

**勞工保險基金**  
**國外委託經營績效統計表**  
**101年3月31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	429,177,218	106,308,016	107,225,499
累積總損益	79,177,218	27,032,001	7,225,499
委託經營總報酬率	22.62%	34.10%	7.23%

**(一) 第一梯次續約：自98年11月1日至101年3月31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	117,429,538	17,429,538	17.43%	1.79%
Alliance Bernstein	100,000,000	115,293,371	15,293,371	15.29%	0.55%
小計	200,000,000	232,722,909	32,722,909	16.36%	1.17%
<b>全球股票型委託</b>					
Wellington	150,000,000	196,454,309	46,454,309	30.97%	14.06%
合計	350,000,000	429,177,218	79,177,218	22.62%	6.69%

**(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3月31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	106,308,016	27,032,001	34.10%	14.05%

**(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3月31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	107,225,499	7,225,499	7.23%	0.57%

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(98/11/1-101/3/31)市場報酬率為24.79%，今年以來市場報酬率為11.56%；全球債券型委託市場指標為Barclays Capital Global Aggregate A- or better Bond Index，同期間(98/11/1-101/3/31)市場報酬率為10.86%，今年以來市場報酬率為0.53%。
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(99/7/1-101/3/31)市場報酬率為30.63%，今年以來市場報酬率為11.56%；全球債券型委託市場指標為Barclays Capital Global Aggregate A- or better Bond Index，同期間(100/2/1-101/3/31)市場報酬率為6.26%，今年以來(自委託日起算)市場報酬率為0.53%。

## 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	849,638,412	103,873,442
累積總損益	149,638,412	10,585,493
委託經營總報酬率	21.38%	11.35%

(一) 第二梯次：自96年10月1日至101年3月31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	126,023,798	-23,976,202	-15.98%	12.03%
<b>全球新興市場股票型委託</b>					
Vontobel	150,000,000	204,492,654	54,492,654	36.33%	14.53%
<b>小計</b>	<b>300,000,000</b>	<b>330,516,451</b>	<b>30,516,451</b>	<b>10.17%</b>	<b>13.56%</b>
<b>被動式全球債券型委託</b>					
SSgA	200,000,000	263,177,483	63,177,483	31.59%	-0.58%
Vanguard	200,000,000	255,944,477	55,944,477	27.97%	-0.58%
<b>小計</b>	<b>400,000,000</b>	<b>519,121,960</b>	<b>119,121,960</b>	<b>29.78%</b>	<b>-0.58%</b>
<b>合計</b>	<b>700,000,000</b>	<b>849,638,412</b>	<b>149,638,412</b>	<b>21.38%</b>	<b>4.48%</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3月31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	103,873,442	10,585,493	11.35%	14.47%

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(2007/10/1-101/3/31)市場報酬率為0.00%，今年以來市場報酬率為12.64%。
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(96/10/1-101/3/31)市場報酬率為3.06%，今年以來市場報酬率為14.99%。
5. 被動式全球債券型委託市場指標為Barclays Capital Global Treasury Index，同期間(96/10/1-101/3/31)市場報酬率為31.51%，(96/11/1-101/3/31)市場報酬率為29.39%，今年以來市場報酬率為-0.48%。
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(100/1/1-101/3/31)市場報酬率為-7.08%，今年以來市場報酬率為14.99%。

### 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	683,200,167	200,896,878
累積總損益	83,200,167	896,878
委託經營總報酬率	13.87%	0.45%

(一) 第三梯次：自99年2月1日至101年3月31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	221,574,158	21,574,158	10.79%	0.96%
Wellington	200,000,000	227,653,068	27,653,068	13.83%	0.86%
PIMCO	200,000,000	233,972,941	33,972,941	16.99%	2.15%
<b>合計</b>	<b>600,000,000</b>	<b>683,200,167</b>	<b>83,200,167</b>	<b>13.87%</b>	<b>1.33%</b>

(二) 第三梯次加碼：自101年1月1日至101年3月31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	200,896,878	896,878	0.45%	0.45%

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(99/2/01-101/3/31)市場報酬率為12.01%，今年以來市場報酬率為0.87%。
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(101/1/1-101/3/31)市場報酬率為0.87%，今年以來市場報酬率為0.87%。

#### 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	673,282,916
累積總損益	73,282,916
委託經營總報酬率	12.21%

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	227,532,616	27,532,616	13.77%	14.38%
BlackRock	200,000,000	226,199,211	26,199,211	13.10%	14.09%
Amundi	200,000,000	219,551,090	19,551,090	9.78%	9.78%
<b>合計</b>	<b>600,000,000</b>	<b>673,282,916</b>	<b>73,282,916</b>	<b>12.21%</b>	<b>12.74%</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(100/11/1-101/3/31)市場報酬率為8.78%，BlackRock帳戶委託期間(100/12/1-101/3/31)市場報酬率為11.50%，AMUNDI帳戶委託期間(101/1/3-101/3/31)市場報酬率為11.24%；今年以來市場報酬率為11.56%。