

勞工保險基金
國外委託經營績效統計表
101年5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	414,089,957	98,013,494	107,709,213
累積總損益	64,089,957	18,737,480	7,709,213
委託經營總報酬率	18.31%	23.64%	7.71%

(一) 第一梯次續約：自98年11月1日至101年5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	117,177,969	17,177,969	17.18%	1.57%
Alliance Bernstein	100,000,000	115,752,351	15,752,351	15.75%	0.95%
小計	200,000,000	232,930,319	32,930,319	16.47%	1.26%
全球股票型委託					
Wellington	150,000,000	181,159,638	31,159,638	20.77%	5.18%
合計	350,000,000	414,089,957	64,089,957	18.31%	2.94%

(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5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	98,013,494	18,737,480	23.64%	5.15%

(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5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	107,709,213	7,709,213	7.71%	1.02%

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。
- 續約帳戶中，全球股票型委託市場指標為MSCI World Index，同期間(98/11/1-101/5/31)市場報酬率為12.73%，今年以來市場報酬率為0.78%；全球債券型委託市場指標為Barclays Capital Global Aggregate A- or better Bond Index，同期間(98/11/1-101/5/31)市場報酬率為11.18%，今年以來市場報酬率為0.83%。
- 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(99/7/1-101/5/31)市場報酬率為18.00%，今年以來市場報酬率為0.78%；全球債券型委託市場指標為Barclays Capital Global Aggregate A- or better Bond Index，同期間(100/2/1-101/5/31)市場報酬率為6.56%，今年以來(自委託日起算)市場報酬率為0.83%。

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	827,614,280	94,481,198
累積總損益	127,614,280	1,193,250
委託經營總報酬率	18.23%	1.28%

(一) 第二梯次：自96年10月1日至101年5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	117,913,634	-32,086,366	-21.39%	4.82%
全球新興市場股票型委託					
Vontobel	150,000,000	185,952,679	35,952,679	23.97%	4.15%
小計	300,000,000	303,866,313	3,866,313	1.29%	4.41%
被動式全球債券型委託					
SSgA	200,000,000	265,550,834	65,550,834	32.78%	0.32%
Vanguard	200,000,000	258,197,133	58,197,133	29.10%	0.29%
小計	400,000,000	523,747,967	123,747,967	30.94%	0.31%
合計	700,000,000	827,614,280	127,614,280	18.23%	1.77%

(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5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	94,481,198	1,193,250	1.28%	4.12%

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。
3. 美國股票型委託市場指標為FTSE AW US，同期間(2007/10/1-101/5/31)市場報酬率為-6.66%，今年以來市場報酬率為5.13%。
4. 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(96/10/1-101/5/31)市場報酬率為-11.85%，今年以來市場報酬率為-1.65%。
5. 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32.70%(96/10/1-101/5/31)與30.56%(96/11/1-101/5/31)，今年以來市場報酬率為0.42%。
6. 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。
7. 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(100/1/1-101/5/31)市場報酬率為-20.53%，今年以來市場報酬率為-1.65%。

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	686,775,608	200,572,272
累積總損益	86,775,608	572,272
委託經營總報酬率	14.46%	0.29%

(一) 第三梯次：自99年2月1日至101年5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	224,458,608	24,458,608	12.23%	2.28%
Wellington	200,000,000	228,553,319	28,553,319	14.28%	1.26%
PIMCO	200,000,000	233,763,681	33,763,681	16.88%	2.06%
合計	600,000,000	686,775,608	86,775,608	14.46%	1.86%

(二) 第三梯次加碼：自101年1月1日至101年5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	200,572,272	572,272	0.29%	0.29%

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(99/2/01-101/5/31)市場報酬率為12.17%，今年以來市場報酬率為1.02%。
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(101/1/1-101/5/31)市場報酬率為1.02%，今年以來市場報酬率為1.02%。

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	613,919,394
累積總損益	13,919,394
委託經營總報酬率	2.32%

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	208,973,160	8,973,160	4.49%	5.05%
BlackRock	200,000,000	205,122,230	5,122,230	2.56%	3.46%
Amundi	200,000,000	199,824,005	-175,995	-0.09%	-0.09%
合計	600,000,000	613,919,394	13,919,394	2.32%	2.80%

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(100/11/1-101/5/31)市場報酬率為-1.74%，BlackRock帳戶委託期間(100/12/1-101/5/31)市場報酬率為0.72%，AMUNDI帳戶委託期間(101/1/3-101/5/31)市場報酬率為0.48%；今年以來市場報酬率為0.78%。