

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8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8月31日)
委託經營金額	350,000,000
委託經營月底資產淨值	408,250,475
累積總損益	58,250,475
委託經營總報酬率	16.64%

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	115,971,289	15,971,289	15.97%	8.41%
Alliance Bernstein	100,000,000	116,615,879	16,615,879	16.62%	8.88%
小計	200,000,000	232,587,168	32,587,168	16.29%	8.65%
全球股票型委託					
Wellington	150,000,000	175,663,306	25,663,306	17.11%	-6.22%
合計	350,000,000	408,250,475	58,250,475	16.64%	1.71%

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(98/11/1-100/8/31)市場報酬率為13.80%，今年以來市場報酬率為-3.90%。
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(98/11/1-100/8/31)市場報酬率為12.51%，今年以來市場報酬率為7.97%。

(二) 自99年7月1日至100年8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8月31日)
委託經營金額	79,276,014
委託經營月底資產淨值	95,063,417
累積總損益	15,787,403
委託經營總報酬率	19.91%

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	95,063,417	15,787,403	19.91%	-6.19%

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(99/7/1-100/8/31)市場報酬率為19.12%，今年以來市場報酬率為-3.90%。

(三) 自100年2月1日至100年8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8月31日)
委託經營金額	100,000,000
委託經營月底資產淨值	108,430,787
累積總損益	8,430,787
委託經營總報酬率	8.43%

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	108,430,787	8,430,787	8.43%	8.43%

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(100/2/1-100/8/31)市場報酬率為7.83%，今年以來(自委託日起算)市場報酬率為7.83%。

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8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8月31日)
委託經營金額	700,000,000
委託經營月底資產淨值	831,231,089
累積總損益	131,231,089
委託經營總報酬率	18.75%

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	108,632,561	-41,367,439	-27.58%	-11.39%
全球新興市場股票型委託					
Vontobel	150,000,000	188,818,344	38,818,344	25.88%	2.32%
小計	300,000,000	297,450,905	-2,549,095	-0.85%	-8.15%
被動式全球債券型委託					
SS&A	200,000,000	270,537,498	70,537,498	35.27%	8.73%
Vanguard	200,000,000	263,242,686	63,242,686	31.62%	8.53%
小計	400,000,000	533,780,184	133,780,184	33.45%	8.63%
合計	700,000,000	831,231,089	131,231,089	18.75%	4.10%

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(96/10/1-100/8/31)市場報酬率為-14.22%，今年以來市場報酬率為-2.33%。
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(96/10/1-100/8/31)市場報酬率為1.70%，今年以來市場報酬率為-8.31%。
5. 被動式全球債券型委託市場指標為Barclays Capital Global Treasury Index，同期間(96/10/1-100/8/31)市場報酬率為35.08%，(96/11/1-100/8/31)市場報酬率為32.90%，今年以來市場報酬率為8.69%。
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8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8月31日)
委託經營金額	93,287,948
委託經營月底資產淨值	95,910,893
累積總損益	2,622,944
委託經營總報酬率	2.81%

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	95,910,893	2,622,944	2.81%	2.81%

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(100/1/1-100/8/31)市場報酬率為-8.31%，今年以來市場報酬率為-8.31%。

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8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8月31日)
委託經營金額	600,000,000
委託經營月底資產淨值	683,686,730
累積總損益	83,686,730
委託經營總報酬率	13.95%

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	224,610,666	24,610,666	12.31%	6.91%
Wellington	200,000,000	228,818,056	28,818,056	14.41%	8.51%
PIMCO	200,000,000	230,258,008	30,258,008	15.13%	8.06%
合計	600,000,000	683,686,730	83,686,730	13.95%	7.83%

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(99/2/01-100/8/31)市場報酬率為13.40%，今年以來市場報酬率為7.89%。