

勞工保險基金第一梯次(續約)國外委託經營績效統計表

自98年11月1日至100年11月30日

(一)

單位：美元

	國外委託經營 第一梯次(續約) (98年11月1日-100年11月30日)
委託經營金額	350,000,000
委託經營月底資產淨值	402,462,537
累積總損益	52,462,537
委託經營總報酬率	14.99%

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
<b>全球債券型委託</b>					
PIMCO	100,000,000	113,654,407	13,654,407	13.65%	6.25%
Alliance Bernstein	100,000,000	114,227,554	14,227,554	14.23%	6.65%
<b>小計</b>	<b>200,000,000</b>	<b>227,881,962</b>	<b>27,881,962</b>	<b>13.94%</b>	<b>6.45%</b>
<b>全球股票型委託</b>					
Wellington	150,000,000	174,580,576	24,580,576	16.39%	-6.80%
<b>合計</b>	<b>350,000,000</b>	<b>402,462,537</b>	<b>52,462,537</b>	<b>14.99%</b>	<b>0.27%</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. 本基金第一梯次(續約)之委託起始日期為98年11月1日。
3. 全球股票型委託市場指標為MSCI World Index，同期間(98/11/1-100/11/30)市場報酬率為11.92%，今年以來市場報酬率為-5.49%。
4. 全球債券型委託市場指標為Barclays Capital Global Aggregate A- or better Bond Index，同期間(98/11/1-100/11/30)市場報酬率為9.55%，今年以來市場報酬率為5.13%。

(二)

自99年7月1日至100年11月30日

單位：美元

	國外委託經營 第一梯次(續約加碼) (99年7月1日-100年11月30日)
委託經營金額	79,276,014
委託經營月底資產淨值	94,472,646
累積總損益	15,196,632
委託經營總報酬率	19.17%

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
<b>全球股票型委託</b>					
Wellington (II)	79,276,014	94,472,646	15,196,632	19.17%	-6.77%

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(99/7/1-100/11/30)市場報酬率為17.16%，今年以來市場報酬率為-5.49%。

(三)

自100年2月1日至100年11月30日

單位：美元

	國外委託經營 第一梯次(續約加碼) (100年2月1日-100年11月30日)
委託經營金額	100,000,000
委託經營月底資產淨值	106,170,735
累積總損益	6,170,735
委託經營總報酬率	6.17%

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
<b>全球債券型委託</b>					
Alliance Bernstein (II)	100,000,000	106,170,735	6,170,735	6.17%	6.17%

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(100/2/1-100/11/30)市場報酬率為5.00%，今年以來(自委託日起算)市場報酬率為5.00%。

勞工保險基金第二梯次國外委託經營績效統計表

自96年10月1日至100年11月30日

(一)

單位：美元

	第二梯次國外委託經營 (96年10月1日-100年11月30日)
委託經營金額	700,000,000
委託經營月底資產淨值	809,567,365
累積總損益	109,567,365
委託經營總報酬率	15.65%

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
<b>美國股票型委託</b>					
Janus	150,000,000	113,029,155	-36,970,845	-24.65%	-7.81%
<b>全球新興市場股票型委託</b>					
Vontobel	150,000,000	178,717,358	28,717,358	19.14%	-3.16%
<b>小計</b>	<b>300,000,000</b>	<b>291,746,513</b>	<b>-8,253,487</b>	<b>-2.75%</b>	<b>-5.01%</b>
<b>被動式全球債券型委託</b>					
SSeA	200,000,000	262,521,629	62,521,629	31.26%	5.51%
Vanguard	200,000,000	255,299,223	55,299,223	27.65%	5.25%
<b>小計</b>	<b>400,000,000</b>	<b>517,820,853</b>	<b>117,820,853</b>	<b>29.46%</b>	<b>5.38%</b>
<b>合計</b>	<b>700,000,000</b>	<b>809,567,365</b>	<b>109,567,365</b>	<b>15.65%</b>	<b>1.38%</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. 本基金第二梯次委託撥款日期為96年10月1日，惟Vanguard撥款日期為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(96/10/1-100/11/30)市場報酬率為-11.96%，今年以來市場報酬率為0.24%。
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(96/10/1-100/11/30)市場報酬率為-7.96%，今年以來市場報酬率為-17.02%。
5. 被動式全球債券型委託市場指標為Barclays Capital Global Treasury Index，同期間(96/10/1-100/11/30)市場報酬率為31.06%，(96/11/1-100/11/30)市場報酬率為28.95%，今年以來市場報酬率為5.48%。
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。

(二)

自100年1月1日至100年11月30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11月30日)
委託經營金額	93,287,948
委託經營月底資產淨值	90,919,726
累積總損益	-2,368,222
委託經營總報酬率	-2.54%

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
<b>全球新興市場股票型委託</b>					
Vontobel (II)	93,287,948	90,919,726	-2,368,222	-2.54%	-2.54%

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(100/1/1-100/11/30)市場報酬率為-17.02%，今年以來市場報酬率為-17.02%。

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11月30日

單位：美元

	第三梯次國外委託經營 (99年2月1日-100年11月30日)
委託經營金額	600,000,000
委託經營月底資產淨值	668,051,486
累積總損益	68,051,486
委託經營總報酬率	11.34%

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
<b>全球債券型委託</b>					
Standish Mellon	200,000,000	218,350,647	18,350,647	9.18%	3.93%
Wellington	200,000,000	223,565,004	23,565,004	11.78%	6.02%
PIMCO	200,000,000	226,135,835	26,135,835	13.07%	6.12%
<b>合計</b>	<b>600,000,000</b>	<b>668,051,486</b>	<b>68,051,486</b>	<b>11.34%</b>	<b>5.36%</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. 本基金第三梯次之委託撥款日期為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(99/2/1-100/11/30)市場報酬率為10.30%，今年以來市場報酬率為4.94%。

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11月30日

單位：美元

	第四梯次國外委託經營 (100年11月1日-100年11月30日)
委託經營金額	200,000,000
委託經營月底資產淨值	201,652,460
累積總損益	1,652,460
委託經營總報酬率	0.83%

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
<b>全球股票型委託</b>					
MFS	200,000,000	201,652,460	1,652,460	0.83%	0.83%
<b>合計</b>	<b>200,000,000</b>	<b>201,652,460</b>	<b>1,652,460</b>	<b>0.83%</b>	<b>0.83%</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分批撥款，MFS之撥款日期為100年11月1日。
3. 全球股票型委託市場指標為MSCI World Index，100/11/1-100/11/30市場報酬率為-2.44%，今年以來(自委託日100/11/01起算)市場報酬率為-2.44%。