

勞保基金 國外委託經營績效統計表
102年10月31日

第一梯次(續約)國外委託經營績效統計表

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	503,201,349	145,154,256	107,625,602
累積總損益	153,201,349	65,878,242	7,625,602
委託經營總報酬率	43.77%	83.10%	7.63%

(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 累計報酬率	超越指標幅度	超越指標幅度 排名
全球債券型委託							
PIMCO	100,000,000	119,169,220	-3.23%	19.17%	10.60%	8.57%	1
Alliance Bernstein	100,000,000	115,772,538	-2.38%	15.77%	10.60%	5.17%	2
小計	200,000,000	234,941,758	-2.81%	17.47%	10.60%	6.87%	
全球股票型委託							
Wellington	150,000,000	268,259,591	28.40%	78.84%	57.92%	20.92%	1
合計	350,000,000	503,201,349	11.66%	43.77%			

(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 累計報酬率	超越指標幅度	超越指標幅度 排名
Wellington (II)	79,276,014	145,154,256	28.36%	83.10%	65.30%	17.80%	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 累計報酬率	超越指標幅度	超越指標幅度 排名
Alliance Bernstein (II)	100,000,000	107,625,602	-2.36%	7.63%	6.00%	1.63%	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。

勞保基金 國外委託經營績效統計表
102年10月31日

第三梯次國外委託經營績效統計表

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	706,811,786	210,774,972
累積總損益	106,811,786	10,774,972
委託經營總報酬率	17.80%	5.39%

(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
全球債券型委託							
Standish Mellon	200,000,000	232,839,238	-1.75%	16.42%	14.44%	1.98%	2
Wellington	200,000,000	230,387,304	-2.69%	15.19%	14.44%	0.75%	3
PIMCO	200,000,000	243,585,244	-2.35%	21.79%	14.44%	7.35%	1
合計	600,000,000	706,811,786	-2.26%	17.80%	14.44%	3.36%	

(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
全球債券型委託							
PIMCO	200,000,000	210,774,972	-2.24%	5.39%	3.06%	2.33%	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。

勞保基金 國外委託經營績效統計表
102年10月31日

第四梯次國外委託經營績效統計表

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	846,388,913
累積總損益	246,388,913
委託經營總報酬率	41.06%

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
全球股票型委託							
MFS	200,000,000	308,185,976	24.04%	54.09%	37.65%	16.44%	1
BlackRock	200,000,000	279,994,058	21.14%	40.00%	41.10%	-1.10%	2
Amundi	200,000,000	258,208,879	17.83%	29.10%	40.76%	-11.66%	3
合計	600,000,000	846,388,913	21.13%	41.06%			

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。

勞保基金 國外委託經營績效統計表
102年10月31日

101年度國外委託經營績效統計表

單位：美元

	101年度國外委託 (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	436,993,736
累積總損益	-13,006,264
委託經營總報酬率	-2.89%

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
全球新興市場債券型委託							
Stone Harbor	150,000,000	144,067,997	-5.77%	-3.95%	-0.66%	-3.29%	2
BlueBay	150,000,000	148,559,201	-4.13%	-0.96%	-0.45%	-0.51%	1
Templeton	150,000,000	144,366,539	-5.39%	-3.76%	-0.45%	-3.31%	3
合計	450,000,000	436,993,736	-5.09%	-2.89%			

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。

勞保基金 國外委託經營績效統計表
102年10月31日

101年度續約國外委託經營績效統計表

單位：美元

	101年度續約國外委託 (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	831,151,699
累積總損益	-18,953,748
委託經營總報酬率	-2.23%

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
全球新興市場股票型委託							
Vontobel	309,910,147	313,263,247	-3.58%	1.08%	4.47%	-3.39%	1
被動式全球債券型委託							
SSgA	273,853,877	262,474,354	-2.41%	-4.16%	-3.95%	-0.21%	2
Vanguard	266,341,424	255,414,097	-2.37%	-4.10%	-3.95%	-0.15%	1
小計	540,195,301	517,888,452	-2.39%	-4.13%	-3.95%	-0.18%	
合計	850,105,447	831,151,699	-2.84%	-2.23%			

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。