

勞保基金 國外委託經營績效統計表

102年7月31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	481,586,518	135,551,163	105,570,092
累積總損益	131,586,518	56,275,149	5,570,092
委託經營總報酬率	37.60%	70.99%	5.57%

(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 累計報酬率	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	117,451,057	-4.62%	17.45%	8.20%	9.25%	1
Alliance Bernstein	100,000,000	113,572,292	-4.23%	13.57%	8.20%	5.38%	2
小計	200,000,000	231,023,349	-4.43%	15.51%	8.20%	7.31%	
全球股票型委託							
Wellington	150,000,000	250,563,169	19.93%	67.04%	47.88%	19.17%	1
合計	350,000,000	481,586,518	6.86%	37.60%			

(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 累計報酬率	超越指標幅度	超越指標幅度 排名
Wellington (II)	79,276,014	135,551,163	19.86%	70.99%	54.79%	16.19%	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 累計報酬率	超越指標幅度	超越指標幅度 排名
Alliance Bernstein (II)	100,000,000	105,570,092	-4.22%	5.57%	3.70%	1.87%	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。

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	692,251,644	206,237,896
累積總損益	92,251,644	6,237,896
委託經營總報酬率	15.38%	3.12%

(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	227,961,638	-3.81%	13.98%	11.63%	2.35%	2
Wellington	200,000,000	225,812,123	-4.62%	12.91%	11.63%	1.28%	3
PIMCO	200,000,000	238,477,884	-4.40%	19.24%	11.63%	7.61%	1
合計	600,000,000	692,251,644	-4.28%	15.38%	11.63%	3.74%	

(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	206,237,896	-4.34%	3.12%	0.53%	2.59%	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	796,699,639
累積總損益	196,699,639
委託經營總報酬率	32.78%

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
全球股票型委託							
MFS	200,000,000	292,113,082	17.57%	46.06%	28.90%	17.16%	1
BlackRock	200,000,000	262,637,193	13.63%	31.32%	32.13%	-0.81%	2
Amundi	200,000,000	241,949,364	10.41%	20.97%	31.81%	-10.84%	3
合計	600,000,000	796,699,639	14.02%	32.78%			

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	427,979,693
累積總損益	-22,020,307
委託經營總報酬率	-4.89%

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
全球新興市場債券型委託							
Stone Harbor	150,000,000	140,445,498	-8.14%	-6.37%	-3.57%	-2.80%	3
BlueBay	150,000,000	145,014,649	-6.42%	-3.32%	-3.37%	0.05%	1
Templeton	150,000,000	142,519,545	-6.60%	-4.99%	-3.37%	-1.62%	2
合計	450,000,000	427,979,693	-7.05%	-4.89%			

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。

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	811,538,144
累積總損益	-38,567,303
委託經營總報酬率	-4.54%

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
全球新興市場股票型委託							
Vontobel	309,910,147	306,772,802	-5.58%	-1.01%	-4.50%	3.49%	1
被動式全球債券型委託							
SSgA	273,853,877	255,818,839	-4.88%	-6.59%	-6.41%	-0.18%	2
Vanguard	266,341,424	248,946,504	-4.84%	-6.53%	-6.41%	-0.12%	1
小計	540,195,301	504,765,342	-4.86%	-6.56%	-6.41%	-0.15%	
合計	850,105,447	811,538,144	-5.13%	-4.54%			

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。