

# 勞工保險基金 國外委託經營績效統計表

## 102年3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	463,169,825	122,548,918	107,765,655
累積總損益	113,169,825	43,272,903	7,765,655
委託經營總報酬率	32.33%	54.59%	7.77%

(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	超越指標幅度	超越指標幅度 排名
<b>全球債券型委託</b>							
PIMCO	100,000,000	120,755,627	-1.94%	20.76%	10.49%	10.27%	1
Alliance Bernstein	100,000,000	115,941,698	-2.23%	15.94%	10.49%	5.45%	2
小計	200,000,000	236,697,325	-2.09%	18.35%	10.49%	7.86%	
<b>全球股票型委託</b>							
Wellington	150,000,000	226,472,501	8.40%	50.98%	39.58%	11.40%	1
合計	350,000,000	463,169,825	2.78%	32.33%			

(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	超越指標幅度	超越指標幅度 排名
Wellington (II)	79,276,014	122,548,918	8.37%	54.59%	46.11%	8.48%	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	超越指標幅度	超越指標幅度 排名
Alliance Bernstein (II)	100,000,000	107,765,655	-2.23%	7.77%	5.90%	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。

**勞工保險基金 國外委託經營績效統計表**  
**102年3月31日**  
**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	708,717,426	212,088,940
累積總損益	108,717,426	12,088,940
委託經營總報酬率	18.12%	6.04%

(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
<b>全球債券型委託</b>							
Standish Mellon	200,000,000	232,775,560	-1.77%	16.39%	13.41%	2.98%	2
Wellington	200,000,000	230,585,504	-2.60%	15.29%	13.41%	1.88%	3
PIMCO	200,000,000	245,356,362	-1.64%	22.68%	13.41%	9.27%	1
<b>合計</b>	<b>600,000,000</b>	<b>708,717,426</b>	<b>-2.00%</b>	<b>18.12%</b>	<b>13.41%</b>	<b>4.71%</b>	

(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
<b>全球債券型委託</b>							
PIMCO	200,000,000	212,088,940	-1.63%	6.04%	2.13%	3.91%	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。

# 勞工保險基金 國外委託經營績效統計表

102年3月31日

第四梯次績效統計表

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	759,019,871
累積總損益	159,019,871
委託經營總報酬率	26.50%

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	超越指標幅度	超越指標幅度 排名
<b>全球股票型委託</b>							
MFS	200,000,000	273,095,273	9.92%	36.55%	21.67%	14.88%	1
BlackRock	200,000,000	251,458,534	8.79%	25.73%	24.71%	1.02%	2
Amundi	200,000,000	234,466,065	6.99%	17.23%	24.42%	-7.18%	3
<b>合計</b>	<b>600,000,000</b>	<b>759,019,871</b>	<b>8.63%</b>	<b>26.50%</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。

**勞工保險基金 國外委託經營績效統計表**  
**102年3月31日**

**101年度績效統計表**

單位：美元

	101年度 (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	459,500,161
累積總損益	9,500,161
委託經營總報酬率	2.11%

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	超越指標幅度	超越指標幅度 排名
<b>全球新興市場債券型委託</b>							
Stone Harbor	150,000,000	152,478,645	-0.27%	1.65%	3.56%	-1.91%	2
BlueBay	150,000,000	155,289,914	0.21%	3.53%	3.77%	-0.24%	1
Templeton	150,000,000	151,731,601	-0.56%	1.15%	3.77%	-2.62%	3
<b>合計</b>	<b>450,000,000</b>	<b>459,500,161</b>	<b>-0.21%</b>	<b>2.11%</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。

**勞工保險基金 國外委託經營績效統計表**  
**102年3月31日**

**101年度續約績效統計表**

單位：美元

	101年度續約 (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	845,732,358
累積總損益	-4,373,089
委託經營總報酬率	-0.51%

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	超越指標幅度	超越指標幅度 排名
<b>全球新興市場股票型委託</b>							
Vontobel	309,910,147	331,026,375	1.89%	6.81%	4.46%	2.35%	1
<b>被動式全球債券型委託</b>							
SSgA	273,853,877	260,914,291	-2.99%	-4.72%	-4.66%	-0.06%	2
Vanguard	266,341,424	253,791,692	-2.99%	-4.71%	-4.66%	-0.05%	1
小計	<b>540,195,301</b>	<b>514,705,983</b>	<b>-2.99%</b>	<b>-4.72%</b>	<b>-4.66%</b>	<b>-0.06%</b>	
合計	<b>850,105,447</b>	<b>845,732,358</b>	<b>-1.14%</b>	<b>-0.51%</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. 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。