

勞工保險基金
國外債務證券投資明細表
102年12月31日

序號	債券別	債券簡稱	年期	購買日	到期日	票面價值(美元)	票面利率(%)	帳面價值(美元)
1	不動產抵押債	FNR 2005-29ZN	30	2005/3/3	2035/4/25	11,766,403.01	5.50%	11,645,696.21
2	不動產抵押債	GNR 2005-27Z	30	2005/3/15	2035/4/20	5,142,764.67	6.00%	5,130,019.04
3	不動產抵押債	FHR 2967ZA	30	2005/3/21	2035/4/15	14,767,753.14	6.00%	14,767,753.14
4	不動產抵押債	FHR 2995 TC	30	2005/6/13	2035/3/15	566,071.77	6.50%	565,544.96
5	不動產抵押債	FNR 2005-83 LZ	30	2005/8/30	2035/10/25	6,862,344.24	5.50%	6,810,176.43
6	不動產抵押債	FNR 2005-83 KZ	30	2005/9/7	2035/10/25	961,675.80	5.50%	954,892.04

備註：無活絡市場投資

序號	債券別	債券簡稱	年期	購買日	到期日	票面價值	票面利率(%)	帳面價值
1	澳洲公債(澳幣)	ACGB 5.75	10	2011/3/8	2021/5/15	10,000,000.00	5.75	10,109,715.22
2	澳洲公債(澳幣)	ACGB 5.75	10	2011/4/6	2021/5/15	40,000,000.00	5.75	40,522,050.40
3	澳洲公債(澳幣)	ACGB 5.75	10	2011/4/20	2021/5/15	20,000,000.00	5.75	20,266,019.52
4	澳洲公債(澳幣)	ACGB 5.75	10	2011/4/21	2021/5/15	20,000,000.00	5.75	20,246,202.15
5	澳洲公債(澳幣)	ACGB 5.75	10	2011/8/19	2021/5/15	20,000,000.00	5.75	21,923,923.89
6	澳洲公債(澳幣)	ACGB 5.75	10	2011/8/19	2021/5/15	20,000,000.00	5.75	21,912,071.69
7	澳洲公債(澳幣)	ACGB 5.75	10	2011/8/19	2021/5/15	20,000,000.00	5.75	21,906,753.02
8	澳洲公債(澳幣)	ACGB 5.75	10	2011/8/22	2021/5/15	20,000,000.00	5.75	21,807,509.76
9	澳洲公債(澳幣)	ACGB 5.75	10	2011/8/22	2021/5/15	15,000,000.00	5.75	16,349,325.96
10	澳洲公債(澳幣)	ACGB 5.75	10	2011/8/22	2021/5/15	15,000,000.00	5.75	16,383,813.62
11	澳洲公債(澳幣)	ACGB 5.75	10	2011/12/16	2021/7/15	25,000,000.00	5.75	28,389,749.92
12	澳洲公債(澳幣)	ACGB 5.75	10	2012/1/5	2021/7/15	20,000,000.00	5.75	22,673,079.68
13	澳洲公債(澳幣)	ACGB 5.75	10	2012/1/5	2021/7/15	25,000,000.00	5.75	28,361,897.06
14	澳洲公債(澳幣)	ACGB 5.75	10	2012/2/15	2021/7/15	15,000,000.00	5.75	16,765,675.73
15	澳洲公債(澳幣)	ACGB 5.75	10	2012/3/7	2021/7/15	15,000,000.00	5.75	16,820,376.69
16	超國際債券(澳幣)	IADB 4.24	10	2012/8/13	2022/8/24	50,000,000.00	4.24	50,000,000.00
17	超國際債券(澳幣)	ADB 4.20	10	2012/9/12	2022/9/19	50,000,000.00	4.2	50,000,000.00
18	超國際債券(澳幣)	IFC 4.13	10	2012/9/12	2022/9/19	50,000,000.00	4.13	50,000,000.00
19	超國際債券(澳幣)	IBRD 4.09	10	2012/9/12	2022/9/21	50,000,000.00	4.09	50,000,000.00
20	公司債(美元)	WMT 3.25%	10	2011/1/7	2020/10/25	5,000,000.00	3.25	4,786,426.44
21	公司債(美元)	WSTP 4.875%	10	2011/1/7	2019/11/19	10,000,000.00	4.875	10,273,963.20
22	公司債(美元)	WMT 3.25%	10	2011/1/13	2020/10/25	5,000,000.00	3.25	4,783,509.98
23	公司債(美元)	WSTP 4.875%	10	2011/1/13	2019/11/19	5,000,000.00	4.875	5,139,078.41
24	公司債(美元)	M.S. 5.5%	10	2011/1/7	2020/1/26	15,000,000.00	5.5	15,107,700.82
25	公司債(美元)	WMT 3.25%	10	2011/2/9	2020/10/25	5,000,000.00	3.25	4,686,109.55

26	公司債(美元)	WSTP 4.875%	10	2011/2/16	2019/11/19	5,000,000.00	4.875	5,114,016.37
27	公司債(美元)	PEP 3.125	10	2011/3/22	2020/11/1	2,200,000.00	3.125	2,096,144.81
28	公司債(美元)	PEP 3.125	10	2011/3/22	2020/11/1	10,000,000.00	3.125	9,515,110.73
29	公司債(美元)	PEP 3.125	10	2011/3/23	2020/11/1	12,800,000.00	3.125	12,180,827.38
30	公司債(美元)	BNP 5 1/15/2021	10	2011/4/8	2021/1/15	15,000,000.00	5	15,063,956.38
31	公司債(美元)	BNP 5 1/15/2021	10	2011/4/15	2021/1/15	10,000,000.00	5	10,009,693.32
32	公司債(美元)	M.S. 5.75%	10	2011/5/19	2021/1/25	10,000,000.00	5.75	10,313,915.81
33	公司債(美元)	EIBKOR 4	10	2011/9/1	2021/1/29	5,000,000.00	4	4,949,555.68
34	公司債(美元)	POHANG 4.25	10	2011/9/1	2020/10/28	5,000,000.00	4.25	4,890,761.50
35	公司債(美元)	EIBKOR 4	10	2011/9/1	2021/1/29	5,000,000.00	4	4,960,650.50
36	公司債(美元)	EIBKOR 4	10	2011/9/1	2021/1/29	5,000,000.00	4	4,946,203.43
37	公司債(美元)	POHANG 4.25	10	2011/9/1	2020/10/28	8,000,000.00	4.25	7,840,920.92
38	公司債(美元)	POHANG 5.25	10	2011/9/2	2021/4/14	7,000,000.00	5.25	7,243,218.33
39	公司債(美元)	EIBKOR 4	10	2011/9/2	2021/1/29	5,000,000.00	4	4,975,706.33
40	公司債(美元)	POHANG 5.25	10	2011/9/2	2021/4/14	5,000,000.00	5.25	5,169,055.62
41	公司債(美元)	EIBKOR 4	10	2011/9/2	2021/1/29	5,000,000.00	4	4,979,912.94
42	公司債(美元)	EIBKOR 4.375	10	2011/9/20	2021/9/15	10,000,000.00	4.375	9,830,930.72
43	公司債(美元)	POHANG 5.25	10	2011/10/4	2021/4/14	5,000,000.00	5.25	4,947,551.10
44	公司債(美元)	POHANG 5.25	10	2011/10/4	2021/4/14	5,000,000.00	5.25	4,947,064.39
45	公司債(美元)	EIBKOR 4.375	10	2011/10/4	2021/9/15	5,000,000.00	4.375	4,772,135.67
46	公司債(美元)	LIFUNG 5.25	10	2011/10/4	2020/5/13	5,000,000.00	5.25	5,013,531.95
47	公司債(美元)	QTELQD 4.75	10	2011/10/4	2021/2/16	10,000,000.00	4.75	9,823,884.23
48	公司債(美元)	LIFUNG 5.25	10	2011/10/5	2020/5/13	5,000,000.00	5.25	4,961,853.70
49	公司債(美元)	QTELQD 4.75	10	2011/10/5	2021/2/16	5,000,000.00	4.75	4,940,321.37
50	公司債(美元)	POHANG 5.25	10	2011/10/5	2021/4/14	5,000,000.00	5.25	4,922,912.99
51	公司債(美元)	LIFUNG 5.25	10	2011/10/6	2020/5/13	5,000,000.00	5.25	4,947,173.43
52	公司債(美元)	QTELQD 4.75	10	2011/10/6	2021/2/16	5,000,000.00	4.75	4,974,933.78
53	公司債(美元)	LIFUNG 5.25	10	2011/11/17	2020/5/13	5,000,000.00	5.25	5,152,938.36
54	公司債(美元)	HUWHY 4.625	10	2012/3/16	2022/1/13	10,000,000.00	4.625	10,206,534.83
55	公司債(美元)	QTELQD 4.75	10	2012/3/16	2021/2/16	20,000,000.00	4.75	20,579,127.41
56	公司債(美元)	RABOBANK 3.875	10	2012/3/16	2022/2/8	20,000,000.00	3.875	19,692,211.50
57	公司債(美元)	HUWHY 4.625	10	2012/3/16	2022/1/13	5,000,000.00	4.625	5,104,112.63
58	公司債(美元)	RABOBANK 3.875	10	2012/3/21	2022/2/8	10,000,000.00	3.875	9,792,037.86
59	公司債(美元)	HUWHY 4.625	10	2012/3/21	2022/1/13	20,000,000.00	4.625	15,265,718.08
60	公司債(美元)	RABOBANK 3.875	10	2012/3/22	2022/2/8	20,000,000.00	3.875	9,818,349.67
61	公司債(美元)	LIFUNG 5.25	10	2012/3/26	2020/5/13	5,000,000.00	5.25	10,518,516.54
62	公司債(美元)	PETBRA 5.375%	10	2013/7/22	2021/1/27	10,000,000.00	5.375	20,604,865.51

63	公司債(美元)	VALEBZ 4.625%	10	213/7/22	2020/9/15	15,000,000.00	4.625	5,062,501.55
64	公司債(美元)	VALEBZ 4.625%	10	2013/8/2	2020/9/15	10,000,000.00	4.625	4,994,377.10
65	公司債(美元)	VALEBZ 4.625%	10	2013/8/15	2020/9/15	10,000,000.00	4.625	10,010,491.87

序號	債券別	債券簡稱	年期	購買日	到期日	票面價值	買進殖利率	帳面價值
1	公司債(美元)	WSPT 0 08/06	30	2013/7/22	2043/8/6	30,000,000	5.16	30,640,297.74
2	公司債(美元)	RABOBANK 0 08/05	30	2013/7/22	2043/8/5	20,000,000	5.14	20,417,279.58
3	公司債(美元)	ANZ 0 08/06	30	213/7/22	2043/8/6	178,000,000	5.11	40,754,964.04
4	公司債(美元)	UBS 0 08/05	30	2013/7/22	2043/8/5	35,000,000	4.95	35,703,245.97

備註：持有至到期日。