

勞工保險基金 國外委託經營績效統計表

102年1月31日

第一梯次(續約)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	457,941,741	118,611,409	108,659,159
累積總損益	107,941,741	39,335,394	8,659,159
委託經營總報酬率	30.84%	49.62%	8.66%

(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	121,834,544	-1.07%	21.83%	11.57%	10.26%	1
Alliance Bernstein	100,000,000	116,913,586	-1.42%	16.91%	11.57%	5.34%	2
小計	200,000,000	238,748,130	-1.24%	19.37%	11.57%	7.80%	
全球股票型委託							
Wellington	150,000,000	219,193,611	4.92%	46.13%	36.16%	9.97%	1
合計	350,000,000	457,941,741	1.62%	30.84%			

(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	118,611,409	4.88%	49.62%	42.53%	7.09%	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	108,659,159	-1.42%	8.66%	6.93%	1.73%	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

勞工保險基金 國外委託經營績效統計表

102年1月31日

第三梯次績效統計表

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	717,755,609	214,430,598
累積總損益	117,755,609	14,430,598
委託經營總報酬率	19.63%	7.22%

(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	235,483,829	-0.63%	17.74%	14.78%	2.96%	2
Wellington	200,000,000	234,111,030	-1.11%	17.06%	14.78%	2.28%	3
PIMCO	200,000,000	248,160,751	-0.51%	24.08%	14.78%	9.30%	1
合計	600,000,000	717,755,609	-0.75%	19.63%	14.78%	4.85%	

(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	214,430,598	-0.54%	7.22%	3.37%	3.85%	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1月31日

第四梯次績效統計表

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	736,799,071
累積總損益	136,799,071
委託經營總報酬率	22.80%

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	264,333,594	6.39%	32.17%	18.69%	13.48%	1
BlackRock	200,000,000	242,771,606	5.03%	21.39%	21.66%	-0.27%	2
Amundi	200,000,000	229,693,871	4.82%	14.85%	21.37%	-6.52%	3
合計	600,000,000	736,799,071	5.45%	22.80%			

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1月31日

101年度績效統計表

單位：美元

	101年度 (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	463,144,777
累積總損益	13,144,777
委託經營總報酬率	2.92%

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	153,595,933	0.46%	2.40%	4.01%	-1.61%	2
BlueBay	150,000,000	156,276,677	0.85%	4.18%	4.23%	-0.05%	1
Templeton	150,000,000	153,272,167	0.45%	2.18%	4.23%	-2.05%	3
合計	450,000,000	463,144,777	0.59%	2.92%			

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1月31日

101年度續約績效統計表

單位：美元

	101年度續約 (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	852,838,284
累積總損益	2,732,836
委託經營總報酬率	0.32%

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	330,073,918	1.60%	6.51%	9.02%	-2.51%	1
被動式全球債券型委託							
SSgA	273,853,877	265,046,690	-1.45%	-3.22%	-3.19%	-0.03%	1
Vanguard	266,341,424	257,717,675	-1.48%	-3.24%	-3.19%	-0.05%	2
小計	540,195,301	522,764,365	-1.47%	-3.23%	-3.19%	-0.04%	
合計	850,105,447	852,838,284	-0.31%	0.32%			

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。