

勞工保險基金
國外委託經營績效統計表
101年8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)	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	434,424,159	104,891,795	110,388,698
累積總損益	84,424,159	25,615,781	10,388,698
委託經營總報酬率	24.12%	32.31%	10.39%

(一) 第一梯次續約：自98年11月1日至101年8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
全球債券型委託					
PIMCO	100,000,000	121,862,013	21,862,013	21.86%	5.63%
Alliance Bernstein	100,000,000	118,690,108	18,690,108	18.69%	3.51%
小計	200,000,000	240,552,121	40,552,121	20.28%	4.57%
全球股票型委託					
Wellington	150,000,000	193,872,037	43,872,037	29.25%	12.56%
合計	350,000,000	434,424,159	84,424,159	24.12%	7.99%

(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8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
全球股票型委託					
Wellington (II)	79,276,014	104,891,795	25,615,781	32.31%	12.53%

(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8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
全球債券型委託					
Alliance Bernstein (II)	100,000,000	110,388,698	10,388,698	10.39%	3.53%

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(98/11/1-101/8/31)市場報酬率為23.04%，今年以來市場報酬率為9.99%；全球債券型委託市場指標為Barclays Capital Global Aggregate A- or better Bond Index，同期間(98/11/1-101/8/31)市場報酬率為13.59%，今年以來市場報酬率為3.00%。
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(99/7/1-101/8/31)市場報酬率為28.79%，今年以來市場報酬率為9.99%；全球債券型委託市場指標為Barclays Capital Global Aggregate A- or better Bond Index，同期間(100/2/1-101/8/31)市場報酬率為8.87%，今年以來市場報酬率為3.00%。

第二梯次績效統計表

單位：美元、%

	第二梯次 (自96年10月1日起)	第二梯次 加碼 (自100年1月1日起)
委託經營金額	700,000,000	93,287,948
委託經營月底資產淨值	855,477,527	101,381,666
累積總損益	155,477,527	8,093,718
委託經營總報酬率	22.21%	8.68%

(一) 第二梯次：自96年10月1日至101年8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
美國股票型委託					
Janus	150,000,000	122,435,466	-27,564,534	-18.38%	8.84%
全球新興市場股票型委託					
Vontobel	150,000,000	199,433,400	49,433,400	32.96%	11.70%
小計	300,000,000	321,868,866	21,868,866	7.29%	10.59%
被動式全球債券型委託					
SSgA	200,000,000	270,562,309	70,562,309	35.28%	2.21%
Vanguard	200,000,000	263,046,352	63,046,352	31.52%	2.18%
小計	400,000,000	533,608,661	133,608,661	33.40%	2.19%
合計	700,000,000	855,477,527	155,477,527	22.21%	5.20%

(二) 第二梯次加碼【全球新興市場股票型】：自100年1月1日至101年8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
全球新興市場股票型委託					
Vontobel	93,287,948	101,381,666	8,093,718	8.68%	11.73%

附註

- 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。
- 本基金第二梯次委託撥款日期為96年10月1日，惟Vanguard撥款日為96年11月1日。
- 美國股票型委託市場指標為FTSE AW US，同期間(2007/10/1-101/8/31)市場報酬率為0.48%，今年以來市場報酬率為13.17%。
- 全球新興市場股票型委託市場指標為FTSE AW Emerging Markets ex PRC ex Taiwan，同期間(96/10/1-101/8/31)市場報酬率為-5.22%，今年以來市場報酬率為5.76%。
- 被動式全球債券型委託市場指標為Barclays Capital Global Treasury Index，同期間市場報酬率為35.27%(96/10/1-101/8/31)與33.09%(96/11/1-101/8/31)，今年以來市場報酬率為2.36%。
- 日本股票型及歐洲股票型委託已分別於99年6月30日及9月30日終止契約。
- 第二梯次Vontobel加碼帳戶始於100年1月1日。指標同為FTSE AW Emerging Markets ex PRC ex Taiwan，委託以來同期間(100/1/1-101/8/31)市場報酬率為-14.55%，今年以來市場報酬率為5.76%。

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	710,950,692	209,952,028
累積總損益	110,950,692	9,952,028
委託經營總報酬率	18.49%	4.98%

(一) 第三梯次：自99年2月1日至101年8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
全球債券型委託					
Standish Mellon	200,000,000	232,032,442	32,032,442	16.02%	5.73%
Wellington	200,000,000	234,898,147	34,898,147	17.45%	4.07%
PIMCO	200,000,000	244,020,103	44,020,103	22.01%	6.54%
合計	600,000,000	710,950,692	110,950,692	18.49%	5.45%

(二) 第三梯次加碼：自101年1月1日至101年8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
全球債券型委託					
PIMCO	200,000,000	209,952,028	9,952,028	4.98%	4.98%

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(99/2/01-101/8/31)市場報酬率為14.99%，今年以來市場報酬率為3.56%。

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(101/1/1-101/8/31)市場報酬率為3.56%，今年以來市場報酬率為3.56%。

第四梯次績效統計表

單位：美元、%

	第四梯次國外委託經營 (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	659,946,187
累積總損益	59,946,187
委託經營總報酬率	9.99%

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
全球股票型委託					
MFS	200,000,000	228,732,991	28,732,991	14.37%	14.99%
BlackRock	200,000,000	219,860,658	19,860,658	9.93%	10.89%
Amundi	200,000,000	211,352,538	11,352,538	5.68%	5.68%
合計	600,000,000	659,946,187	59,946,187	9.99%	10.51%

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(100/11/1-101/8/31)市場報酬率為7.25%，BlackRock帳戶委託期間(100/12/1-101/8/31)市場報酬率為9.93%，AMUNDI帳戶委託期間(101/1/3-101/8/31)市場報酬率為9.67%；今年以來市場報酬率為9.99%。