

# 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)<br>(自98年11月1日起) | 第一梯次<br>(續約)加碼<br>(自99年7月1日起) | 第一梯次<br>(續約)加碼<br>(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<br>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<br>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<br>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<br>(自99年2月1日起) | 第三梯次 加碼<br>(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<br>帳戶報酬率 | 帳戶<br>累積報酬率   | 指標<br>累計報酬率   | 超越指標幅度       | 超越指標幅度<br>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<br>帳戶報酬率 | 帳戶<br>累積報酬率 | 指標<br>累計報酬率 | 超越指標幅度 | 超越指標幅度<br>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<br>(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<br>帳戶報酬率 | 帳戶累積報酬<br>率   | 指標累計報酬 | 超越指標幅度 | 超越指標幅度<br>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<br>(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<br>帳戶報酬率 | 帳戶累積報酬<br>率  | 指標累計報酬 | 超越指標幅度 | 超越指標幅度<br>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<br>(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<br>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                 | 540,195,301 | 514,705,983 | -2.99%    | -4.72%  | -4.66% | -0.06% |              |
| 合計                 | 850,105,447 | 845,732,358 | -1.14%    | -0.51%  |        |        |              |

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. 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。