

## 勞工保險基金第一梯次(續約)國外委託經營績效統計表

自98年11月1日至100年2月28日

(一)

單位：美元

	國外委託經營 第一梯次(續約) (98年11月1日~100年2月28日)
委託經營金額	350,000,000
委託經營月底資產淨值	412,551,908
累積總損益	62,551,908
委託經營總報酬率	17.87%

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>全球債券型委託</b>					
PIMCO	100,000,000	108,246,690	8,246,690	8.25%	1.19%
Alliance Bernstein	100,000,000	107,990,095	7,990,095	7.99%	0.83%
<b>小計</b>	<b>200,000,000</b>	<b>216,236,785</b>	<b>16,236,785</b>	<b>8.12%</b>	<b>1.01%</b>
<b>全球股票型委託</b>					
Wellington	150,000,000	196,315,123	46,315,123	30.88%	4.80%
<b>合計</b>	<b>350,000,000</b>	<b>412,551,908</b>	<b>62,551,908</b>	<b>17.87%</b>	<b>2.78%</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. 全球股票型委託市場指標為MSCI World Index，同期間(98/11/01-100/2/28)市場報酬率為25.33%，今年以來市場報酬率為5.84%。
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(98/11/01-100/2/28)市場報酬率為4.91%，今年以來市場報酬率為0.68%。

(二)

自99年7月1日至100年2月28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2月28日)
委託經營金額	79,276,014
委託經營月底資產淨值	106,239,673
累積總損益	26,963,659
委託經營總報酬率	34.01%

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	106,239,673	26,963,659	34.01%	4.84%

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(99/07/01-100/2/28)市場報酬率為31.20%，今年以來市場報酬率為5.84%。

(三)

自100年2月1日至100年2月28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2月28日)
委託經營金額	100,000,000
委託經營月底資產淨值	100,483,294
累積總損益	483,294
委託經營總報酬率	0.48%

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					
Alliance Bernstein (II)	100,000,000	100,483,294	483,294	0.48%	0.48%

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(100/02/01-100/02/28)市場報酬率為0.55%，今年以來(自委託日起算)市場報酬率為0.55%。

## 勞工保險基金第二梯次國外委託經營績效統計表

自96年10月1日至100年2月28日

(一)

單位：美元

第二梯次國外委託經營 (96年10月1日~100年2月28日)	
委託經營金額	700,000,000
委託經營月底資產淨值	792,428,882
累積總損益	92,428,882
委託經營總報酬率	13.20%

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	128,717,968	-21,282,032	-14.19%	4.99%
<b>全球新興市場股票型委託</b>					
Vontobel	150,000,000	170,764,045	20,764,045	13.84%	-7.46%
小計	<b>300,000,000</b>	<b>299,482,013</b>	<b>-517,987</b>	<b>-0.17%</b>	<b>-2.49%</b>
<b>被動式全球債券型委託</b>					
SSgA	200,000,000	249,722,740	49,722,740	24.86%	0.36%
Vanguard	200,000,000	243,224,130	43,224,130	21.61%	0.28%
小計	<b>400,000,000</b>	<b>492,946,869</b>	<b>92,946,869</b>	<b>23.24%</b>	<b>0.32%</b>
合計	<b>700,000,000</b>	<b>792,428,882</b>	<b>92,428,882</b>	<b>13.20%</b>	<b>-0.76%</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撥款日為96年11月1日。
3. 美國股票型委任市場指標為FTSE AW US，同期間(96/10/1-100/2/28)市場報酬率為-7.23%，今年以來市場報酬率為5.64%。
4. 全球新興市場股票型委任市場指標為FTSE AW Emerging Markets ex PRC ex Taiwan，同期間(96/10/1-100/2/28)市場報酬率為7.25%，今年以來市場報酬率為-3.31%。
5. 被動式全球債券型委任市場指標為Barclays Capital Global Treasury Index，同期間(96/10/1-100/2/28)市場報酬率為24.70%，(96/11/1-100/2/28)市場報酬率為22.69%，今年以來市場報酬率為0.34%。
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2月28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2月28日)
委託經營金額	93,287,948
委託經營月底資產淨值	87,142,735
累積總損益	-6,145,213
委託經營總報酬率	-6.59%

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	87,142,735	-6,145,213	-6.59%	-6.59%

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任市場指標為FTSE AW Emerging Markets ex PRC ex Taiwan, 同期間(100/1/1-100/2/28)市場報酬率為-3.31%，今年以來市場報酬率為-3.31%。

## 勞工保險基金第三梯次國外委託經營績效統計表

自99年2月1日至100年2月28日

單位：美元

第三梯次國外委託經營 (99年2月1日~100年2月28日)	
委託經營金額	600,000,000
委託經營月底資產淨值	640,325,231
累積總損益	40,325,231
委託經營總報酬率	6.72%

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
<b>全球債券型委託</b>					
Standish Mellon	200,000,000	212,368,954	12,368,954	6.18%	1.08%
Wellington	200,000,000	212,679,047	12,679,047	6.34%	0.86%
PIMCO	200,000,000	215,277,230	15,277,230	7.64%	1.03%
<b>合計</b>	<b>600,000,000</b>	<b>640,325,231</b>	<b>40,325,231</b>	<b>6.72%</b>	<b>0.99%</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(99/2/01-100/2/28)市場報酬率為5.92%，今年以來市場報酬率為0.77%。