

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
<b>全球債券型委託</b>					
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%
<b>小計</b>	<b>200,000,000</b>	<b>224,180,506</b>	<b>24,180,506</b>	<b>12.09%</b>	<b>4.72%</b>
<b>全球股票型委託</b>					
Wellington	150,000,000	194,720,475	44,720,475	29.81%	3.95%
<b>合計</b>	<b>350,000,000</b>	<b>418,900,981</b>	<b>68,900,981</b>	<b>19.69%</b>	<b>4.36%</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
<b>全球股票型委託</b>					
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
<b>全球債券型委託</b>					
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
<b>美國股票型委託</b>					
Janus	150,000,000	123,778,378	-26,221,622	-17.48%	0.96%
<b>全球新興市場股票型委託</b>					
Vontobel	150,000,000	192,852,759	42,852,759	28.57%	4.50%
<b>小計</b>	<b>300,000,000</b>	<b>316,631,137</b>	<b>16,631,137</b>	<b>5.54%</b>	<b>3.09%</b>
<b>被動式全球債券型委託</b>					
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%
<b>小計</b>	<b>400,000,000</b>	<b>510,875,900</b>	<b>110,875,900</b>	<b>27.72%</b>	<b>3.97%</b>
<b>合計</b>	<b>700,000,000</b>	<b>827,507,037</b>	<b>127,507,037</b>	<b>18.22%</b>	<b>3.63%</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(96/10/1-100/6/30)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
<b>全球新興市場股票型委託</b>					
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
<b>全球債券型委託</b>					
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%
<b>合計</b>	<b>600,000,000</b>	<b>661,741,144</b>	<b>61,741,144</b>	<b>10.29%</b>	<b>4.37%</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(99/2/01-100/6/30)市場報酬率為9.71%，今年以來市場報酬率為4.38%。