

# 勞保基金 國外委託經營投資績效、績效指標及排名表

101年11月30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	447,862,513	110,804,908	110,866,543
累積總損益	97,862,513	31,528,894	10,866,543
委託經營總報酬率	27.96%	39.77%	10.87%

(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	本月報酬率	帳戶當年度 截至當月報酬率	帳戶 累積投資績效	績效指標 累計報酬	超越 指標幅度	超越指標 幅度排名
<b>全球債券型委託</b>								
PIMCO	100,000,000	123,797,891	0.003%	7.31%	23.80%	13.79%	10.01%	1
Alliance Bernstein	100,000,000	119,310,221	-0.18%	4.05%	19.31%	13.79%	5.52%	2
小計	200,000,000	243,108,112	-0.09%	5.68%	21.55%	13.79%	7.76%	
<b>全球股票型委託</b>								
Wellington	150,000,000	204,754,401	2.26%	18.88%	36.50%	27.17%	9.33%	1
合計	350,000,000	447,862,513	0.97%	11.34%	27.96%			

(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	本月報酬率	帳戶當年度 截至當月報酬率	帳戶 累積投資績效	績效指標 累計報酬	超越 指標幅度	超越指標 幅度排名
Wellington (II)	79,276,014	110,804,908	2.29%	18.88%	39.77%	33.12%	6.65%	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	本月報酬率	帳戶當年度 截至當月報酬率	帳戶 累積投資績效	績效指標 累計報酬	超越 指標幅度	超越指標 幅度排名
Alliance Bernstein (II)	100,000,000	110,866,543	-0.18%	3.98%	10.87%	9.07%	1.80%	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. 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

## 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	854,801,926
累積總損益	4,696,479
委託經營總報酬率	0.55%

委託經理人	委託投資金額	目前資產淨值	本月報酬率	帳戶當年度 截至當月報酬率	帳戶 累積投資績效	績效指標 累計報酬	超越 指標幅度	超越指標 幅度排名
<b>全球新興市場股票型委託</b>								
Vontobel	309,910,147	319,105,885	3.44%	2.97%	2.97%	0.52%	2.45%	1
<b>被動式全球債券型委託</b>								
SSgA	273,853,877	271,547,954	-0.19%	-0.84%	-0.84%	-0.84%	0.00%	2
Vanguard	266,341,424	264,148,087	-0.18%	-0.82%	-0.82%	-0.84%	0.02%	1
小計	540,195,301	535,696,041	-0.19%	-0.83%	-0.83%	-0.84%	0.01%	
合計	850,105,447	854,801,926	1.14%	0.55%	0.55%			

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。

## 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	723,867,409	215,960,799
累積總損益	123,867,409	15,960,799
委託經營總報酬率	20.64%	7.98%

# 勞保基金 國外委託經營投資績效、績效指標及排名表

101年11月30日

(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	本月報酬率	帳戶當年度 截至當月報酬率	帳戶 累積投資績效	績效指標 累計報酬	超越 指標幅度	超越指標 幅度排名
<b>全球債券型委託</b>								
Standish Mellon	200,000,000	236,653,947	0.35%	7.84%	18.33%	16.22%	2.11%	3
Wellington	200,000,000	237,189,534	-0.05%	5.09%	18.59%	16.22%	2.37%	2
PIMCO	200,000,000	250,023,927	0.29%	9.16%	25.01%	16.22%	8.79%	1
<b>合計</b>	<b>600,000,000</b>	<b>723,867,409</b>	<b>0.20%</b>	<b>7.36%</b>	<b>20.64%</b>	<b>16.22%</b>	<b>4.42%</b>	

(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	本月報酬率	帳戶當年度 截至當月報酬率	帳戶 累積投資績效	績效指標 累計報酬	超越 指標幅度	超越指標 幅度排名
<b>全球債券型委託</b>								
PIMCO	200,000,000	215,960,799	0.34%	7.98%	7.98%	4.66%	3.32%	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。

## 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	686,424,229
累積總損益	86,424,229
委託經營總報酬率	14.40%

委託經理人	委託投資金額	目前資產淨值	本月報酬率	帳戶當年度 截至當月報酬率	帳戶 累積投資績效	績效指標 累計報酬	超越 指標幅度	超越指標 幅度排名
<b>全球股票型委託</b>								
MFS	200,000,000	243,845,735	3.76%	22.58%	21.92%	10.85%	11.07%	1
BlackRock	200,000,000	227,184,573	1.31%	14.58%	13.59%	13.62%	-0.03%	2
Amundi	200,000,000	215,393,921	1.15%	7.70%	7.70%	13.35%	-5.65%	3
<b>合計</b>	<b>600,000,000</b>	<b>686,424,229</b>	<b>2.12%</b>	<b>14.94%</b>	<b>14.40%</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。

## 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	450,000,000
委託經營月底資產淨值	448,897,628
累積總損益	-1,102,372
委託經營總報酬率	-0.24%

委託經理人	委託投資金額	目前資產淨值	本月報酬率	帳戶當年度 截至當月報酬率	帳戶 累積投資績效	績效指標 累計報酬	超越 指標幅度	超越指標 幅度排名
<b>全球新興市場債券型委託</b>								
Stone Harbor	150,000,000	149,037,762.83	0.30%	-0.64%	-0.64%	0.48%	-1.12%	2
BlueBay	150,000,000	150,632,235.33	0.42%	0.42%	0.42%	0.69%	-0.27%	1
Templeton	150,000,000	149,227,630.32	-0.51%	-0.51%	-0.51%	0.69%	-1.20%	3
<b>合計</b>	<b>450,000,000</b>	<b>448,897,628</b>	<b>0.07%</b>	<b>-0.24%</b>	<b>-0.24%</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。