

勞工保險基金
國外委託經營績效統計表
101年6月30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	422,141,025	101,411,023	108,388,049
累積總損益	72,141,025	22,135,009	8,388,049
委託經營總報酬率	20.61%	27.92%	8.39%

(一) 第一梯次續約：自98年11月1日至101年6月30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	118,209,767	18,209,767	18.21%	2.47%
Alliance Bernstein	100,000,000	116,511,147	16,511,147	16.51%	1.61%
小計	200,000,000	234,720,914	34,720,914	17.36%	2.04%
全球股票型委託					
Wellington	150,000,000	187,420,111	37,420,111	24.95%	8.82%
合計	350,000,000	422,141,025	72,141,025	20.61%	4.94%

(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6月30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	101,411,023	22,135,009	27.92%	8.80%

(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6月30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	108,388,049	8,388,049	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(98/11/1-101/6/30)市場報酬率為18.47%，今年以來市場報酬率為5.91%；全球債券型委託市場指標為Barclays Capital Global Aggregate A- or better Bond Index，同期間(98/11/1-101/6/30)市場報酬率為11.60%，今年以來市場報酬率為1.20%。
- 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(99/7/1-101/6/30)市場報酬率為24.01%，今年以來市場報酬率為5.91%；全球債券型委託市場指標為Barclays Capital Global Aggregate A- or better Bond Index，同期間(100/2/1-101/6/30)市場報酬率為6.96%，今年以來(自委託日起算)市場報酬率為1.20%。

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	841,283,139	99,674,958
累積總損益	141,283,139	6,387,010
委託經營總報酬率	20.18%	6.85%

(一) 第二梯次：自96年10月1日至101年6月30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	120,803,072	-29,196,928	-19.46%	7.39%
全球新興市場股票型委託					
Vontobel	150,000,000	196,254,586	46,254,586	30.84%	9.92%
小計	300,000,000	317,057,658	17,057,658	5.69%	8.94%
被動式全球債券型委託					
SSgA	200,000,000	265,787,169	65,787,169	32.89%	0.41%
Vanguard	200,000,000	258,438,312	58,438,312	29.22%	0.39%
小計	400,000,000	524,225,481	124,225,481	31.06%	0.40%
合計	700,000,000	841,283,139	141,283,139	20.18%	3.45%

(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6月30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	99,674,958	6,387,010	6.85%	9.85%

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. 本基金第二梯次委託撥款日期為96年10月1日，惟Vanguard撥款日為96年11月1日。
3. 美國股票型委託市場指標為FTSE AW US，同期間(2007/10/1-101/6/30)市場報酬率為-2.94%，今年以來市場報酬率為9.32%。
4. 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(96/10/1-101/6/30)市場報酬率為-7.16%，今年以來市場報酬率為3.59%。
5. 被動式全球債券型委託市場指標為Barclays Capital Global Treasury Index，同期間市場報酬率為32.87%(96/10/1-101/6/30)與30.72%(96/11/1-101/6/30)，今年以來市場報酬率為0.54%。
6. 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。
7. 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(100/1/1-101/6/30)市場報酬率為-16.3%，今年以來市場報酬率為3.59%。

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	692,725,086	203,075,013
累積總損益	92,725,086	3,075,013
委託經營總報酬率	15.45%	1.54%

(一) 第三梯次：自99年2月1日至101年6月30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	226,157,258	26,157,258	13.08%	3.05%
Wellington	200,000,000	230,054,886	30,054,886	15.03%	1.93%
PIMCO	200,000,000	236,512,941	36,512,941	18.26%	3.26%
合計	600,000,000	692,725,086	92,725,086	15.45%	2.75%

(二) 第三梯次加碼：自101年1月1日至101年6月30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	203,075,013	3,075,013	1.54%	1.54%

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(99/2/01-101/6/30)市場報酬率為12.71%，今年以來市場報酬率為1.50%。
3. 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(101/1/1-101/6/30)市場報酬率為1.50%，今年以來市場報酬率為1.50%。

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	635,858,205
累積總損益	35,858,205
委託經營總報酬率	5.98%

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	217,246,777	17,246,777	8.62%	9.21%
BlackRock	200,000,000	212,834,044	12,834,044	6.42%	7.35%
Amundi	200,000,000	205,777,383	5,777,383	2.89%	2.89%
合計	600,000,000	635,858,205	35,858,205	5.98%	6.47%

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。
3. 全球股票型委託市場指標為MSCI World Index，MFS帳戶委託期間(100/11/1-101/6/30)市場報酬率為3.27%，BlackRock帳戶委託期間(100/12/1-101/6/30)市場報酬率為5.85%，AMUNDI帳戶委託期間(101/1/3-101/6/30)市場報酬率為5.60%；今年以來市場報酬率為5.91%。