

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。