

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。