

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7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7月31日)
委託經營金額	350,000,000
委託經營月底資產淨值	419,019,814
累積總損益	69,019,814
委託經營總報酬率	19.72%

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	115,149,752	15,149,752	15.15%	7.65%
Alliance Bernstein	100,000,000	114,823,884	14,823,884	14.82%	7.21%
小計	200,000,000	229,973,636	29,973,636	14.99%	7.43%
全球股票型委託					
Wellington	150,000,000	189,046,178	39,046,178	26.03%	0.92%
合計	350,000,000	419,019,814	69,019,814	19.72%	4.39%

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(98/11/1-100/7/31)市場報酬率為22.42%，今年以來市場報酬率為3.38%。
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(98/11/1-100/7/31)市場報酬率為11%，今年以來市場報酬率為6.52%。

(二) 自99年7月1日至100年7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7月31日)
委託經營金額	79,276,014
委託經營月底資產淨值	102,276,098
累積總損益	23,000,084
委託經營總報酬率	29.01%

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	102,276,098	23,000,084	29.01%	0.93%

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(99/7/1-100/7/31)市場報酬率為28.15%，今年以來市場報酬率為3.38%。

(三) 自100年2月1日至100年7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7月31日)
委託經營金額	100,000,000
委託經營月底資產淨值	106,768,199
累積總損益	6,768,199
委託經營總報酬率	6.77%

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	106,768,199	6,768,199	6.77%	6.77%

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(100/2/1-100/7/31)市場報酬率為6.38%，今年以來(自委託日起算)市場報酬率為6.38%。

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7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7月31日)
委託經營金額	700,000,000
委託經營月底資產淨值	835,543,477
累積總損益	135,543,477
委託經營總報酬率	19.36%

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	118,881,110	-31,118,890	-20.75%	-3.03%
全球新興市場股票型委託					
Vontobel	150,000,000	193,616,203	43,616,203	29.08%	4.92%
小計	300,000,000	312,497,313	12,497,313	4.17%	1.74%
被動式全球債券型委託					
SS&A	200,000,000	265,141,828	65,141,828	32.57%	6.56%
Vanguard	200,000,000	257,904,336	57,904,336	28.95%	6.33%
小計	400,000,000	523,046,164	123,046,164	30.76%	6.45%
合計	700,000,000	835,543,477	135,543,477	19.36%	4.64%

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(96/10/1-100/7/31)市場報酬率為-9.16%，今年以來市場報酬率為3.43%。
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(96/10/1-100/7/31)市場報酬率為9.68%，今年以來市場報酬率為-1.12%。
5. 被動式全球債券型委託市場指標為Barclays Capital Global Treasury Index，同期間(96/10/1-100/7/31)市場報酬率為32.43%，(96/11/1-100/7/31)市場報酬率為30.30%，今年以來市場報酬率為6.56%。
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7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7月31日)
委託經營金額	93,287,948
委託經營月底資產淨值	98,306,226
累積總損益	5,018,278
委託經營總報酬率	5.38%

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
全球新興市場股票型委託					
Vontobel (II)	93,287,948	98,306,226	5,018,278	5.38%	5.38%

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(100/1/1-100/7/31)市場報酬率為-1.12%，今年以來市場報酬率為-1.12%。

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7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7月31日)
委託經營金額	600,000,000
委託經營月底資產淨值	678,076,126
累積總損益	78,076,126
委託經營總報酬率	13.01%

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	222,621,674	22,621,674	11.31%	5.96%
Wellington	200,000,000	225,939,378	25,939,378	12.97%	7.14%
PIMCO	200,000,000	229,515,074	29,515,074	14.76%	7.71%
合計	600,000,000	678,076,126	78,076,126	13.01%	6.94%

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(99/2/01-100/7/31)市場報酬率為11.98%，今年以來市場報酬率為6.53%。