

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9月30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9月30日)
委託經營金額	350,000,000
委託經營月底資產淨值	388,170,010
累積總損益	38,170,010
委託經營總報酬率	10.91%

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	113,399,979	13,399,979	13.40%	6.01%
Alliance Bernstein	100,000,000	113,961,240	13,961,240	13.96%	6.41%
小計	200,000,000	227,361,219	27,361,219	13.68%	6.21%
全球股票型委託					
Wellington	150,000,000	150,808,791	10,808,791	7.21%	-14.15%
合計	350,000,000	388,170,010	38,170,010	10.91%	-3.28%

- 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(98/11/1-100/9/30)市場報酬率為3.97%，今年以來市場報酬率為-12.20%。
 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(98/11/1-100/9/30)市場報酬率為10.06%，今年以來市場報酬率為5.61%。

(二) 自99年7月1日至100年9月30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9月30日)
委託經營金額	79,276,014
委託經營月底資產淨值	87,022,791
累積總損益	7,746,777
委託經營總報酬率	9.77%

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
全球股票型委託					
Wellington (II)	79,276,014	87,022,791	7,746,777	9.77%	-14.12%

- 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(99/7/1-100/9/30)市場報酬率為8.83%，今年以來市場報酬率為-12.20%。

(三) 自100年2月1日至100年9月30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9月30日)
委託經營金額	100,000,000
委託經營月底資產淨值	105,983,235
累積總損益	5,983,235
委託經營總報酬率	5.98%

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	105,983,235	5,983,235	5.98%	5.98%

- 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(100/2/1-100/9/30)市場報酬率為5.48%，今年以來(自委託日起算)市場報酬率為5.48%。

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9月30日

單位：美元

	第二梯次國外委託經營 (96年10月1日-100年9月30日)
委託經營金額	700,000,000
委託經營月底資產淨值	790,737,475
累積總損益	90,737,475
委託經營總報酬率	12.96%

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	101,207,468	-48,792,532	-32.53%	-17.45%
全球新興市場股票型委託					
Vontobel	150,000,000	167,627,047	17,627,047	11.75%	-9.16%
小計	300,000,000	268,834,515	-31,165,485	-10.39%	-12.47%
被動式全球債券型委託					
SSgA	200,000,000	264,520,521	64,520,521	32.26%	6.31%
Vanguard	200,000,000	257,382,439	57,382,439	28.69%	6.11%
小計	400,000,000	521,902,960	121,902,960	30.48%	6.21%
合計	700,000,000	790,737,475	90,737,475	12.96%	-0.97%

- 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(96/10/1-100/9/30)市場報酬率為-20.33%，今年以來市場報酬率為-9.29%。
 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(96/10/1-100/9/30)市場報酬率為-13.33%，今年以來市場報酬率為-21.87%。
 5. 被動式全球債券型委託市場指標為Barclays Capital Global Treasury Index，同期間(96/10/1-100/9/30)市場報酬率為32.12%，(96/11/1-100/9/30)市場報酬率為29.99%，今年以來市場報酬率為6.31%。
 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9月30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9月30日)
委託經營金額	93,287,948
委託經營月底資產淨值	85,074,484
累積總損益	-8,213,464
委託經營總報酬率	-8.80%

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	85,074,484	-8,213,464	-8.80%	-8.80%

- 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(100/1/1-100/9/30)市場報酬率為-21.87%，今年以來市場報酬率為-21.87%。

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9月30日

單位：美元

	第三梯次國外委託經營 (99年2月1日-100年9月30日)
委託經營金額	600,000,000
委託經營月底資產淨值	670,312,631
累積總損益	70,312,631
委託經營總報酬率	11.72%

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					
Standish Mellon	200,000,000	220,463,019	20,463,019	10.23%	4.94%
Wellington	200,000,000	224,255,583	24,255,583	12.13%	6.35%
PIMCO	200,000,000	225,594,029	25,594,029	12.80%	5.87%
合計	600,000,000	670,312,631	70,312,631	11.72%	5.72%

- 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(99/2/01-100/9/30)市場報酬率為10.78%，今年以來市場報酬率為5.40%。