

勞工保險基金 國外委託經營績效統計表

101年12月31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	450,661,119	113,087,309	110,225,965
累積總損益	100,661,119	33,811,295	10,225,965
委託經營總報酬率	28.76%	42.65%	10.23%

(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	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	123,146,489	6.75%	23.15%	13.11%	10.04%	1
Alliance Bernstein	100,000,000	118,592,075	3.42%	18.59%	13.11%	5.48%	2
小計	200,000,000	241,738,563	5.09%	20.87%	13.11%	7.76%	
全球股票型委託							
Wellington	150,000,000	208,922,555	21.30%	39.28%	29.56%	9.72%	1
合計	350,000,000	450,661,119	12.03%	28.76%			

(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	超越指標 幅度	超越指標 幅度排名
Wellington (II)	79,276,014	113,087,309	21.33%	42.65%	35.62%	7.03%	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	超越指標 幅度	超越指標 幅度排名
Alliance Bernstein (II)	100,000,000	110,225,965	3.38%	10.23%	8.41%	1.82%	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

勞工保險基金 國外委託經營績效統計表

101年12月31日

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	723,173,449	215,595,370
累積總損益	123,173,449	15,595,370
委託經營總報酬率	20.53%	7.80%

(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	236,981,725	7.99%	18.49%	15.84%	2.65%	2
Wellington	200,000,000	236,746,753	4.89%	18.37%	15.84%	2.53%	3
PIMCO	200,000,000	249,444,971	8.90%	24.72%	15.84%	8.88%	1
合計	600,000,000	723,173,449	7.26%	20.53%	15.84%	4.69%	

(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	215,595,370	7.80%	7.80%	4.32%	3.48%	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。

勞工保險基金 國外委託經營績效統計表

101年12月31日

第四梯次績效統計表

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	698,727,520
累積總損益	98,727,520
委託經營總報酬率	16.45%

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	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	248,448,590	24.90%	24.22%	12.94%	11.28%	1
BlackRock	200,000,000	231,140,733	16.58%	15.57%	15.76%	-0.19%	2
Amundi	200,000,000	219,138,198	9.57%	9.57%	15.49%	-5.92%	3
合計	600,000,000	698,727,520	17.00%	16.45%			

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。

勞工保險基金 國外委託經營績效統計表
101年12月31日

101年度績效統計表

單位：美元

	101年度 (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	460,450,851
累積總損益	10,450,851
委託經營總報酬率	2.32%

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	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	152,897,612	1.93%	1.93%	3.38%	-1.45%	2
BlueBay	150,000,000	154,965,205	3.31%	3.31%	3.60%	-0.29%	1
Templeton	150,000,000	152,588,034	1.73%	1.73%	3.60%	-1.87%	3
合計	450,000,000	460,450,851	2.32%	2.32%			

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。

勞工保險基金 國外委託經營績效統計表

101年12月31日

101年度續約績效統計表

單位：美元

	101年度續約 (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	855,449,172
累積總損益	5,343,725
委託經營總報酬率	0.63%

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	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	324,891,028	4.83%	4.83%	6.31%	-1.48%	1
被動式全球債券型委託							
SSgA	273,853,877	268,956,112	-1.79%	-1.79%	-1.78%	-0.01%	2
Vanguard	266,341,424	261,602,032	-1.78%	-1.78%	-1.78%	0.00%	1
小計	540,195,301	530,558,144	-1.78%	-1.78%	-0.84%	-0.94%	
合計	850,105,447	855,449,172	0.63%	0.63%			

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。