

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1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1月31日)
委託經營金額	350,000,000
委託經營月底資產淨值	405,565,965
累積總損益	55,565,965
委託經營總報酬率	15.88%

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	107,401,284	7,401,284	7.40%	0.40%
Alliance Bernstein	100,000,000	107,272,760	7,272,760	7.27%	0.16%
小計	200,000,000	214,674,044	14,674,044	7.34%	0.28%
全球股票型委託					
Wellington	150,000,000	190,891,921	40,891,921	27.26%	1.91%
合計	350,000,000	405,565,965	55,565,965	15.88%	1.04%

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(98/11/01-100/1/31)市場報酬率為21.09%，今年以來市場報酬率為2.26%。
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(98/11/01-100/1/31)市場報酬率為4.33%，今年以來市場報酬率為0.12%。

(二)

自99年7月1日至100年1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1月31日)
委託經營金額	79,276,014
委託經營月底資產淨值	103,272,576
累積總損益	23,996,562
委託經營總報酬率	30.27%

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	103,272,576	23,996,562	30.27%	1.91%

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(99/07/01-100/1/31)市場報酬率為26.76%，今年以來市場報酬率為2.26%。

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1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1月31日)
委託經營金額	700,000,000
委託經營月底資產淨值	783,928,446
累積總損益	83,928,446
委託經營總報酬率	11.99%

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					
Jams	150,000,000	125,711,519	-24,288,481	-16.19%	2.54%
全球新興市場股票型委託					
Vontobel	150,000,000	167,265,176	17,265,176	11.51%	-9.36%
小計	300,000,000	292,976,695	-7,023,305	-2.34%	-4.61%
被動式全球債券型委託					
SSa	200,000,000	248,689,057	48,689,057	24.34%	-0.05%
Vanguard	200,000,000	242,262,694	42,262,694	21.13%	-0.12%
小計	400,000,000	490,951,751	90,951,751	22.74%	-0.09%
合計	700,000,000	783,928,446	83,928,446	11.99%	-1.83%

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. 美國股票型委託市場指標為FTSE AW US，同期間(96/10/1-100/1/31)市場報酬率為-10.17%，今年以來市場報酬率為2.29%。
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(96/10/1-100/1/31)市場報酬率為4.74%，今年以來市場報酬率為-5.57%。
5. 被動式全球債券型委託市場指標為Barclays Capital Global Treasury Index，同期間(96/10/1-100/1/31)市場報酬率為24.24%，(96/11/1-100/1/31)市場報酬率為22.23%，今年以來市場報酬率為-0.04%。
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1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1月31日)
委託經營金額	93,287,948
委託經營月底資產淨值	85,497,685
累積總損益	-7,790,263
委託經營總報酬率	-8.35%

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	85,497,685	-7,790,263	-8.35%	-8.35%

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(100/1/1-100/1/31)市場報酬率為-5.57%，今年以來市場報酬率為-5.57%。

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1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1月31日)
委託經營金額	600,000,000
委託經營月底資產淨值	635,647,973
累積總損益	35,647,973
委託經營總報酬率	5.94%

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	210,688,116	10,688,116	5.34%	0.28%
Wellington	200,000,000	211,524,868	11,524,868	5.76%	0.31%
PIMCO	200,000,000	213,434,989	13,434,989	6.72%	0.16%
合計	600,000,000	635,647,973	35,647,973	5.94%	0.25%

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(99/2/01-100/1/31)市場報酬率為5.30%，今年以來市場報酬率為0.18%。