

勞工保險基金 國外委託經營績效統計表
102年5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	472,713,963	130,409,433	105,583,940
累積總損益	122,713,963	51,133,419	5,583,940
委託經營總報酬率	35.06%	64.50%	5.58%

(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	118,118,067	-4.08%	18.12%	8.07%	10.05%	1
Alliance Bernstein	100,000,000	113,608,143	-4.20%	13.61%	8.07%	5.54%	2
小計	200,000,000	231,726,210	-4.14%	15.86%	8.07%	7.79%	
全球股票型委託							
Wellington	150,000,000	240,987,753	15.35%	60.66%	44.03%	16.63%	1
合計	350,000,000	472,713,963	4.89%	35.06%			

(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	130,409,433	15.32%	64.50%	50.77%	13.73%	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	105,583,940	-4.21%	5.58%	3.58%	2.00%	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	697,375,539	207,505,082
累積總損益	97,375,539	7,505,082
委託經營總報酬率	16.23%	3.75%

(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	230,193,627	-2.86%	15.10%	11.57%	3.53%	2
Wellington	200,000,000	226,921,276	-4.15%	13.46%	11.57%	1.89%	3
PIMCO	200,000,000	240,260,636	-3.68%	20.13%	11.57%	8.56%	1
合計	600,000,000	697,375,539	-3.57%	16.23%	11.57%	4.66%	

(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	207,505,082	-3.75%	3.75%	0.47%	3.28%	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	780,429,591
累積總損益	180,429,591
委託經營總報酬率	30.07%

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	285,068,695	14.74%	42.53%	25.55%	16.98%	1
BlackRock	200,000,000	259,496,481	12.27%	29.75%	28.69%	1.06%	2
Amundi	200,000,000	235,864,416	7.63%	17.93%	28.38%	-10.45%	3
合計	600,000,000	780,429,591	11.69%	30.07%			

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	441,275,274
累積總損益	-8,724,726
委託經營總報酬率	-1.94%

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	145,156,468	-5.06%	-3.23%	-0.61%	-2.62%	3
BlueBay	150,000,000	149,456,693	-3.55%	-0.36%	-0.40%	0.04%	1
Templeton	150,000,000	146,662,112	-3.88%	-2.23%	-0.40%	-1.82%	2
合計	450,000,000	441,275,274	-4.16%	-1.94%			

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	832,851,840
累積總損益	-17,253,607
委託經營總報酬率	-2.03%

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	331,286,995	1.97%	6.90%	1.94%	4.96%	1
被動式全球債券型委託							
SSgA	273,853,877	254,223,588	-5.48%	-7.17%	-7.06%	-0.11%	2
Vanguard	266,341,424	247,341,257	-5.45%	-7.13%	-7.06%	-0.07%	1
小計	540,195,301	501,564,845	-5.46%	-7.15%	-7.06%	-0.09%	
合計	850,105,447	832,851,840	-2.64%	-2.03%			

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。