

**勞工保險基金**  
**國外委託經營績效統計表**  
**101年9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)	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	444,285,854	108,343,189	111,458,993
累積總損益	94,285,854	29,067,174	11,458,993
委託經營總報酬率	26.94%	36.67%	11.46%

(一) 第一梯次續約：自98年11月1日至101年9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
<b>全球債券型委託</b>					
PIMCO	100,000,000	124,105,498	24,105,498	24.11%	7.58%
Alliance Bernstein	100,000,000	119,898,223	19,898,223	19.90%	4.56%
小計	200,000,000	244,003,722	44,003,722	22.00%	6.07%
<b>全球股票型委託</b>					
Wellington	150,000,000	200,282,132	50,282,132	33.52%	16.29%
合計	350,000,000	444,285,854	94,285,854	26.94%	10.45%

(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9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
<b>全球股票型委託</b>					
Wellington (II)	79,276,014	108,343,189	29,067,174	36.67%	16.24%

(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9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
<b>全球債券型委託</b>					
Alliance Bernstein (II)	100,000,000	111,458,993	11,458,993	11.46%	4.54%

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(98/11/1-101/9/30)市場報酬率為26.42%，今年以來市場報酬率為13.01%；全球債券型委託市場指標為Barclays Capital Global Aggregate A- or better Bond Index，同期間(98/11/1-101/9/30)市場報酬率為14.58%，今年以來市場報酬率為3.90%。
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(99/7/1-101/9/30)市場報酬率為32.33%，今年以來市場報酬率為13.01%；全球債券型委託市場指標為Barclays Capital Global Aggregate A- or better Bond Index，同期間(100/2/1-101/9/30)市場報酬率為9.82%，今年以來市場報酬率為3.90%。

## 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	873,455,091	104,378,108
累積總損益	173,455,091	11,090,160
委託經營總報酬率	24.78%	11.89%

(一) 第二梯次：自96年10月1日至101年9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
<b>美國股票型委託</b>					
Janus	150,000,000	127,727,752	-22,272,248	-14.85%	13.54%
<b>全球新興市場股票型委託</b>					
Vontobel	150,000,000	205,532,038	55,532,038	37.02%	15.11%
小計	300,000,000	333,259,790	33,259,790	11.09%	14.51%
<b>被動式全球債券型委託</b>					
SSgA	200,000,000	273,853,877	73,853,877	36.93%	3.45%
Vanguard	200,000,000	266,341,424	66,341,424	33.17%	3.46%
小計	400,000,000	540,195,301	140,195,301	35.05%	3.46%
合計	700,000,000	873,455,091	173,455,091	24.78%	7.41%

(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9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
<b>全球新興市場股票型委託</b>					
Vontobel	93,287,948	104,378,108	11,090,160	11.89%	15.03%

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(2007/10/1-101/9/30)市場報酬率為3.01%，今年以來市場報酬率為16.02%。
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(96/10/1-101/9/30)市場報酬率為0.08%，今年以來市場報酬率為11.66%。
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37.01%(96/10/1-101/9/30)與34.80%(96/11/1-101/9/30)，今年以來市場報酬率為3.68%。
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(100/1/1-101/9/30)市場報酬率為-9.78%，今年以來市場報酬率為11.66%。

### 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	723,096,013	214,969,651
累積總損益	123,096,013	14,969,651
委託經營總報酬率	20.52%	7.48%

#### (一) 第三梯次：自99年2月1日至101年9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
<b>全球債券型委託</b>					
Standish Mellon	200,000,000	235,760,173	35,760,173	17.88%	7.43%
Wellington	200,000,000	237,681,570	37,681,570	18.84%	5.30%
PIMCO	200,000,000	249,654,271	49,654,271	24.83%	9.00%
<b>合計</b>	<b>600,000,000</b>	<b>723,096,013</b>	<b>123,096,013</b>	<b>20.52%</b>	<b>7.25%</b>

#### (二) 第三梯次加碼：自101年1月1日至101年9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
<b>全球債券型委託</b>					
PIMCO	200,000,000	214,969,651	14,969,651	7.48%	7.48%

#### 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(99/2/01-101/9/30)市場報酬率為16.40%，今年以來市場報酬率為4.82%。

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(101/1/1-101/9/30)市場報酬率為4.82%，今年以來市場報酬率為4.82%。

## 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	675,019,098
累積總損益	75,019,098
委託經營總報酬率	12.50%

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	234,026,910	34,026,910	17.01%	17.65%
BlackRock	200,000,000	224,616,528	24,616,528	12.31%	13.29%
Amundi	200,000,000	216,375,660	16,375,660	8.19%	8.19%
<b>合計</b>	<b>600,000,000</b>	<b>675,019,098</b>	<b>75,019,098</b>	<b>12.50%</b>	<b>13.03%</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(100/11/1-101/9/30)市場報酬率為10.19%，BlackRock帳戶委託期間(100/12/1-101/9/30)市場報酬率為12.95%，AMUNDI帳戶委託期間(101/1/3-101/9/30)市場報酬率為12.68%；今年以來市場報酬率為13.01%。