

勞工保險基金 國外委託經營績效統計表

102年2月28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	457,052,672	118,953,170	108,038,373
累積總損益	107,052,672	39,677,156	8,038,373
委託經營總報酬率	30.59%	50.05%	8.04%

(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	120,997,855	-1.74%	21.00%	10.73%	10.27%	1
Alliance Bernstein	100,000,000	116,239,193	-1.98%	16.24%	10.73%	5.51%	2
小計	200,000,000	237,237,048	-1.86%	18.62%	10.73%	7.89%	
全球股票型委託							
Wellington	150,000,000	219,815,624	5.21%	46.54%	36.39%	10.15%	1
合計	350,000,000	457,052,672	1.42%	30.59%			

(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	118,953,170	5.19%	50.05%	42.77%	7.28%	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	108,038,373	-1.98%	8.04%	6.13%	1.91%	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

勞工保險基金 國外委託經營績效統計表

102年2月28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	711,004,652	212,702,268
累積總損益	111,004,652	12,702,268
委託經營總報酬率	18.50%	6.35%

(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	233,068,209	-1.65%	16.53%	13.70%	2.84%	2
Wellington	200,000,000	231,821,941	-2.08%	15.91%	13.70%	2.21%	3
PIMCO	200,000,000	246,114,502	-1.34%	23.06%	13.70%	9.36%	1
合計	600,000,000	711,004,652	-1.68%	18.50%	13.70%	4.80%	

(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	212,702,268	-1.34%	6.35%	2.39%	3.96%	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

102年2月28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	740,492,607
累積總損益	140,492,607
委託經營總報酬率	23.42%

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	267,524,416	7.68%	33.76%	18.88%	14.88%	1
BlackRock	200,000,000	243,573,470	5.38%	21.79%	21.86%	-0.07%	2
Amundi	200,000,000	229,394,721	4.68%	14.70%	21.57%	-6.87%	3
合計	600,000,000	740,492,607	5.98%	23.42%			

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
102年2月28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	460,799,499
累積總損益	10,799,499
委託經營總報酬率	2.40%

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	153,053,138	0.10%	2.04%	3.69%	-1.65%	2
BlueBay	150,000,000	155,659,538	0.45%	3.77%	3.90%	-0.13%	1
Templeton	150,000,000	152,086,823	-0.33%	1.39%	3.90%	-2.51%	3
合計	450,000,000	460,799,499	0.08%	2.40%			

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
102年2月28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	840,808,098
累積總損益	-9,297,349
委託經營總報酬率	-1.09%

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	324,315,065	-0.18%	4.65%	5.96%	-1.31%	1
被動式全球債券型委託							
SSgA	273,853,877	261,837,540	-2.65%	-4.39%	-4.36%	-0.03%	1
Vanguard	266,341,424	254,655,492	-2.66%	-4.39%	-4.36%	-0.03%	1
小計	540,195,301	516,493,033	-2.65%	-4.39%	-4.36%	-0.03%	
合計	850,105,447	840,808,098	-1.71%	-1.09%			

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。