

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4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4月30日)
委託經營金額	350,000,000
委託經營月底資產淨值	425,142,092
累積總損益	75,142,092
委託經營總報酬率	21.47%

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	111,951,259	11,951,259	11.95%	4.66%
Alliance Bernstein	100,000,000	111,928,086	11,928,086	11.93%	4.51%
<b>小計</b>	<b>200,000,000</b>	<b>223,879,345</b>	<b>23,879,345</b>	<b>11.94%</b>	<b>4.58%</b>
<b>全球股票型委託</b>					
Wellington	150,000,000	201,262,747	51,262,747	34.18%	7.45%
<b>合計</b>	<b>350,000,000</b>	<b>425,142,092</b>	<b>75,142,092</b>	<b>21.47%</b>	<b>5.92%</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(98/11/1-100/4/30)市場報酬率為29.37%，今年以來市場報酬率為9.25%。
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(98/11/1-100/4/30)市場報酬率為8.64%，今年以來市場報酬率為4.26%。

(二) 自99年7月1日至100年4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4月30日)
委託經營金額	79,276,014
委託經營月底資產淨值	108,885,131
累積總損益	29,609,116
委託經營總報酬率	37.35%

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
<b>全球股票型委託</b>					
Wellington (II)	79,276,014	108,885,131	29,609,116	37.35%	7.45%

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(99/7/1-100/4/30)市場報酬率為35.42%，今年以來市場報酬率為9.25%。

(三) 自100年2月1日至100年4月30日

單位：美元

	碼)(100年2月1日-100年4月30日)
委託經營金額	100,000,000
委託經營月底資產淨值	104,091,890
累積總損益	4,091,890
委託經營總報酬率	4.09%

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>					
Alliance Bernstein (II)	100,000,000	104,091,890	4,091,890	4.09%	4.09%

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(100/2/1-100/4/30)市場報酬率為4.13%，今年以來(自委託日起算)市場報酬率為4.13%。

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4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4月30日)
委託經營金額	700,000,000
委託經營月底資產淨值	832,643,001
累積總損益	132,643,001
委託經營總報酬率	18.95%

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	131,498,445	-18,501,555	-12.33%	7.26%
<b>全球新興市場股票型委託</b>					
Vontobel	150,000,000	190,440,754	40,440,754	26.96%	3.20%
<b>小計</b>	<b>300,000,000</b>	<b>321,939,199</b>	<b>21,939,199</b>	<b>7.31%</b>	<b>4.82%</b>
<b>被動式全球債券型委託</b>					
SSgA	200,000,000	258,818,612	58,818,612	29.41%	4.02%
Vanguard	200,000,000	251,885,190	51,885,190	25.94%	3.85%
<b>小計</b>	<b>400,000,000</b>	<b>510,703,802</b>	<b>110,703,802</b>	<b>27.68%</b>	<b>3.93%</b>
<b>合計</b>	<b>700,000,000</b>	<b>832,643,001</b>	<b>132,643,001</b>	<b>18.95%</b>	<b>4.27%</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(96/10/1-100/4/30)市場報酬率為-4.46%，今年以來市場報酬率為8.79%。
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(96/10/1-100/4/30)市場報酬率為14.94%，今年以來市場報酬率為3.62%。
5. 被動式全球債券型委託市場指標為Barclays Capital Global Treasury Index，同期間(96/10/1-100/4/30)市場報酬率為29.32%，(96/11/1-100/4/30)市場報酬率為27.23%，今年以來市場報酬率為4.05%。
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4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4月30日)
委託經營金額	93,287,948
委託經營月底資產淨值	96,903,002
累積總損益	3,615,054
委託經營總報酬率	3.88%

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
<b>全球新興市場股票型委託</b>					
Vontobel (II)	93,287,948	96,903,002	3,615,054	3.88%	3.88%

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(100/1/1-100/4/30)市場報酬率為3.62%，今年以來市場報酬率為3.62%。

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4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4月30日)
委託經營金額	600,000,000
委託經營月底資產淨值	663,479,061
累積總損益	63,479,061
委託經營總報酬率	10.58%

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	219,908,137	19,908,137	9.95%	4.67%
Wellington	200,000,000	220,672,640	20,672,640	10.34%	4.65%
PIMCO	200,000,000	222,898,285	22,898,285	11.45%	4.60%
<b>合計</b>	<b>600,000,000</b>	<b>663,479,061</b>	<b>63,479,061</b>	<b>10.58%</b>	<b>4.64%</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(99/2/01-100/4/30)市場報酬率為9.72%，今年以來市場報酬率為4.38%。