

**勞工保險基金**  
**國外委託經營績效統計表**  
**101年7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	427,367,333	102,280,970	109,727,710
累積總損益	77,367,333	23,004,956	9,727,710
委託經營總報酬率	22.10%	29.02%	9.73%

**(一) 第一梯次續約：自98年11月1日至101年7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	120,384,222	20,384,222	20.38%	4.35%
Alliance Bernstein	100,000,000	117,960,035	17,960,035	17.96%	2.87%
小計	200,000,000	238,344,257	38,344,257	19.17%	3.61%
<b>全球股票型委託</b>					
Wellington	150,000,000	189,023,077	39,023,077	26.02%	9.75%
合計	350,000,000	427,367,333	77,367,333	22.10%	6.24%

**(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7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	102,280,970	23,004,956	29.02%	9.73%

**(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7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	109,727,710	9,727,710	9.73%	2.91%

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(98/11/1-101/7/31)市場報酬率為19.99%，今年以來市場報酬率為7.27%；全球債券型委託市場指標為Barclays Capital Global Aggregate A- or better Bond Index，同期間(98/11/1-101/7/31)市場報酬率為12.90%，今年以來市場報酬率為2.39%。
- 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(99/7/1-101/7/31)市場報酬率為25.61%，今年以來市場報酬率為7.27%；全球債券型委託市場指標為Barclays Capital Global Aggregate A- or better Bond Index，同期間(100/2/1-101/7/31)市場報酬率為8.21%，今年以來(自委託日起算)市場報酬率為2.39%。

## 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	848,290,186	101,393,224
累積總損益	148,290,186	8,105,276
委託經營總報酬率	21.18%	8.69%

(一) 第二梯次：自96年10月1日至101年7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>美國股票型委託</b>					
Janus	150,000,000	118,570,345	-31,429,655	-20.95%	5.40%
<b>全球新興市場股票型委託</b>					
Vontobel	150,000,000	199,711,182	49,711,182	33.14%	11.85%
<b>小計</b>	<b>300,000,000</b>	<b>318,281,527</b>	<b>18,281,527</b>	<b>6.09%</b>	<b>9.36%</b>
<b>被動式全球債券型委託</b>					
SSgA	200,000,000	268,722,191	68,722,191	34.36%	1.52%
Vanguard	200,000,000	261,286,468	61,286,468	30.64%	1.49%
<b>小計</b>	<b>400,000,000</b>	<b>530,008,659</b>	<b>130,008,659</b>	<b>32.50%</b>	<b>1.50%</b>
<b>合計</b>	<b>700,000,000</b>	<b>848,290,186</b>	<b>148,290,186</b>	<b>21.18%</b>	<b>4.32%</b>

(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7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>全球新興市場股票型委託</b>					
Vontobel	93,287,948	101,393,224	8,105,276	8.69%	11.74%

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(2007/10/1-101/7/31)市場報酬率為-1.66%，今年以來市場報酬率為10.76%。
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(96/10/1-101/7/31)市場報酬率為-5.38%，今年以來市場報酬率為5.58%。
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34.33%(96/10/1-101/7/31)與32.16%(96/11/1-101/7/31)，今年以來市場報酬率為1.65%。
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(100/1/1-101/7/31)市場報酬率為-14.69%，今年以來市場報酬率為5.58%。

### 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	704,347,454	206,946,897
累積總損益	104,347,454	6,946,897
委託經營總報酬率	17.39%	3.47%

(一) 第三梯次：自99年2月1日至101年7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	230,300,775	30,300,775	15.15%	4.94%
Wellington	200,000,000	232,925,210	32,925,210	16.46%	3.20%
PIMCO	200,000,000	241,121,469	41,121,469	20.56%	5.27%
<b>合計</b>	<b>600,000,000</b>	<b>704,347,454</b>	<b>104,347,454</b>	<b>17.39%</b>	<b>4.47%</b>

(二) 第三梯次加碼：自101年1月1日至101年7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	206,946,897	6,946,897	3.47%	3.47%

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(99/2/01-101/7/31)市場報酬率為14.01%，今年以來市場報酬率為2.67%。
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(101/1/1-101/7/31)市場報酬率為2.67%，今年以來市場報酬率為2.67%。

#### 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	642,790,976
累積總損益	42,790,976
委託經營總報酬率	7.13%

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	221,874,540	21,874,540	10.94%	11.54%
BlackRock	200,000,000	215,132,808	15,132,808	7.57%	8.50%
Amundi	200,000,000	205,783,629	5,783,629	2.89%	2.89%
<b>合計</b>	<b>600,000,000</b>	<b>642,790,976</b>	<b>42,790,976</b>	<b>7.13%</b>	<b>7.64%</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(100/11/1-101/7/31)市場報酬率為4.60%，BlackRock帳戶委託期間(100/12/1-101/7/31)市場報酬率為7.21%，AMUNDI帳戶委託期間(101/1/3-101/7/31)市場報酬率為6.96%；今年以來市場報酬率為7.27%。