

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6月30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6月30日) |
| 委託經營金額 | 350,000,000 |
| 委託經營月底資產淨值 | 418,900,981 |
| 累積總損益 | 68,900,981 |
| 委託經營總報酬率 | 19.69% |

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 | 111,942,127 | 11,942,127 | 11.94% | 4.65% |
| Alliance Bernstein | 100,000,000 | 112,238,379 | 12,238,379 | 12.24% | 4.80% |
| 小計 | 200,000,000 | 224,180,506 | 24,180,506 | 12.09% | 4.72% |
| 全球股票型委託 | | | | | |
| Wellington | 150,000,000 | 194,720,475 | 44,720,475 | 29.81% | 3.95% |
| 合計 | 350,000,000 | 418,900,981 | 68,900,981 | 19.69% | 4.36% |

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(98/11/1-100/6/30)市場報酬率為24.68%，今年以來市場報酬率為5.29%。
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(98/11/1-100/6/30)市場報酬率為8.73%，今年以來市場報酬率為4.35%。

(二) 自99年7月1日至100年6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6月30日) |
| 委託經營金額 | 79,276,014 |
| 委託經營月底資產淨值 | 105,337,998 |
| 累積總損益 | 26,061,984 |
| 委託經營總報酬率 | 32.87% |

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 | 105,337,998 | 26,061,984 | 32.87% | 3.95% |

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(99/7/1-100/6/30)市場報酬率為30.51%，今年以來市場報酬率為5.29%。

(三) 自100年2月1日至100年6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6月30日) |
| 委託經營金額 | 100,000,000 |
| 委託經營月底資產淨值 | 104,380,474 |
| 累積總損益 | 4,380,474 |
| 委託經營總報酬率 | 4.38% |

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 | 104,380,474 | 4,380,474 | 4.38% | 4.38% |

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(100/2/1-100/6/30)市場報酬率為4.22%，今年以來(自委託日起算)市場報酬率為4.22%。

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6月30日

單位：美元

| | |
|------------|------------------------------------|
| | 第二梯次國外委託經營 (96年10月1日-100年6月30日) |
| 委託經營金額 | 700,000,000 |
| 委託經營月底資產淨值 | 827,507,037 |
| 累積總損益 | 127,507,037 |
| 委託經營總報酬率 | 18.22% |

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 | 123,778,378 | -26,221,622 | -17.48% | 0.96% |
| 全球新興市場股票型委託 | | | | | |
| Vontobel | 150,000,000 | 192,852,759 | 42,852,759 | 28.57% | 4.50% |
| 小計 | 300,000,000 | 316,631,137 | 16,631,137 | 5.54% | 3.09% |
| 被動式全球債券型委託 | | | | | |
| SS&A | 200,000,000 | 258,944,807 | 58,944,807 | 29.47% | 4.07% |
| Vanguard | 200,000,000 | 251,931,094 | 51,931,094 | 25.97% | 3.87% |
| 小計 | 400,000,000 | 510,875,900 | 110,875,900 | 27.72% | 3.97% |
| 合計 | 700,000,000 | 827,507,037 | 127,507,037 | 18.22% | 3.63% |

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(96/10/1-100/6/30)市場報酬率為-7.24%，今年以來市場報酬率為5.62%。
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(96/10/1-100/6/30)市場報酬率為10.62%，今年以來市場報酬率為-0.27%。
5. 被動式全球債券型委託市場指標為Barclays Capital Global Treasury Index，同期間(96/10/1-100/6/30)市場報酬率為29.34%，(96/11/1-100/6/30)市場報酬率為27.25%，今年以來市場報酬率為4.07%。
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6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6月30日) |
| 委託經營金額 | 93,287,948 |
| 委託經營月底資產淨值 | 97,967,150 |
| 累積總損益 | 4,679,201 |
| 委託經營總報酬率 | 5.02% |

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 | 97,967,150 | 4,679,201 | 5.02% | 5.02% |

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(100/1/1-100/6/30)市場報酬率為-0.27%，今年以來市場報酬率為-0.27%。

勞工保險基金第三梯次國外委託經營績效統計表

(一) 自99年2月1日至100年6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6月30日) |
| 委託經營金額 | 600,000,000 |
| 委託經營月底資產淨值 | 661,741,144 |
| 累積總損益 | 61,741,144 |
| 委託經營總報酬率 | 10.29% |

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 | 217,906,738 | 17,906,738 | 8.95% | 3.72% |
| Wellington | 200,000,000 | 220,796,621 | 20,796,621 | 10.40% | 4.71% |
| PIMCO | 200,000,000 | 223,037,785 | 23,037,785 | 11.52% | 4.67% |
| 合計 | 600,000,000 | 661,741,144 | 61,741,144 | 10.29% | 4.37% |

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(99/2/01-100/6/30)市場報酬率為9.71%，今年以來市場報酬率為4.38%。