

勞工保險基金
國外委託經營績效統計表
101年1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	417,226,476	98,737,893	108,387,270
累積總損益	67,226,476	19,461,879	8,387,270
委託經營總報酬率	19.21%	24.55%	8.39%

(一) 第一梯次續約：自98年11月1日至101年1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	118,231,185	18,231,185	18.23%	2.49%
Alliance Bernstein	100,000,000	116,539,210	16,539,210	16.54%	1.63%
小計	200,000,000	234,770,395	34,770,395	17.39%	2.06%
全球股票型委託					
Wellington	150,000,000	182,456,081	32,456,081	21.64%	5.94%
合計	350,000,000	417,226,476	67,226,476	19.21%	3.72%

(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1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	98,737,893	19,461,879	24.55%	5.93%

(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1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	108,387,270	8,387,270	8.39%	1.66%

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(99/7/1-101/1/31)市場報酬率為17.47%，今年以來市場報酬率為5.02%；全球債券型委託市場指標為Barclays Capital Global Aggregate A- or better Bond Index，同期間(98/11/1-101/1/31)市場報酬率為11.98%，今年以來市場報酬率為1.55%。
- 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(98/11/1-101/1/31)市場報酬率為22.97%，今年以來市場報酬率為5.02%；全球債券型委託市場指標為Barclays Capital Global Aggregate A- or better Bond Index，同期間(100/2/1-101/1/31)市場報酬率為7.33%，今年以來(自委託日起算)市場報酬率為1.55%。

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	840,415,257	96,903,774
累積總損益	140,415,257	3,615,825
委託經營總報酬率	20.06%	3.88%

(一) 第二梯次：自96年10月1日至101年1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	119,607,428	-30,392,572	-20.26%	6.32%
全球新興市場股票型委託					
Vontobel	150,000,000	190,669,885	40,669,885	27.11%	6.79%
小計	300,000,000	310,277,313	10,277,313	3.43%	6.61%
被動式全球債券型委託					
SSgA	200,000,000	268,748,727	68,748,727	34.37%	1.53%
Vanguard	200,000,000	261,389,217	61,389,217	30.69%	1.53%
小計	400,000,000	530,137,944	130,137,944	32.53%	1.53%
合計	700,000,000	840,415,257	140,415,257	20.06%	3.35%

(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1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	96,903,774	3,615,825	3.88%	6.79%

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撥款日期為96年11月1日。
- 美國股票型委託市場指標為FTSE AW US，同期間(96/10/1-101/1/31)市場報酬率為-7.04%，今年以來市場報酬率為4.70%。
- 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(96/10/1-101/1/31)市場報酬率為0.66%，今年以來市場報酬率為12.31%。
- 被動式全球債券型委託市場指標為Barclays Capital Global Treasury Index，同期間(96/10/1-101/1/31)市場報酬率為34.24%，(96/11/1-101/1/31)市場報酬率為32.08%，今年以來市場報酬率為1.59%。
- 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(100/1/1-101/1/31)市場報酬率為-9.25%，今年以來市場報酬率為12.31%。

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	688,241,427	203,498,696
累積總損益	88,241,427	3,498,696
委託經營總報酬率	14.71%	1.75%

(一) 第三梯次：自99年2月1日至101年1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	223,787,605	23,787,605	11.89%	1.97%
Wellington	200,000,000	229,196,185	29,196,185	14.60%	1.54%
PIMCO	200,000,000	235,257,636	35,257,636	17.63%	2.71%
合計	600,000,000	688,241,427	88,241,427	14.71%	2.08%

(二) 第三梯次加碼：自101年1月1日至101年1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	203,498,696	3,498,696	1.75%	1.75%

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。
- 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(99/2/1-101/1/31)市場報酬率為12.90%，今年以來市場報酬率為1.67%。
- 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(101/1/1-101/1/31)市場報酬率為1.67%，今年以來市場報酬率為1.67%。

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	628,766,791
累積總損益	28,766,791
委託經營總報酬率	4.79%

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	208,817,380	8,817,380	4.41%	4.98%
BlackRock	200,000,000	212,386,109	12,386,109	6.19%	7.12%
Amundi	200,000,000	207,563,302	7,563,302	3.78%	3.78%
合計	600,000,000	628,766,791	28,766,791	4.79%	5.29%

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。
- 全球股票型委託市場指標為MSCI World Index，MFS帳戶委託期間(100/11/1-101/1/31)市場報酬率為2.40%，BlackRock帳戶委託期間(100/12/1-101/1/31)市場報酬率為4.96%，AMUNDI帳戶委託期間(101/1/3-101/1/31)市場報酬率為4.71%；今年以來市場報酬率為5.02%。