

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10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10月31日)
委託經營金額	350,000,000
委託經營月底資產淨值	409,498,501
累積總損益	59,498,501
委託經營總報酬率	17.00%

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					
PLMCO	100,000,000	115,569,968	15,569,968	15.57%	8.04%
Alliance Bernstein	100,000,000	115,386,670	15,386,670	15.39%	7.74%
小計	200,000,000	230,956,638	30,956,638	15.48%	7.89%
全球股票型委託					
Wellington	150,000,000	178,541,862	28,541,862	19.03%	-4.68%
合計	350,000,000	409,498,501	59,498,501	17.00%	2.02%

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(98/11/1-100/10/31)市場報酬率為14.72%，今年以來市場報酬率為-3.12%。
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(98/11/1-100/10/31)市場報酬率為11.34%，今年以來市場報酬率為6.85%。

(二) 自99年7月1日至100年10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10月31日)
委託經營金額	79,276,014
委託經營月底資產淨值	96,614,866
累積總損益	17,338,851
委託經營總報酬率	21.87%

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
全球股票型委託					
Wellington (II)	79,276,014	96,614,866	17,338,851	21.87%	-4.66%

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(99/7/1-100/10/31)市場報酬率為20.09%，今年以來市場報酬率為-3.12%。

(三) 自100年2月1日至100年10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10月31日)
委託經營金額	100,000,000
委託經營月底資產淨值	107,272,707
累積總損益	7,272,707
委託經營總報酬率	7.27%

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
全球債券型委託					
Alliance Bernstein (II)	100,000,000	107,272,707	7,272,707	7.27%	7.27%

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(100/2/1-100/10/31)市場報酬率為6.71%，今年以來(自委託日起算)市場報酬率為6.71%。

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10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10月31日)
委託經營金額	700,000,000
委託經營月底資產淨值	821,317,441
累積總損益	121,317,441
委託經營總報酬率	17.33%

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	111,659,830	-38,340,170	-25.56%	-8.92%
全球新興市場股票型委託					
Vontobel	150,000,000	184,363,208	34,363,208	22.91%	-0.10%
小計	300,000,000	296,023,038	-3,976,962	-1.33%	-3.62%
被動式全球債券型委託					
SSGA	200,000,000	266,287,127	66,287,127	33.14%	7.02%
Vanguard	200,000,000	259,007,276	59,007,276	29.50%	6.78%
小計	400,000,000	525,294,403	125,294,403	31.32%	6.90%
合計	700,000,000	821,317,441	121,317,441	17.33%	2.86%

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(96/10/1-100/10/31)市場報酬率為-11.64%，今年以來市場報酬率為0.61%。
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(96/10/1-100/10/31)市場報酬率為-2.31%，今年以來市場報酬率為-11.93%。
5. 被動式全球債券型委託市場指標為Barclays Capital Global Treasury Index，同期間(96/10/1-100/10/31)市場報酬率為33.00%，(96/11/1-100/10/31)市場報酬率為30.85%，今年以來市場報酬率為7.01%。
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10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10月31日)
委託經營金額	93,287,948
委託經營月底資產淨值	93,573,223
累積總損益	285,275
委託經營總報酬率	0.31%

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	93,573,223	285,275	0.31%	0.31%

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(100/1/1-100/10/31)市場報酬率為-11.93%，今年以來市場報酬率為-11.93%。

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10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10月31日)
委託經營金額	600,000,000
委託經營月底資產淨值	680,329,375
累積總損益	80,329,375
委託經營總報酬率	13.39%

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	222,551,127	22,551,127	11.28%	5.93%
Wellington	200,000,000	227,604,227	27,604,227	13.80%	7.93%
PLMCO	200,000,000	230,174,021	30,174,021	15.09%	8.02%
合計	600,000,000	680,329,375	80,329,375	13.39%	7.30%

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(99/2/01-100/10/31)市場報酬率為12.26%，今年以來市場報酬率為6.80%。