

勞保基金 國外委託經營績效統計表
102年12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	514,682,904	153,409,047	105,647,168
累積總損益	164,682,904	74,133,033	5,647,168
委託經營總報酬率	47.05%	93.51%	5.65%

(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	117,474,516	-4.61%	17.47%	8.58%	8.89%	1
Alliance Bernstein	100,000,000	113,650,702	-4.17%	13.65%	8.58%	5.07%	2
小計	200,000,000	231,125,217	-4.39%	15.56%	8.58%	6.98%	
全球股票型委託							
Wellington	150,000,000	283,557,686	35.72%	89.04%	64.12%	24.92%	1
合計	350,000,000	514,682,904	14.21%	47.05%			

(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	153,409,047	35.66%	93.51%	71.80%	21.71%	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	105,647,168	-4.15%	5.65%	4.07%	1.58%	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12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	699,817,222	208,760,912
累積總損益	99,817,222	8,760,912
委託經營總報酬率	16.64%	4.38%

(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	231,059,078	-2.50%	15.53%	12.83%	2.70%	2
Wellington	200,000,000	227,401,127	-3.95%	13.70%	12.83%	0.87%	3
PIMCO	200,000,000	241,357,017	-3.24%	20.68%	12.83%	7.85%	1
合計	600,000,000	699,817,222	-3.23%	16.64%	12.83%	3.81%	

(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	208,760,912	-3.17%	4.38%	1.61%	2.77%	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12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	881,384,011
累積總損益	281,384,011
委託經營總報酬率	46.90%

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	324,972,942	30.80%	62.49%	43.06%	19.43%	1
BlackRock	200,000,000	290,187,072	25.55%	45.09%	46.64%	-1.55%	2
Amundi	200,000,000	266,223,997	21.49%	33.11%	46.29%	-13.18%	3
合計	600,000,000	881,384,011	26.14%	46.90%			

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12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	420,908,247
累積總損益	-29,091,753
委託經營總報酬率	-6.46%

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	137,435,107	-10.11%	-8.38%	-4.29%	-4.09%	3
BlueBay	150,000,000	142,531,515	-8.02%	-4.98%	-4.09%	-0.89%	1
Templeton	150,000,000	140,941,626	-7.63%	-6.04%	-4.09%	-1.95%	2
合計	450,000,000	420,908,247	-8.59%	-6.46%			

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12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	576,251,570
委託經營月底資產淨值	546,416,180
累積總損益	-29,835,390
委託經營總報酬率	-5.18%

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	295,747,114	-8.97%	-4.57%	0.30%	-4.87%	1
被動式全球債券型委託							
Vanguard	266,341,424	250,669,067	-4.18%	-5.88%	-6.00%	0.12%	N/A(附註4)
合計	576,251,570	546,416,180	-6.83%	-5.18%			

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。
4. 契約已於本月底終止，帳上資產進行帳務調整中，故不進行排名。