

勞工保險基金
國外委託經營績效統計表
101年4月30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	431,173,058	105,689,416	108,685,494
累積總損益	81,173,058	26,413,402	8,685,494
委託經營總報酬率	23.19%	33.32%	8.69%

(一) 第一梯次續約：自98年11月1日至101年4月30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
全球債券型委託					
PIMCO	100,000,000	118,953,797	18,953,797	18.95%	3.11%
Alliance Bernstein	100,000,000	116,875,770	16,875,770	16.88%	1.93%
小計	200,000,000	235,829,567	35,829,567	17.91%	2.52%
全球股票型委託					
Wellington	150,000,000	195,343,491	45,343,491	30.23%	13.42%
合計	350,000,000	431,173,058	81,173,058	23.19%	7.19%

(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4月30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
全球股票型委託					
Wellington (II)	79,276,014	105,689,416	26,413,402	33.32%	13.39%

(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4月30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
全球債券型委託					
Alliance Bernstein (II)	100,000,000	108,685,494	8,685,494	8.69%	1.94%

附註：

- 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。
- 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。
- 續約帳戶中，全球股票型委託市場指標為MSCI World Index，同期間(98/11/1-101/4/30)市場報酬率為23.38%，今年以來市場報酬率為10.30%；全球債券型委託市場指標為Barclays Capital Global Aggregate A- or better Bond Index，同期間(98/11/1-101/4/30)市場報酬率為12.20%，今年以來市場報酬率為1.75%。
- 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(99/7/1-101/4/30)市場報酬率為29.15%，今年以來市場報酬率為10.30%；全球債券型委託市場指標為Barclays Capital Global Aggregate A- or better Bond Index，同期間(100/2/1-101/4/30)市場報酬率為7.54%，今年以來(自委託日起算)市場報酬率為1.75%。

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	856,845,687	103,967,324
累積總損益	156,845,687	10,679,375
委託經營總報酬率	22.41%	11.45%

(一) 第二梯次：自96年10月1日至101年4月30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
美國股票型委託					
Janus	150,000,000	125,131,714	-24,868,286	-16.58%	11.23%
全球新興市場股票型委託					
Vontobel	150,000,000	204,664,502	54,664,502	36.44%	14.63%
小計	300,000,000	329,796,216	29,796,216	9.93%	13.31%
被動式全球債券型委託					
SSgA	200,000,000	267,200,131	67,200,131	33.60%	0.94%
Vanguard	200,000,000	259,849,341	59,849,341	29.92%	0.94%
小計	400,000,000	527,049,472	127,049,472	31.76%	0.94%
合計	700,000,000	856,845,687	156,845,687	22.41%	5.37%

(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4月30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
全球新興市場股票型委託					
Vontobel	93,287,948	103,967,324	10,679,375	11.45%	14.58%

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(2007/10/1-101/4/30)市場報酬率為-0.60%，今年以來市場報酬率為11.96%。
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(96/10/1-101/4/30)市場報酬率為0.55%，今年以來市場報酬率為12.18%。
5. 被動式全球債券型委託市場指標為Barclays Capital Global Treasury Index，同期間市場報酬率為33.54%(96/10/1-101/4/30)與31.38%(96/11/1-101/4/30)，今年以來市場報酬率為1.05%。
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(100/1/1-101/4/30)市場報酬率為-9.35%，今年以來市場報酬率為12.18%。

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	694,124,877	203,717,994
累積總損益	94,124,877	3,717,994
委託經營總報酬率	15.69%	1.86%

(一) 第三梯次：自99年2月1日至101年4月30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
全球債券型委託					
Standish Mellon	200,000,000	225,959,016	25,959,016	12.98%	2.96%
Wellington	200,000,000	230,947,917	30,947,917	15.47%	2.32%
PIMCO	200,000,000	237,217,945	37,217,945	18.61%	3.57%
合計	600,000,000	694,124,877	94,124,877	15.69%	2.95%

(二) 第三梯次加碼：自101年1月1日至101年4月30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
全球債券型委託					
PIMCO	200,000,000	203,717,994	3,717,994	1.86%	1.86%

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(99/2/01-101/4/30)市場報酬率為13.33%，今年以來市場報酬率為2.06%。
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(101/1/1-101/4/30)市場報酬率為2.06%，今年以來市場報酬率為2.06%。

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	666,785,165
累積總損益	66,785,165
委託經營總報酬率	11.13%

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
全球股票型委託					
MFS	200,000,000	226,040,486	26,040,486	13.02%	13.63%
BlackRock	200,000,000	223,402,110	23,402,110	11.70%	12.68%
Amundi	200,000,000	217,342,569	17,342,569	8.67%	8.67%
合計	600,000,000	666,785,165	66,785,165	11.13%	11.65%

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(100/11/1-101/4/30)市場報酬率為7.54%，BlackRock帳戶委託期間(100/12/1-101/4/30)市場報酬率為10.24%，AMUNDI帳戶委託期間(101/1/3-101/4/30)市場報酬率為9.97%；今年以來市場報酬率為10.30%。