

**勞工保險基金**  
**國外委託經營績效統計表**  
**101年10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)	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	443,558,099	108,327,827	111,069,524
累積總損益	93,558,099	29,051,813	11,069,524
委託經營總報酬率	26.73%	36.65%	11.07%

(一) 第一梯次續約：自98年11月1日至101年10月31日

單位：美元、%

委託經理人	委託投資金額	目前資產淨值	投資損益	累積報酬率	今年以來報酬率
<b>全球債券型委託</b>					
PIMCO	100,000,000	123,793,884	23,793,884	23.79%	7.31%
Alliance Bernstein	100,000,000	119,526,044	19,526,044	19.53%	4.24%
小計	200,000,000	243,319,928	43,319,928	21.66%	5.78%
<b>全球股票型委託</b>					
Wellington	150,000,000	200,238,171	50,238,171	33.49%	16.26%
合計	350,000,000	443,558,099	93,558,099	26.73%	10.26%

(二) 第一梯次續約加碼【全球股票型委託】：自99年7月1日至101年10月31日

單位：美元、%

委託經理人	委託投資金額	目前資產淨值	投資損益	累積報酬率	今年以來報酬率
<b>全球股票型委託</b>					
Wellington (II)	79,276,014	108,327,827	29,051,813	36.65%	16.22%

(三) 第一梯次續約加碼【全球債券型委託】：自100年2月1日至101年10月31日

單位：美元、%

委託經理人	委託投資金額	目前資產淨值	投資損益	累積報酬率	今年以來報酬率
<b>全球債券型委託</b>					
Alliance Bernstein (II)	100,000,000	111,069,524	11,069,524	11.07%	4.17%

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. 續約帳戶中，全球股票型委託市場指標為MSCI World Index，同期間(98/11/1-101/10/31)市場報酬率為25.56%，今年以來市場報酬率為12.25%；全球債券型委託市場指標為Barclays Capital Global Aggregate A- or better Bond Index，同期間(98/11/1-101/10/31)市場報酬率為14.05%，今年以來市場報酬率為3.42%。
4. 續約加碼帳戶中，全球股票型委託市場指標為MSCI World Index，同期間(99/7/1-101/10/31)市場報酬率為31.43%，今年以來市場報酬率為12.25%；全球債券型委託市場指標為Barclays Capital Global Aggregate A- or better Bond Index，同期間(100/2/1-101/10/31)市場報酬率為9.31%，今年以來市場報酬率為3.42%。

## 101年度續約(第二梯次)績效統計表

單位：美元、%

	101年度續約(第二梯次) (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	845,198,566
累積總損益	-4,906,881
委託經營總報酬率	-0.58%

單位：美元、%

委託經理人	委託投資金額	目前資產淨值	投資損益	累積報酬率	今年以來報酬率
<b>全球新興市場股票型委託</b>					
Vontobel	309,910,147	308,506,851	-1,403,296	-0.45%	-0.45%
小計	309,910,147	308,506,851	-1,403,296	-0.45%	-0.45%
<b>被動式全球債券型委託</b>					
SSgA	273,853,877	272,073,806	-1,780,071	-0.65%	-0.65%
Vanguard	266,341,424	264,617,909	-1,723,515	-0.65%	-0.65%
小計	540,195,301	536,691,715	-3,503,586	-0.65%	-0.65%
合計	850,105,447	845,198,566	-4,906,881	-0.58%	-0.58%

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. 本基金101年度續約(第二梯次)之委託起始日為101年10月1日。
3. 全球新興市場股票型委託市場指標為FTSE AW Emerging Markets ex Taiwan, 同期間(101/10/1-101/10/31)市場報酬率為0.49%。
4. 被動式全球債券型委託市場指標為Barclays Capital Global Treasury Index, 同期間(101/10/1-101/10/31)市場報酬率為-0.64%。

### 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	722,408,527	215,223,098
累積總損益	122,408,527	15,223,098
委託經營總報酬率	20.40%	7.61%

(一) 第三梯次：自99年2月1日至101年10月31日

單位：美元、%

委託經理人	委託投資金額	目前資產淨值	投資損益	累積報酬率	今年以來報酬率
<b>全球債券型委託</b>					
Standish Mellon	200,000,000	235,821,763	35,821,763	17.91%	7.46%
Wellington	200,000,000	237,296,804	37,296,804	18.65%	5.13%
PIMCO	200,000,000	249,289,959	49,289,959	24.64%	8.84%
合計	600,000,000	722,408,527	122,408,527	20.40%	7.15%

(二) 第三梯次加碼：自101年1月1日至101年10月31日

單位：美元、%

委託經理人	委託投資金額	目前資產淨值	投資損益	累積報酬率	今年以來報酬率
<b>全球債券型委託</b>					
PIMCO	200,000,000	215,223,098	15,223,098	7.61%	7.61%

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. 第三梯次之委託撥款日期為99年2月1日。

全球債券型委託市場指標為Barclays Capital Global Aggregate Bond Index，同期間(99/2/01-101/10/31)市場報酬率為16.23%，今年以來市場報酬率為4.67%。

3. 第三梯次PIMCO加碼帳戶始於101年1月1日。指標同為Barclays Capital Global Aggregate Index，委託以來同期間(101/1/1-101/10/31)市場報酬率為4.67%，今年以來市場報酬率為4.67%。

## 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	672,189,287
累積總損益	72,189,287
委託經營總報酬率	12.03%

單位：美元；%

委託經理人	委託投資金額	目前資產淨值	投資損益	累積報酬率	今年以來報酬率
<b>全球股票型委託</b>					
MFS	200,000,000	235,004,942	35,004,942	17.50%	18.14%
BlackRock	200,000,000	224,248,304	24,248,304	12.12%	13.10%
Amundi	200,000,000	212,936,041	12,936,041	6.47%	6.47%
<b>合計</b>	<b>600,000,000</b>	<b>672,189,287</b>	<b>72,189,287</b>	<b>12.03%</b>	<b>12.56%</b>

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. 本基金第四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. 全球股票型委託市場指標為MSCI World Index，MFS帳戶委託期間(100/11/1-101/10/31)市場報酬率為9.45%，BlackRock帳戶委託期間(100/12/1-101/10/31)市場報酬率為12.19%，AMUNDI帳戶委託期間(101/1/3-101/10/31)市場報酬率為11.92%；今年以來市場報酬率為12.25%。

## 101年度(第五梯次)績效統計表

單位：美元、%

	101年度(第五梯次) (自101年10月1日起)
委託經營金額	150,000,000
委託經營月底資產淨值	148,586,622
累積總損益	-1,413,378
委託經營總報酬率	-0.94%

單位：美元；%

委託經理人	委託投資金額	目前資產淨值	投資損益	累積報酬率	今年以來報酬率
<b>全球新興市場債券型委託</b>					
Stone Harbor	150,000,000	148,586,622	-1,413,378	-0.94%	-0.94%
<b>合計</b>	<b>150,000,000</b>	<b>148,586,622</b>	<b>-1,413,378</b>	<b>-0.94%</b>	<b>-0.94%</b>

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101年度(第五梯次)委託採分批撥款，Stone Harbor之撥款日期為101年10月1日。
3. 全球新興市場債券型委託市場指標為JPMorgan GBI-EM Global Diversified, Investment Grade Index, 同期間(101/10/1-101/10/31)市場報酬率為-0.21%。