
合計	600,000,000	700,228,253	-3.17%	16.70%	13.33%	3.37%	

(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	209,021,988	-3.05%	4.51%	2.06%	2.45%	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。

勞保基金 國外委託經營績效統計表
102年9月30日

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	818,407,302
累積總損益	218,407,302
委託經營總報酬率	36.40%

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	299,263,857	20.45%	49.63%	32.47%	17.16%	1
BlackRock	200,000,000	271,466,742	17.45%	35.73%	35.78%	-0.05%	2
Amundi	200,000,000	247,676,703	13.02%	23.84%	35.46%	-11.62%	3
合計	600,000,000	818,407,302	17.13%	36.40%			

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。

勞保基金 國外委託經營績效統計表
102年9月30日

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	429,158,031
累積總損益	-20,841,969
委託經營總報酬率	-4.63%

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	141,134,469	-7.69%	-5.91%	-2.74%	-3.17%	3
BlueBay	150,000,000	145,409,948	-6.17%	-3.06%	-2.54%	-0.52%	1
Templeton	150,000,000	142,613,613	-6.54%	-4.92%	-2.54%	-2.38%	2
合計	450,000,000	429,158,031	-6.80%	-4.63%			

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。

勞保基金 國外委託經營績效統計表
102年9月30日

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	813,735,007
累積總損益	-36,370,440
委託經營總報酬率	-4.28%

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	300,510,060	-7.50%	-3.03%	-0.77%	-2.26%	1
被動式全球債券型委託							
SSgA	273,853,877	260,122,457	-3.28%	-5.01%	-4.84%	-0.17%	2
Vanguard	266,341,424	253,102,490	-3.25%	-4.97%	-4.84%	-0.13%	1
小計	540,195,301	513,224,947	-3.27%	-4.99%	-4.84%	-0.15%	
合計	850,105,447	813,735,007	-4.88%	-4.28%			

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。