

勞工保險基金第一梯次(續的)國外委託經營績效統計表

(一) 自98年11月1日至100年12月31日

單位:美元	
	國外委託經營 第一梯次(續的) (98年11月1日-100年12月31日)
委託經營金額	350,000,000
委託經營月底資產淨值	402,285,654
累積總損益	52,285,654
委託經營總報酬率	14.93%

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	累積投資報酬率	今年以來投資報酬率
全球債券型委託					
PIMCO	100,000,000	115,363,828	15,363,828	15.36%	7.85%
Alliance Bernstein	100,000,000	114,668,371	14,668,371	14.67%	7.07%
小計	200,000,000	230,032,199	30,032,199	15.02%	7.46%
全球股票型委託					
Wellington	150,000,000	172,233,455	22,233,455	14.82%	-8.05%
合計	350,000,000	402,285,654	52,285,654	14.93%	0.22%

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(續的)之委託起始日期為98年11月1日。
 3. 全球債券型委託市場指標為MSCI World Index, 同期間(98/11/1-100/12/31)市場報酬率為11.86%, 今年以來市場報酬率為-5.54%。
 4. 全球股票型委託市場指標為Barclays Capital Global Aggregate A- or better Bond Index, 同期間(98/11/1-100/12/31)市場報酬率為10.27%, 今年以來市場報酬率為5.82%。

(二) 自99年7月1日至100年12月31日

單位:美元	
	國外委託經營 第一梯次(續的加碼) (99年7月1日-100年12月31日)
委託經營金額	79,276,014
委託經營月底資產淨值	93,209,629
累積總損益	13,933,615
委託經營總報酬率	17.58%

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	累積投資報酬率	今年以來投資報酬率
全球股票型委託					
Wellington (II)	79,276,014	93,209,629	13,933,615	17.58%	-8.02%

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(續的加碼)委託起始日期為99年7月1日。
 3. 全球股票型委託市場指標為MSCI World Index, 同期間(99/7/1-100/12/31)市場報酬率為17.09%, 今年以來市場報酬率為-5.54%。

(三) 自100年2月1日至100年12月31日

單位:美元	
	國外委託經營 第一梯次(續的加碼) (100年2月1日-100年12月31日)
委託經營金額	100,000,000
委託經營月底資產淨值	106,621,841
累積總損益	6,621,841
委託經營總報酬率	6.62%

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	累積投資報酬率	今年以來投資報酬率
全球債券型委託					
Alliance Bernstein (II)	100,000,000	106,621,841	6,621,841	6.62%	6.62%

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(續的加碼)委託起始日期為100年2月1日。
 3. 全球債券型委託市場指標為Barclays Capital Global Aggregate A- or better Bond Index, 同期間(100/2/1-100/12/31)市場報酬率為5.69%, 今年以來(自委託日起算)市場報酬率為5.69%。

勞工保險基金第二梯次國外委託經營績效統計表

(一) 自96年10月1日至100年12月31日

單位:美元	
	第二梯次國外委託經營 (96年10月1日-100年12月31日)
委託經營金額	700,000,000
委託經營月底資產淨值	813,194,651
累積總損益	113,194,651
委託經營總報酬率	16.17%

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	累積投資報酬率	今年以來投資報酬率
美國股票型委託					
Janus	150,000,000	112,493,465	-37,506,535	-25.00%	-8.24%
全球新興市場股票型委託					
Vontobel	150,000,000	178,550,324	28,550,324	19.03%	-3.25%
小計	300,000,000	291,043,790	-8,956,210	-2.99%	-5.24%
被動式全球債券型委託					
SSgA	200,000,000	204,711,382	4,711,382	2.36%	6.39%
Vanguard	200,000,000	257,439,479	57,439,479	28.72%	6.14%
小計	400,000,000	522,150,861	122,150,861	30.54%	6.20%
合計	700,000,000	813,194,651	113,194,651	16.17%	1.84%

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撤款日期為96年10月1日,惟Vanguard撤款日期為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(96/10/1-100/12/31)市場報酬率為-11.22%, 今年以來市場報酬率為1.09%。
 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(96/10/1-100/12/31)市場報酬率為-10.37%, 今年以來市場報酬率為-19.20%。
 5. 被動式全球債券型委託市場指標為Barclays Capital Global Treasury Index, 同期間(96/10/1-100/12/31)市場報酬率為32.15%, (96/11/1-100/12/31)市場報酬率為30.02%, 今年以來市場報酬率為6.33%。
 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。

(二) 自100年1月1日至100年12月31日

單位:美元	
	國外委託經營 第二梯次(加碼) (100年1月1日-100年12月31日)
委託經營金額	93,287,948
委託經營月底資產淨值	90,741,360
累積總損益	-2,546,588
委託經營總報酬率	-2.73%

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	累積投資報酬率	今年以來投資報酬率
全球新興市場股票型委託					
Vontobel (II)	93,287,948	90,741,360	-2,546,588	-2.73%	-2.73%

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(加碼)委託起始日期為100年1月1日。
 3. 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(100/1/1-100/12/31)市場報酬率為-19.20%, 今年以來市場報酬率為-19.20%。

勞工保險基金第三梯次國外委託經營績效統計表

自99年2月1日至100年12月31日

單位:美元	
	第三梯次國外委託經營 (99年2月1日-100年12月31日)
委託經營金額	600,000,000
委託經營月底資產淨值	674,215,340
累積總損益	74,215,340
委託經營總報酬率	12.37%

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	累積投資報酬率	今年以來投資報酬率
全球債券型委託					
Standish Mellon	200,000,000	219,457,092	19,457,092	9.73%	4.46%
Wellington	200,000,000	225,709,517	25,709,517	12.85%	7.04%
PIMCO	200,000,000	229,048,731	29,048,731	14.52%	7.49%
合計	600,000,000	674,215,340	74,215,340	12.37%	6.99%

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. 本基金第三梯次之委託撤款日期為99年2月1日。
 3. 全球債券型委託市場指標為Barclays Capital Global Aggregate Bond Index, 同期間(99/2/01-100/12/31)市場報酬率為11.04%, 今年以來市場報酬率為5.64%。

勞工保險基金第四梯次國外委託經營績效統計表

自100年11月1日至100年12月31日

單位:美元	
	第四梯次國外委託經營 (100年11月1日-100年12月31日)
委託經營金額	400,000,000
委託經營月底資產淨值	397,191,463
累積總損益	-2,808,537
委託經營總報酬率	-0.70%

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	累積投資報酬率	今年以來投資報酬率
全球股票型委託					
MFS	200,000,000	198,920,852	-1,079,148	-0.54%	-0.54%
BlackRock	200,000,000	198,270,611	-1,729,389	-0.86%	-0.86%
合計	400,000,000	397,191,463	-2,808,537	-0.70%	-0.70%

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撤款日期為100年11月1日,BlackRock之撤款日期為100年12月1日。
 3. 全球股票型委託市場指標為MSCI World Index, 100/11/1-100/12/31市場報酬率為-2.50%, 100/12/1-100/12/31市場報酬率為-0.06%。