

勞工保險基金
國外債務證券投資明細表-1
100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 (萬美元) | 票面利率(%) | 帳面價值 (萬美元) |
|----|--------|-----------------|----|------------|------------|---------------|---------|---------------|
| 1 | 不動產抵押債 | FHR 2920SC | 30 | 2004/12/29 | 2033/08/15 | 187.19 | 7.840% | 187.19 |
| 2 | 不動產抵押債 | FHR 2934SD | 30 | 2005/01/25 | 2035/02/15 | 77.14 | 7.000% | 77.14 |
| 3 | 不動產抵押債 | FNR 2005-29ZN | 30 | 2005/03/03 | 2035/04/25 | 1,107.80 | 5.500% | 1,096.43 |
| 4 | 不動產抵押債 | GNR 2005-27Z | 30 | 2005/03/15 | 2035/04/20 | 456.26 | 6.000% | 455.13 |
| 5 | 不動產抵押債 | FHR 2967ZA | 30 | 2005/03/21 | 2035/04/15 | 1,426.75 | 6.000% | 1,426.75 |
| 6 | 不動產抵押債 | FHR 2995 TC | 30 | 2005/06/13 | 2035/03/15 | 194.88 | 6.500% | 194.70 |
| 7 | 不動產抵押債 | FNR 2005-65 UH | 30 | 2005/07/05 | 2035/08/25 | 181.08 | 6.500% | 180.65 |
| 8 | 不動產抵押債 | FNR 2005-83 LZ | 30 | 2005/08/30 | 2035/10/25 | 1,792.17 | 5.500% | 1,778.66 |
| 9 | 不動產抵押債 | FNR 2005-83 KZ | 30 | 2005/09/07 | 2035/10/25 | 795.83 | 5.500% | 790.03 |
| 10 | 不動產抵押債 | FNR 2005-106 UZ | 30 | 2005/10/21 | 2035/12/25 | 1,234.58 | 6.000% | 1,229.39 |
| 11 | 公債 | ACGB 5.75 | 10 | 2011/03/08 | 2021/05/15 | 1,000.00 | 5.750% | 1,013.33 |
| 12 | 公債 | ACGB 5.75 | 10 | 2011/04/06 | 2021/05/15 | 4,000.00 | 5.750% | 4,063.38 |
| 13 | 公債 | ACGB 5.75 | 10 | 2011/04/20 | 2021/05/15 | 2,000.00 | 5.750% | 2,032.27 |
| 14 | 公債 | ACGB 5.75 | 10 | 2011/04/21 | 2021/05/15 | 2,000.00 | 5.750% | 2,029.86 |
| 15 | 公債 | ACGB 5.75 | 10 | 2011/08/19 | 2021/05/15 | 2,000.00 | 5.750% | 2,235.74 |
| 16 | 公債 | ACGB 5.75 | 10 | 2011/08/19 | 2021/05/15 | 2,000.00 | 5.750% | 2,234.27 |
| 17 | 公債 | ACGB 5.75 | 10 | 2011/08/19 | 2021/05/15 | 2,000.00 | 5.750% | 2,233.61 |
| 18 | 公債 | ACGB 5.75 | 10 | 2011/08/22 | 2021/05/15 | 2,000.00 | 5.750% | 2,221.33 |
| 19 | 公債 | ACGB 5.75 | 10 | 2011/08/22 | 2021/05/15 | 1,500.00 | 5.750% | 1,665.21 |
| 20 | 公債 | ACGB 5.75 | 10 | 2011/08/22 | 2021/05/15 | 1,500.00 | 5.750% | 1,669.48 |
| 21 | 公債 | ACGB 5.75 | 10 | 2011/12/16 | 2022/07/15 | 2,500.00 | 5.750% | 2,904.50 |
| 22 | 公司債 | WMT 3.25 | 10 | 2011/01/07 | 2020/10/25 | 500.00 | 3.250% | 473.33 |
| 23 | 公司債 | WSTP 4.875 | 10 | 2011/01/07 | 2019/11/19 | 1,000.00 | 4.875% | 1,035.37 |
| 24 | 公司債 | WMT 3.25 | 10 | 2011/01/13 | 2020/10/25 | 500.00 | 3.250% | 472.97 |
| 25 | 公司債 | WSTP 4.875 | 10 | 2011/01/13 | 2019/11/19 | 500.00 | 4.875% | 517.96 |
| 26 | 公司債 | M. S. 5.5 | 10 | 2011/01/07 | 2020/01/26 | 1,500.00 | 5.500% | 1,513.69 |
| 27 | 公司債 | WMT 3.25 | 10 | 2011/02/09 | 2020/10/25 | 500.00 | 3.250% | 460.92 |
| 28 | 公司債 | WSTP 4.875 | 10 | 2011/02/16 | 2019/11/19 | 500.00 | 4.875% | 514.72 |
| 29 | 公司債 | PEP 3.125 | 10 | 2011/03/22 | 2020/11/01 | 220.00 | 3.125% | 207.03 |
| 30 | 公司債 | PEP 3.125 | 10 | 2011/03/22 | 2020/11/01 | 1,000.00 | 3.125% | 939.47 |
| 31 | 公司債 | PEP 3.125 | 10 | 2011/03/23 | 2020/11/01 | 1,280.00 | 3.125% | 1,202.71 |

備註：無活絡市場投資，採持有至到期日。

勞工保險基金
國外債務證券投資明細表-2
100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 (萬美元) | 票面利率(%) | 帳面價值 (萬美元) |
|----|-----|--------------|----|------------|------------|---------------|---------|---------------|
| 32 | 公司債 | BNP 5 | 10 | 2011/04/08 | 2021/01/15 | 1,500.00 | 5.000% | 1,507.91 |
| 33 | 公司債 | BNP 5 | 10 | 2011/04/15 | 2021/01/15 | 1,000.00 | 5.000% | 1,001.22 |
| 34 | 公司債 | M. S. 5.75 | 10 | 2011/05/19 | 2021/01/25 | 1,000.00 | 5.750% | 1,038.53 |
| 35 | 公司債 | EIBKOR 4 | 10 | 2011/09/01 | 2021/01/29 | 500.00 | 4.000% | 493.77 |
| 36 | 公司債 | POHANG 4.25 | 10 | 2011/09/01 | 2020/10/28 | 500.00 | 4.250% | 486.44 |
| 37 | 公司債 | EIBKOR 4 | 10 | 2011/09/01 | 2021/01/29 | 500.00 | 4.000% | 495.14 |
| 38 | 公司債 | EIBKOR 4 | 10 | 2011/09/01 | 2021/01/29 | 500.00 | 4.000% | 493.36 |
| 39 | 公司債 | POHANG 4.25 | 10 | 2011/09/01 | 2020/10/28 | 800.00 | 4.250% | 780.26 |
| 40 | 公司債 | POHANG 5.25 | 10 | 2011/09/02 | 2021/04/14 | 700.00 | 5.250% | 729.77 |
| 41 | 公司債 | EIBKOR 4 | 10 | 2011/09/02 | 2021/01/29 | 500.00 | 4.000% | 497.00 |
| 42 | 公司債 | POHANG 5.25 | 10 | 2011/09/02 | 2021/04/14 | 500.00 | 5.250% | 520.69 |
| 43 | 公司債 | EIBKOR 4 | 10 | 2011/09/02 | 2021/01/29 | 500.00 | 4.000% | 497.52 |
| 44 | 公司債 | EIBKOR 4.375 | 10 | 2011/09/20 | 2021/09/15 | 1,000.00 | 4.375% | 979.56 |
| 45 | 公司債 | POHANG 5.25 | 10 | 2011/10/04 | 2021/04/14 | 500.00 | 5.250% | 493.62 |
| 46 | 公司債 | POHANG 5.25 | 10 | 2011/10/04 | 2021/04/14 | 500.00 | 5.250% | 493.57 |
| 47 | 公司債 | EIBKOR 4.375 | 10 | 2011/10/04 | 2021/09/15 | 500.00 | 4.375% | 472.55 |
| 48 | 公司債 | LIFUNG 5.25 | 10 | 2011/10/04 | 2020/05/13 | 500.00 | 5.250% | 501.71 |
| 49 | 公司債 | QTELQD 4.75 | 10 | 2011/10/04 | 2021/02/16 | 1,000.00 | 4.750% | 978.44 |
| 50 | 公司債 | LIFUNG 5.25 | 10 | 2011/10/05 | 2020/05/13 | 500.00 | 5.250% | 495.23 |
| 51 | 公司債 | QTELQD 4.75 | 10 | 2011/10/05 | 2021/02/16 | 500.00 | 4.750% | 492.69 |
| 52 | 公司債 | POHANG 5.25 | 10 | 2011/10/05 | 2021/04/14 | 500.00 | 5.250% | 490.63 |
| 53 | 公司債 | LIFUNG 5.25 | 10 | 2011/10/06 | 2020/05/13 | 500.00 | 5.250% | 493.39 |
| 54 | 公司債 | QTELQD 4.75 | 10 | 2011/10/06 | 2021/02/16 | 500.00 | 4.750% | 496.93 |
| 55 | 公司債 | LIFUNG 5.25 | 10 | 2011/11/17 | 2020/05/13 | 500.00 | 5.250% | 519.29 |

備註：無活絡市場投資，採持有至到期日。