

勞工保險基金第一梯次(續約)國外委託經營績效統計表

(一) 自98年11月1日至100年3月31日

單位：美元

	國外委託經營 第一梯次(續約) (98年11月1日-100年3月31日)
委託經營金額	350,000,000
委託經營月底資產淨值	412,240,478
累積總損益	62,240,478
委託經營總報酬率	17.78%

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	108,780,175	8,780,175	8.78%	1.69%
Alliance Bernstein	100,000,000	108,400,500	8,400,500	8.40%	1.21%
<b>小計</b>	<b>200,000,000</b>	<b>217,180,675</b>	<b>17,180,675</b>	<b>8.59%</b>	<b>1.45%</b>
<b>全球股票型委託</b>					
Wellington	150,000,000	195,059,803	45,059,803	30.04%	4.13%
<b>合計</b>	<b>350,000,000</b>	<b>412,240,478</b>	<b>62,240,478</b>	<b>17.78%</b>	<b>2.70%</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. 全球債券型委託市場指標為MSCI World Index，同期間(98/11/1-100/3/31)市場報酬率為24.10%，今年以來市場報酬率為4.80%。
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(98/11/1-100/3/31)市場報酬率為5.39%，今年以來市場報酬率為1.14%。

(二) 自99年7月1日至100年3月31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3月31日)
委託經營金額	79,276,014
委託經營月底資產淨值	105,522,777
累積總損益	26,246,762
委託經營總報酬率	33.11%

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	105,522,777	26,246,762	33.11%	4.13%

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(99/7/1-100/3/31)市場報酬率為29.90%，今年以來市場報酬率為4.80%。

(三) 自100年2月1日至100年3月31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3月31日)
委託經營金額	100,000,000
委託經營月底資產淨值	100,845,983
累積總損益	845,983
委託經營總報酬率	0.85%

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>					
Alliance Bernstein (II)	100,000,000	100,845,983	845,983	0.85%	0.85%

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(100/2/1-100/3/31)市場報酬率為1.01%，今年以來(自委託日起算)市場報酬率為1.01%。

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3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3月31日)
委託經營金額	700,000,000
委託經營月底資產淨值	805,421,349
累積總損益	105,421,349
委託經營總報酬率	15.06%

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	128,427,569	-21,572,431	-14.38%	4.75%
<b>全球新興市場股票型委託</b>					
Vontobel	150,000,000	182,513,854	32,513,854	21.68%	-1.10%
<b>小計</b>	<b>300,000,000</b>	<b>310,941,423</b>	<b>10,941,423</b>	<b>3.65%</b>	<b>1.24%</b>
<b>被動式全球債券型委託</b>					
SSgA	200,000,000	250,555,478	50,555,478	25.28%	0.70%
Vanguard	200,000,000	243,924,447	43,924,447	21.96%	0.56%
<b>小計</b>	<b>400,000,000</b>	<b>494,479,925</b>	<b>94,479,925</b>	<b>23.62%</b>	<b>0.63%</b>
<b>合計</b>	<b>700,000,000</b>	<b>805,421,349</b>	<b>105,421,349</b>	<b>15.06%</b>	<b>0.87%</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(96/10/1-100/3/31)市場報酬率為-7.22%，今年以來市場報酬率為5.64%。
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(96/10/1-100/3/31)市場報酬率為12.77%，今年以來市場報酬率為1.67%。
5. 被動式全球債券型委託市場指標為Barclays Capital Global Treasury Index，同期間(96/10/1-100/3/31)市場報酬率為25.14%，(96/11/1-100/3/31)市場報酬率為23.12%，今年以來市場報酬率為0.69%。
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3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3月31日)
委託經營金額	93,287,948
委託經營月底資產淨值	92,942,708
累積總損益	-345,240
委託經營總報酬率	-0.37%

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
<b>全球新興市場股票型委託</b>					
Vontobel (II)	93,287,948	92,942,708	-345,240	-0.37%	-0.37%

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(100/1/1-100/3/31)市場報酬率為1.67%，今年以來市場報酬率為1.67%。

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3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3月31日)
委託經營金額	600,000,000
委託經營月底資產淨值	643,700,046
累積總損益	43,700,046
委託經營總報酬率	7.28%

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	213,614,702	13,614,702	6.81%	1.68%
Wellington	200,000,000	213,850,462	13,850,462	6.93%	1.41%
PIMCO	200,000,000	216,234,882	16,234,882	8.12%	1.48%
<b>合計</b>	<b>600,000,000</b>	<b>643,700,046</b>	<b>43,700,046</b>	<b>7.28%</b>	<b>1.52%</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(99/2/01-100/3/31)市場報酬率為6.42%，今年以來市場報酬率為1.24%。