

勞保基金 國外委託經營績效統計表
102年11月30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 | 509,520,374 | 149,689,162 | 106,559,397 |
| 累積總損益 | 159,520,374 | 70,413,148 | 6,559,397 |
| 委託經營總報酬率 | 45.58% | 88.82% | 6.56% |

(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 | 118,221,830 | -4.00% | 18.22% | 9.49% | 8.73% | 1 |
| Alliance Bernstein | 100,000,000 | 114,629,371 | -3.34% | 14.63% | 9.49% | 5.14% | 2 |
| 小計 | 200,000,000 | 232,851,201 | -3.68% | 16.43% | 9.49% | 6.94% | |
| 全球股票型委託 | | | | | | | |
| Wellington | 150,000,000 | 276,669,174 | 32.43% | 84.45% | 60.72% | 23.73% | 1 |
| 合計 | 350,000,000 | 509,520,374 | 13.06% | 45.58% | | | |

(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 | 149,689,162 | 32.37% | 88.82% | 68.24% | 20.58% | 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 | 106,559,397 | -3.33% | 6.56% | 4.94% | 1.62% | 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11月30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 | 701,490,600 | 209,580,856 |
| 累積總損益 | 101,490,600 | 9,580,856 |
| 委託經營總報酬率 | 16.92% | 4.79% |

(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 | 230,736,965 | -2.64% | 15.37% | 13.51% | 1.86% | 2 |
| Wellington | 200,000,000 | 228,439,542 | -3.51% | 14.22% | 13.51% | 0.71% | 3 |
| PIMCO | 200,000,000 | 242,314,093 | -2.86% | 21.16% | 13.51% | 7.65% | 1 |
| 合計 | 600,000,000 | 701,490,600 | -3.00% | 16.92% | 13.51% | 3.41% | |

(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 | 209,580,856 | -2.79% | 4.79% | 2.22% | 2.57% | 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11月30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 | 862,961,947 |
| 累積總損益 | 262,961,947 |
| 委託經營總報酬率 | 43.83% |

| 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 | 314,956,422 | 26.77% | 57.48% | 40.10% | 17.38% | 1 |
| BlackRock | 200,000,000 | 286,321,611 | 23.87% | 43.16% | 43.60% | -0.44% | 2 |
| Amundi | 200,000,000 | 261,683,914 | 19.42% | 30.84% | 43.26% | -12.42% | 3 |
| 合計 | 600,000,000 | 862,961,947 | 23.50% | 43.83% | | | |

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11月30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 | 423,896,583 |
| 累積總損益 | -26,103,417 |
| 委託經營總報酬率 | -5.80% |

| 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 | 138,763,973 | -9.24% | -7.49% | -3.65% | -3.84% | 3 |
| BlueBay | 150,000,000 | 143,673,195 | -7.29% | -4.22% | -3.45% | -0.77% | 1 |
| Templeton | 150,000,000 | 141,459,414 | -7.29% | -5.69% | -3.45% | -2.24% | 2 |
| 合計 | 450,000,000 | 423,896,583 | -7.94% | -5.80% | | | |

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11月30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 | 850,105,447 |
| 委託經營月底資產淨值 | 811,571,866 |
| 累積總損益 | -38,533,582 |
| 委託經營總報酬率 | -4.53% |

| 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 | 298,953,375 | -7.98% | -3.54% | 2.11% | -5.65% | 1 |
| 被動式全球債券型委託 | | | | | | | |
| SSgA | 273,853,877 | 260,314,099 | -3.21% | -4.94% | -5.10% | 0.16% | N/A(附註4) |
| Vanguard | 266,341,424 | 252,304,391 | -3.55% | -5.27% | -5.10% | -0.17% | 1 |
| 小計 | 540,195,301 | 512,618,490 | -3.38% | -5.10% | -5.10% | 0.00% | |
| 合計 | 850,105,447 | 811,571,866 | -5.13% | -4.53% | | | |

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。