

## 勞保基金 國外委託經營績效統計表

### 102年8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	474,739,978	132,612,663	104,947,168
累積總損益	124,739,978	53,336,649	4,947,168
委託經營總報酬率	35.64%	67.28%	4.95%

(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
<b>全球債券型委託</b>							
PIMCO	100,000,000	116,673,866	-5.26%	16.67%	7.66%	9.01%	1
Alliance Bernstein	100,000,000	112,922,993	-4.78%	12.92%	7.66%	5.26%	2
小計	200,000,000	229,596,859	-5.02%	14.80%	7.66%	7.14%	
<b>全球股票型委託</b>							
Wellington	150,000,000	245,143,118	17.34%	63.43%	44.73%	18.70%	1
合計	350,000,000	474,739,978	5.34%	35.64%			

(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	132,612,663	17.27%	67.28%	51.50%	15.78%	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	104,947,168	-4.79%	4.95%	3.19%	1.76%	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。

### 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	688,167,721	205,026,532
累積總損益	88,167,721	5,026,532
委託經營總報酬率	14.69%	2.51%

#### (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	226,504,889	-4.42%	13.25%	11.05%	2.20%	2
Wellington	200,000,000	224,589,215	-5.14%	12.29%	11.05%	1.24%	3
PIMCO	200,000,000	237,073,617	-4.96%	18.54%	11.05%	7.49%	1
<b>合計</b>	<b>600,000,000</b>	<b>688,167,721</b>	<b>-4.84%</b>	<b>14.69%</b>	<b>11.05%</b>	<b>3.64%</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	205,026,532	-4.90%	2.51%	0.00%	2.51%	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。

### 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	775,367,468
累積總損益	175,367,468
委託經營總報酬率	29.23%

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
<b>全球股票型委託</b>							
MFS	200,000,000	282,948,743	13.89%	41.47%	26.16%	15.31%	1
BlackRock	200,000,000	256,808,509	11.10%	28.40%	29.31%	-0.91%	2
Amundi	200,000,000	235,610,216	7.52%	17.81%	29.01%	-11.20%	3
<b>合計</b>	<b>600,000,000</b>	<b>775,367,468</b>	<b>10.97%</b>	<b>29.23%</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。

## 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	410,509,914
累積總損益	-39,490,086
委託經營總報酬率	-8.78%

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>全球新興市場債券型委託</b>							
Stone Harbor	150,000,000	134,130,928	-12.27%	-10.58%	-7.27%	-3.31%	3
BlueBay	150,000,000	138,807,030	-10.43%	-7.46%	-7.08%	-0.38%	1
Templeton	150,000,000	137,571,956	-9.84%	-8.29%	-7.08%	-1.21%	2
<b>合計</b>	<b>450,000,000</b>	<b>410,509,914</b>	<b>-10.85%</b>	<b>-8.78%</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。

## 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	783,093,558
累積總損益	-67,011,889
委託經營總報酬率	-7.88%

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>全球新興市場股票型委託</b>							
Vontobel	309,910,147	280,177,184	-13.76%	-9.59%	-7.56%	-2.03%	1
<b>被動式全球債券型委託</b>							
SSgA	273,853,877	254,901,666	-5.23%	-6.92%	-6.77%	-0.15%	2
Vanguard	266,341,424	248,014,708	-5.19%	-6.88%	-6.77%	-0.11%	1
<b>小計</b>	<b>540,195,301</b>	<b>502,916,373</b>	<b>-5.21%</b>	<b>-6.90%</b>	<b>-6.77%</b>	<b>-0.13%</b>	
<b>合計</b>	<b>850,105,447</b>	<b>783,093,558</b>	<b>-8.46%</b>	<b>-7.88%</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。