

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5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5月31日)
委託經營金額	350,000,000
委託經營月底資產淨值	421,861,406
累積總損益	71,861,406
委託經營總報酬率	20.53%

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	112,000,861	12,000,861	12.00%	4.70%
Alliance Bernstein	100,000,000	112,058,983	12,058,983	12.06%	4.63%
小計	200,000,000	224,059,844	24,059,844	12.03%	4.67%
全球股票型委託					
Wellington	150,000,000	197,801,562	47,801,562	31.87%	5.60%
合計	350,000,000	421,861,406	71,861,406	20.53%	5.10%

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(98/11/1-100/5/31)市場報酬率為26.69%，今年以來市場報酬率為6.98%。
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(98/11/1-100/5/31)市場報酬率為8.57%，今年以來市場報酬率為4.19%。

(二) 自99年7月1日至100年5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5月31日)
委託經營金額	79,276,014
委託經營月底資產淨值	106,999,901
累積總損益	27,723,887
委託經營總報酬率	34.97%

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	106,999,901	27,723,887	34.97%	5.59%

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(99/7/1-100/5/31)市場報酬率為32.61%，今年以來市場報酬率為6.98%。

(三) 自100年2月1日至100年5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5月31日)
委託經營金額	100,000,000
委託經營月底資產淨值	104,198,837
累積總損益	4,198,837
委託經營總報酬率	4.20%

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
全球債券型委託					
Alliance Bernstein (II)	100,000,000	104,198,837	4,198,837	4.20%	4.20%

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(100/2/1-100/5/31)市場報酬率為4.06%，今年以來(自委託日起算)市場報酬率為4.06%。

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5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5月31日)
委託經營金額	700,000,000
委託經營月底資產淨值	827,467,545
累積總損益	127,467,545
委託經營總報酬率	18.21%

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	127,524,097	-22,475,903	-14.98%	4.02%
全球新興市場股票型委託					
Vontobel	150,000,000	190,120,720	40,120,720	26.75%	3.02%
小計	300,000,000	317,644,817	17,644,817	5.88%	3.42%
被動式全球債券型委託					
SS&A	200,000,000	258,363,793	58,363,793	29.18%	3.84%
Vanguard	200,000,000	251,458,935	51,458,935	25.73%	3.67%
小計	400,000,000	509,822,728	109,822,728	27.46%	3.75%
合計	700,000,000	827,467,545	127,467,545	18.21%	3.63%

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(96/10/1-100/5/31)市場報酬率為-5.57%，今年以來市場報酬率為7.52%。
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(96/10/1-100/5/31)市場報酬率為10.72%，今年以來市場報酬率為-0.18%。
5. 被動式全球債券型委託市場指標為Barclays Capital Global Treasury Index，同期間(96/10/1-100/5/31)市場報酬率為29.08%，(96/11/1-100/5/31)市場報酬率為26.99%，今年以來市場報酬率為3.86%。
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5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5月31日)
委託經營金額	93,287,948
委託經營月底資產淨值	96,684,336
累積總損益	3,396,388
委託經營總報酬率	3.64%

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	96,684,336	3,396,388	3.64%	3.64%

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(100/1/1-100/5/31)市場報酬率為-0.18%，今年以來市場報酬率為-0.18%。

勞工保險基金第三梯次國外委託經營績效統計表

(一) 自99年2月1日至100年5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5月31日)
委託經營金額	600,000,000
委託經營月底資產淨值	663,481,640
累積總損益	63,481,640
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
全球債券型委託					
Standish Mellon	200,000,000	219,504,547	19,504,547	9.75%	4.48%
Wellington	200,000,000	220,617,863	20,617,863	10.31%	4.62%
PIMCO	200,000,000	223,359,230	23,359,230	11.68%	4.82%
合計	600,000,000	663,481,640	63,481,640	10.58%	4.64%

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(99/2/01-100/5/31)市場報酬率為9.63%，今年以來市場報酬率為4.30%。