

**勞工保險基金**  
**國外委託經營績效統計表**  
**101年2月29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	426,768,307	104,316,457	108,124,580
累積總損益	76,768,307	25,040,442	8,124,580
委託經營總報酬率	21.93%	31.59%	8.12%

**(一) 第一梯次續約：自98年11月1日至101年2月29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
<b>全球債券型委託</b>					
PIMCO	100,000,000	117,757,047	17,757,047	17.76%	2.07%
Alliance Bernstein	100,000,000	116,232,885	16,232,885	16.23%	1.36%
<b>小計</b>	<b>200,000,000</b>	<b>233,989,932</b>	<b>33,989,932</b>	<b>16.99%</b>	<b>1.72%</b>
<b>全球股票型委託</b>					
Wellington	150,000,000	192,778,374	42,778,374	28.52%	11.93%
<b>合計</b>	<b>350,000,000</b>	<b>426,768,307</b>	<b>76,768,307</b>	<b>21.93%</b>	<b>6.09%</b>

**(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2月29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
<b>全球股票型委託</b>					
Wellington (II)	79,276,014	104,316,457	25,040,442	31.59%	11.92%

**(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2月29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
<b>全球債券型委託</b>					
Alliance Bernstein (II)	100,000,000	108,124,580	8,124,580	8.12%	1.41%

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. 續約帳戶中，全球股票型委託市場指標為MSCI World Index，同期間(98/11/1-101/2/29)市場報酬率為23.21%，今年以來市場報酬率為10.15%；全球債券型委託市場指標為Barclays Capital Global Aggregate A- or better Bond Index，同期間(98/11/1-101/2/29)市場報酬率為11.70%，今年以來市場報酬率為1.30%。
4. 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(99/7/1-101/2/29)市場報酬率為28.97%，今年以來市場報酬率為10.15%；全球債券型委託市場指標為Barclays Capital Global Aggregate A- or better Bond Index，同期間(100/2/1-101/2/29)市場報酬率為7.06%，今年以來(自委託日起算)市場報酬率為1.30%。

## 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	851,255,205	103,222,474
累積總損益	151,255,205	9,934,526
委託經營總報酬率	21.61%	10.65%

### (一) 第二梯次：自96年10月1日至101年2月29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
<b>美國股票型委託</b>					
Janus	150,000,000	123,565,927	-26,434,073	-17.62%	9.84%
<b>全球新興市場股票型委託</b>					
Vontobel	150,000,000	202,853,195	52,853,195	35.24%	13.61%
<b>小計</b>	<b>300,000,000</b>	<b>326,419,122</b>	<b>26,419,122</b>	<b>8.81%</b>	<b>12.15%</b>
<b>被動式全球債券型委託</b>					
SSgA	200,000,000	266,080,373	66,080,373	33.04%	0.52%
Vanguard	200,000,000	258,755,710	58,755,710	29.38%	0.51%
<b>小計</b>	<b>400,000,000</b>	<b>524,836,083</b>	<b>124,836,083</b>	<b>31.21%</b>	<b>0.51%</b>
<b>合計</b>	<b>700,000,000</b>	<b>851,255,205</b>	<b>151,255,205</b>	<b>21.61%</b>	<b>4.68%</b>

### (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2月29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
<b>全球新興市場股票型委託</b>					
Vontobel	93,287,948	103,222,474	9,934,526	10.65%	13.75%

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(96/10/1-101/2/29)市場報酬率為-3.06%，今年以來市場報酬率為9.18%。
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(96/10/1-101/2/29)市場報酬率為6.40%，今年以來市場報酬率為18.72%。
5. 被動式全球債券型委託市場指標為Barclays Capital Global Treasury Index，同期間(96/10/1-101/2/29)市場報酬率為32.95%，(96/11/1-101/2/29)市場報酬率為30.81%，今年以來市場報酬率為0.61%。
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(100/1/1-101/2/29)市場報酬率為-4.07%，今年以來市場報酬率為18.72%。

### 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	688,437,763	201,985,321
累積總損益	88,437,763	1,985,321
委託經營總報酬率	14.74%	0.99%

(一) 第三梯次：自99年2月1日至101年2月29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
<b>全球債券型委託</b>					
Standish Mellon	200,000,000	224,739,144	24,739,144	12.37%	2.41%
Wellington	200,000,000	229,337,312	29,337,312	14.67%	1.61%
PIMCO	200,000,000	234,361,307	34,361,307	17.18%	2.32%
<b>合計</b>	<b>600,000,000</b>	<b>688,437,763</b>	<b>88,437,763</b>	<b>14.74%</b>	<b>2.11%</b>

(二) 第三梯次加碼：自101年1月1日至101年2月29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
<b>全球債券型委託</b>					
PIMCO	200,000,000	201,985,321	1,985,321	0.99%	0.99%

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(99/2/01-101/2/29)市場報酬率為12.82%，今年以來市場報酬率為1.61%。

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(101/1/1-101/2/29)市場報酬率為1.61%，今年以來市場報酬率為1.61%。

#### 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	662,078,110
累積總損益	62,078,110
委託經營總報酬率	10.35%

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
<b>全球股票型委託</b>					
MFS	200,000,000	220,600,104	20,600,104	10.30%	10.90%
BlackRock	200,000,000	222,411,810	22,411,810	11.21%	12.18%
Amundi	200,000,000	219,066,196	19,066,196	9.53%	9.53%
<b>合計</b>	<b>600,000,000</b>	<b>662,078,110</b>	<b>62,078,110</b>	<b>10.35%</b>	<b>10.87%</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(100/11/1-101/2/29)市場報酬率為7.40%，BlackRock帳戶委託期間(100/12/1-101/2/29)市場報酬率為10.09%，AMUNDI帳戶委託期間(101/1/3-101/2/29)市場報酬率為9.83%；今年以來市場報酬率為10.15%。