

勞工保險基金 國外委託經營績效統計表

102年4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 | 474,019,999 | 127,106,673 | 108,638,944 |
| 累積總損益 | 124,019,999 | 47,830,658 | 8,638,944 |
| 委託經營總報酬率 | 35.43% | 60.33% | 8.64% |

(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 | 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 | 122,204,411 | -0.77% | 22.20% | 11.41% | 10.79% | 1 |
| Alliance Bernstein | 100,000,000 | 116,895,402 | -1.43% | 16.90% | 11.41% | 5.49% | 2 |
| 小計 | 200,000,000 | 239,099,812 | -1.09% | 19.55% | 11.41% | 8.14% | |
| 全球股票型委託 | | | | | | | |
| Wellington | 150,000,000 | 234,920,187 | 12.44% | 56.61% | 43.98% | 12.63% | 1 |
| 合計 | 350,000,000 | 474,019,999 | 5.18% | 35.43% | | | |

(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 | 超越指標幅度 | 超越指標幅度 排名 |
|-----------------|------------|-------------|-----------|---------|--------|--------|--------------|
| Wellington (II) | 79,276,014 | 127,106,673 | 12.40% | 60.33% | 50.71% | 9.62% | 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 | 超越指標幅度 | 超越指標幅度 排名 |
|-------------------------|-------------|-------------|-----------|---------|--------|--------|--------------|
| Alliance Bernstein (II) | 100,000,000 | 108,638,944 | -1.44% | 8.64% | 6.78% | 1.86% | 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。

勞工保險基金 國外委託經營績效統計表
102年4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 | 720,403,113 | 215,266,451 |
| 累積總損益 | 120,403,113 | 15,266,451 |
| 委託經營總報酬率 | 20.07% | 7.63% |

(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 | 236,880,184 | -0.04% | 18.44% | 14.98% | 3.46% | 2 |
| Wellington | 200,000,000 | 234,348,152 | -1.01% | 17.17% | 14.98% | 2.19% | 3 |
| PIMCO | 200,000,000 | 249,174,777 | -0.11% | 24.59% | 14.98% | 9.60% | 1 |
| 合計 | 600,000,000 | 720,403,113 | -0.38% | 20.07% | 14.98% | 5.08% | |

(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 | 215,266,451 | -0.15% | 7.63% | 3.55% | 4.08% | 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。

勞工保險基金 國外委託經營績效統計表
102年4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 | 771,486,248 |
| 累積總損益 | 171,486,248 |
| 委託經營總報酬率 | 28.58% |

| 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 | 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 | 277,130,985 | 11.54% | 38.57% | 25.50% | 13.07% | 1 |
| BlackRock | 200,000,000 | 257,411,946 | 11.37% | 28.71% | 28.64% | 0.06% | 2 |
| Amundi | 200,000,000 | 236,943,317 | 8.13% | 18.47% | 28.33% | -9.86% | 3 |
| 合計 | 600,000,000 | 771,486,248 | 10.41% | 28.58% | | | |

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。

勞工保險基金 國外委託經營績效統計表
102年4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 | 474,209,707 |
| 累積總損益 | 24,209,707 |
| 委託經營總報酬率 | 5.38% |

| 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 | 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 | 157,370,308 | 2.93% | 4.91% | 7.46% | -2.55% | 2 |
| BlueBay | 150,000,000 | 161,658,782 | 4.32% | 7.77% | 7.69% | 0.09% | 1 |
| Templeton | 150,000,000 | 155,180,616 | 1.70% | 3.45% | 7.69% | -4.23% | 3 |
| 合計 | 450,000,000 | 474,209,707 | 2.99% | 5.38% | | | |

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。

勞工保險基金 國外委託經營績效統計表
102年4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 | 861,267,554 |
| 累積總損益 | 11,162,106 |
| 委託經營總報酬率 | 1.31% |

| 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 | 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 | 341,248,758 | 5.03% | 10.11% | 5.62% | 4.49% | 1 |
| 被動式全球債券型委託 | | | | | | | |
| SSgA | 273,853,877 | 263,611,039 | -1.99% | -3.74% | -3.68% | -0.06% | 2 |
| Vanguard | 266,341,424 | 256,407,756 | -1.99% | -3.73% | -3.68% | -0.05% | 1 |
| 小計 | 540,195,301 | 520,018,795 | -1.99% | -3.74% | -3.68% | -0.06% | |
| 合計 | 850,105,447 | 861,267,554 | 0.68% | 1.31% | | | |

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。