

F4 上頁 F5 下頁 F10 重清

目前時間 105/11/07 11:32:06

投資管理處 <<黃惟怡>>

查詢 · 證券投資 - 基金 ·

下單輸入

投資交易查詢

交易日期	105/05/11	本日申請:	0
查詢	輸入交易	本日贖回:	28,906,883
		增/刪	上傳

基金交易明細表

投資組合績效表

申請	贖回	轉申請
下單日期序次	105/05/11 1	1-區隔資產(KH)
投資名稱	台新證券投資信託股份有限公司	陳明志
基金名稱	TANAIUB T台新北美收益基金(配息) 序號: 1	
會計分類	不動產證券化型-AFS	<input checked="" type="checkbox"/> 事先核准投資
目前剩餘單位	Y-全贖	投資編號
贖回單位	1,735,107.0000	20160511V002
預估淨值	105/05/12 16.6600	
預估贖回金額	28,906,883	
成交日	105/05/12	交割日 105/05/18
是否用印 <input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否 傳真 <input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否 交易申請書 <input type="checkbox"/> 公告 <input checked="" type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否 註解說明 1.交易申請書於當日下午3:30前傳真並電話確認 匯出帳戶 (基金連結之匯款帳戶) <input checked="" type="checkbox"/> 對帳單傳真 TGO((基金連結之匯款帳戶) 匯入帳戶 72000907 彰銀總部活-6905550 <input type="checkbox"/> 對帳單正本		

投資額度調整

退出本畫面

F4 上單 F5 下單 F10 重覆

目前時間 105/11/07 11:33:12

投資管理處 &lt;&lt;黃惟怡&gt;&gt;

證券投資-基金

下單輸入

基金交易書

交易日期 104/05/22 本日申請: 20,000,000  
查詢 輸入交易 本日贖回: 0

增 刪 上 傳

基金交易明細表

投資組合績效表

申請 贖回 轉申請

下單日期序次 104/05/22 1

1-區隔資產(KH)

F3 新增

投資名稱 野村證券投資信託股份有限公司

陳明志

F7 刪除

基金名稱 IC01 野村優質

序號 1

F9 存檔

會計分類 國內股票型-AFS

☒ 事先核准投資

台幣申請金額

20,000,000

投資編號

投資編號

成交日 104/05/22

交割日 104/05/22

20150522V002

預估淨值 104/05/22

31.9000

預估交易單位

626,959.2480

投資額度調整

是否用印 ☐ 是 ☐ 否 傳真 ☐ 是 ☐ 否是否用印 ☐ 是 ☐ 否 傳真 ☐ 是 ☐ 否交易申請書 ☐ 公告 ☐ 是 ☐ 否公告 ☐ 是 ☐ 否

註解說明

交易申請書傳真後，請電話確認，並於當日下午3:30前將款項匯至上述指定帳號

☒ 下單確認 SBM☐ 下單確認

匯出帳戶

72000907 彭淑純 06-6905550

☒ 對帳單傳真 SBM☐ 對帳單傳真

匯入帳戶 (基金連結之匯款帳戶)

☐ 對帳單正本

(基金連結之匯款帳戶)

☐ 對帳單正本

退出不當面

F4 上頁 F5 下頁 F10 重灌

目前時間 105/11/07 11:47:15

投資管理處<<黃惟怡>>

查詢 · 證券投資-基金 ·

下單輸入

投資交易畫

交易日期: 105/09/08 本日申購: 1,600,000,000  
查詢 輸入交易 本日贖回: 163,500,000

增開 上傳

基金交易明細表

投資組合績效表

申請	贖回	轉申購
F3 新增		
F7 刪除		
F9 存檔		
投資額度調整		
下單日期序次	105/09/08 1	1-區隔資產(KH)
投資名稱	復華證券投資信託股份有限公司	陳明志
基金名稱	FUHTTA 復華東大基金	序號 1
會計分類	國內股票型-AFS	<input checked="" type="checkbox"/> 事先核准投資
目前剩餘單位	A-全額贖	投資編號
預估贖回單位	4,638,297.0000	投資編號
預估淨值	105/09/09 35.2500	
贖回金額	163,500,000	
成交日	105/09/09	交割日 105/09/13
是否用印 <input checked="" type="checkbox"/> 是 <input type="checkbox"/> 否 傳真 <input checked="" type="checkbox"/> 是 <input type="checkbox"/> 否		
買回申請書,買回通 公告 <input checked="" type="checkbox"/> 是 <input type="checkbox"/> 否		
註解說明 請於9月8日前傳真用印文件至 8772-0588,傳真後並請電話		
<input checked="" type="checkbox"/> 下單確認 TGO		
匯出帳戶 (基金連結之匯款帳戶) <input checked="" type="checkbox"/> 對帳單傳真 TGO (基金連結之匯款帳戶)		
匯入帳戶 72000907 彰銀總部活-6905550 <input type="checkbox"/> 對帳單正		

退出本畫面

全球人壽投資處下單指示書(KH)

下單日：105年11月04日      序次：1

頁 數：3 — 1  
金額單位：仟元

總表：台幣計價

帳戶別	核定額度 (1)	投資金額 (2)	持股比重 (3)=(2)/(1)	買進	賣出		
				預計總市值(4)	預計總市值(5)	占庫存比率%(6)	預計損益(7)
KFE02 KH備供-FE2	4,725,000	2,956,247	62.57%	94,002	148,649	5.03	42
合計	4,725,000	2,956,247		94,002	148,649		42

幣別HKD      匯率：4.06      (20161103)

帳戶別	投資金額 (原幣)	投資金額 (台幣)	買進	賣出		
			預計總市值(4)	預計總市值(5)	占庫存比率%(6)	預計損益(7)
KFE02 KH備供-FE2	306,282	1,242,984				
合計	306,282	1,242,984				

幣別USD      匯率：31.46      (20161103)

帳戶別	投資金額 (原幣)	投資金額 (台幣)	買進	賣出		
			預計總市值(4)	預計總市值(5)	占庫存比率%(6)	預計損益(7)
KFE02 KH備供-FE2	54,458	1,713,263	2,988	4,725	8.68	1
合計	54,458	1,713,263	2,988	4,725		1

單一個股建議買/賣反向交易      ：無  
巨額交易      ：無

新買進個股

股票名稱	帳戶別	價格	股數	STOCK POOL 個股	裁決	可	不可	說明
OIH US VanEck Vectors石油服 務ETF	KFE02 KH備供-FE2	28.00 以下	21,400	是				

Approved by : \_\_\_\_\_

Prepared by : \_\_\_\_\_

全球人壽投資處下單指示書(KH)

下單日：105年11月04日      序次：1

頁 數：3    -    2  
金額單位：仟元

總表

USD計價部位

買進個股	收盤價	成本	預計市價	漲停價	預計股數	總市值(原幣)	總市值(台幣)	限額檢核 SIL	限額檢核 SIL上限	佔發行公 司股本%	佔發行公 司股本上限%	(含全委)佔發 行公司股本%	是否為STOCK POOL標的	是否為關 係人交易
GLL US ProShares二倍 放空黃金ETF	71.40	98.29	73.00 以下	71.40	5,400	394	12,395	0.45億	上限 10.00億	2.628%	上限 5.00%	2.628%	是	否
JNK US SPDR彭博巴克 萊高收益債券ETF	35.76	36.11	35.85 以下	35.76	14,000	502	15,793	0.82億	上限 30.00億	0.024%	上限 5.00%	0.024%	是	否
Oil US VanEck Vectors石油服務ETF	27.90		28.00 以下	27.90	21,400	599	18,845	0.19億	上限 10.00億	0.062%	上限 5.00%	0.062%	是	否
VNQ US 先鋒不動產投 資信託ETF	78.20	80.32	79.00 以下	78.20	8,800	695	21,865	0.67億	上限 10.00億	0.007%	上限 5.00%	0.007%	是	否
XLV US 思柏達健康護 理指數基金	66.02	69.16	66.50 以下	66.02	12,000	798	25,105	0.70億	上限 10.00億	0.020%	上限 5.00%	0.020%	是	否
合計						2,988	94,002							

USD計價部位

賣出個股	持有股數	成本	收盤價	預計市價	跌停價	預計股數	佔庫存比率%	總市值(原幣)	總市值(台幣)	預計損益(台幣)
DXD US ProShares二倍 放空道瓊30指數E	499,225	17.32	17.50	17.50 以上	17.50	160,000	32.05	2,800	88,088	922
SDS US ProShares UltraShort標普500	863,400	17.93	17.58	17.50 以上	17.58	110,000	12.74	1,925	60,561	-1,486
合計								4,725	148,649	-564

Approved by : \_\_\_\_\_

Prepared by : \_\_\_\_\_

全球人壽投資處下單指示書(KH)

下單日：105年11月04日      序次：1

頁 數：3    —    3  
金額單位：仟元

KFE02      KH備供-FE2      額度：4,725,000.00

USD計價部位

買進個股	收盤價	成本	預計市價	漲停價	預計股數	總市值(原幣)	總市值(台幣)	限額檢核 SIL	限額檢核 SIL上限	佔發行公司 股本%	佔發行公司 股本上限%	(含全委)佔發 行公司股本%	是否為STOCK POOL標的	是否為關 係人交易
GLL US ProShares二倍 放空黃金ETF	71.40	98.29	73.00 以下	71.40	5,400	394	12,395	0.45億	上限 10.00億	2.628%	上限 5.00%	2.628%	是	否
JNK US SPDR彭博巴克 萊高收益債券ETF	35.76	36.11	35.85 以下	35.76	14,000	502	15,793	0.82億	上限 30.00億	0.024%	上限 5.00%	0.024%	是	否
OIH US VanEck Vectors石油服務ETF	27.90		28.00 以下	27.90	21,400	599	18,845	0.19億	上限 10.00億	0.062%	上限 5.00%	0.062%	是	否
VNQ US 先鋒不動產投 資信託ETF	78.20	80.32	79.00 以下	78.20	8,800	695	21,865	0.67億	上限 10.00億	0.007%	上限 5.00%	0.007%	是	否
XLV US 思柏達健康護 理指數基金	66.02	69.16	66.50 以下	66.02	12,000	798	25,105	0.70億	上限 10.00億	0.020%	上限 5.00%	0.020%	是	否
合計						2,988	94,002							

USD計價部位

賣出個股	持有股數	成本	收盤價	預計市價	跌停價	預計股數	佔庫存比率%	總市值(原幣)	總市值(台幣)	預計損益(台幣)
DXD US ProShares二倍 放空道瓊30指數E	499,225	17.32	17.50	17.50 以上	17.50	160,000	32.05	2,800	88,088	922
SDS US ProShares UltraShort標普500	511,100	17.75	17.58	17.50 以上	17.58	110,000	21.52	1,925	60,561	-880
合計								4,725	148,649	42

Approved by：\_\_\_\_\_

Prepared by：\_\_\_\_\_

決策下單 決策狀態 下單指示書

可投資投組: KH KFE01: KH備供-FE1 Tom Ho 核定額度: 4,725,000,000 確定投組 清除

新增 刪除 檢查

尚可投資金額: 4,893,549,849

投組: KH KFE01: KH備供-FE1 Tom Ho 批次序號: 1

序號	股票	幣別	類型	買賣	價格別	價格	決策股數	庫存可賣股數	庫存股數	在途股數	價格日期	下單狀況	檢查訊息
1	<input type="checkbox"/> SDS US ProShares UltraShort標普500	USD	一般	B	以下	16.80		352,300	352,300	0	2016-09-06		

類股	股票代號	股票名稱	股數	總成本	成本價	收盤價	帳面損益	損益比	含息 損益比	台幣成本	本日 漲跌幅	估業主 損益百 分比	說明
HKD													
						105/11/04							
	2822 HK	南方富時中國 A50 ETF	15,000,000	174,845,359.71	11.66	11.54	-1,800,000.00	-1.03%	-1.03%	701,969,150	- .17%	.90%	
	2823 HK	iShares 安碩富時A50中國指數E	8,220,100	91,926,041.37	11.18	11.18	0.00	.00%	.00%	369,063,291	.00%	.30%	
	3188 HK	華夏基金ETF系列-華夏滬深300	978,800	39,510,431.42	40.37	39.10	-1,243,076.00	-3.15%	-3.15%	158,626,480	- .51%	.38%	
	小計	4.06(105/11/04)		306,281,832.50			-3,043,076.00			1,229,658,921			
USD													
						105/11/04							
	*DXD US	ProShares二倍放空道瓊30指數E	339,225	5,874,302.48	17.32	17.56	81,414.00	1.39%	1.44%	183,884,801	.34%	2.25%	
	FXI US	iShares中國大型股ETF	61,400	2,773,485.75	45.17	36.24	-548,302.00	-19.77%	-19.77%	86,819,256	- .88%	.06%	
	GLD US	SPDR金ETF	17,100	2,098,250.77	122.70	124.39	28,899.00	1.38%	1.38%	65,916,457	.07%	.01%	
	*GLL US	ProShares二倍放空黃金ETF	19,696	1,790,743.44	90.92	71.24	-387,617.00	-21.65%	-21.65%	56,117,264	- .22%	2.63%	
	HEDJ US	智慧樹歐洲股票型對沖基金	130,850	7,852,264.70	60.01	52.20	-1,021,939.00	-13.01%	-13.01%	245,801,798	-1.12%	.08%	
	*JNK US	SPDR彭博巴克萊高收益債券ETF	73,245	2,641,195.59	36.06	35.82	-17,579.00	-.67%	-.67%	83,008,824	.17%	.02%	
	*OIH US	VanEck Vectors石油服務ETF	21,400	595,548.00	27.83	27.70	-2,782.00	-.47%	-.47%	18,736,953	- .72%	.06%	
	PSQ US	ProShares一倍放空那斯達克100	98,418	5,269,801.36	53.55	49.64	-385,090.00	-7.31%	-7.31%	165,019,728	.38%	1.29%	
	*SDS US	ProShares UltraShort標普500	401,100	7,121,269.62	17.75	17.63	-48,132.00	-.68%	-.68%	222,918,861	.28%	.34%	
	TBF US	ProShares放空20年以上公債	288,800	7,331,855.82	25.39	21.82	-1,031,016.00	-14.06%	-14.06%	229,511,282	-1.00%	.86%	
	USO US	美國石油基金有限合夥	94,000	953,886.34	10.15	9.98	-15,980.00	-1.68%	-1.67%	30,019,865	- .99%	.03%	
	*VNQ US	先鋒不動產投資信託ETF	27,104	2,162,522.82	79.79	78.82	-26,291.00	-1.22%	-1.22%	68,189,089	.79%	.01%	
	XLE US	能源精選行業SPDR基金	55,979	3,964,928.01	70.83	67.77	-171,296.00	-4.32%	-4.32%	124,115,317	- .54%	.03%	
	*XLV US	思柏達健康護理指數基金	22,400	1,546,573.14	69.04	66.48	-57,344.00	-3.71%	-3.71%	48,674,211	.70%	.01%	
	小計	31.46(105/11/04)		51,976,627.84			-3,603,055.00			1,628,733,705			



## \*\*\* 105年11月04日國外股票庫存表 \*\*\*

總計(台幣)	總成本:	2,858,392,626	帳面損益:	-105,743,411	本日淨值漲跌:	-6,527,187	報酬率:	0.59%
交易日匯率	尚可投資金額:	2,017,732,805	總市值:	2,752,649,215	本日淨值漲跌幅:	-0.14%	累計報酬率:	0.59%
	持股比重:	57.80%	已實現損益:	124,090,944	當年已實現損益:	-78,942,676		
			總損益:	18,347,533	當月已實現損益:	1,062,548		
			當年配息總額:	18,642,247	當周已實現損益:	1,062,548		
			不含當年配息總額:	8,392,240	當月配息總額:		含息報酬率:	1.46%
			含息損益:	45,382,020	當周配息總額:		當年含息報酬率:	2.11%
			當年含息損益:	99,787,129	當年已實現+配息:	-60,300,429	當月含息報酬率:	0.28%
			當月含息損益:	13,348,625	當月已實現+配息:	1,062,548	當周含息報酬率:	0.32%
			當周含息損益:	15,319,290	當周已實現+配息:	1,062,548		

總計(台幣)	總成本:	2,858,392,626	帳面損益:	-124,867,951	本日淨值漲跌:	-5,761,065	報酬率:	1.76%
平均匯率	尚可投資金額:	2,073,228,109	總市值:	2,733,524,675	本日淨值漲跌幅:	-0.12%	累計報酬率:	1.76%
	持股比重:	56.97%	已實現損益:	179,679,220	當年已實現損益:	-21,040,092		
			總損益:	54,811,269	當月已實現損益:	-1,347,995		
			當年配息總額:	18,668,030	當周已實現損益:	-1,347,995		
			不含當年配息總額:	8,273,485	當月配息總額:		含息報酬率:	2.63%
			含息損益:	81,752,784	當周配息總額:		當年含息報酬率:	2.98%
			當年含息損益:	140,915,128	當年已實現+配息:	-2,372,062	當月含息報酬率:	0.49%
			當月含息損益:	22,934,599	當月已實現+配息:	-1,347,995	當周含息報酬率:	0.64%
			當周含息損益:	30,120,885	當周已實現+配息:	-1,347,995		

## 資產配置

投資區域	權重	金額(台幣)
Commodity	2.96%	140,581,322
Equity	49.15%	2,331,264,294
Fixed Income	5.92%	280,803,598

## 產業/區域配置

產業	權重	金額(台幣)	產業	權重	金額(台幣)
	0.68%	18,649,867			
China	47.25%	1,300,713,845			
European Region	7.81%	214,895,052			
Global	4.03%	111,066,472			
U.S.	40.23%	1,107,323,978			

今年配息明細		
股票代號	股票名稱	今年累積(台幣)
TLT US	iShares 20+年公債ETF	127,740
FXI US	iShares中國大型股ETF	715,524
JNK US	SPDR巴克萊高收益債券ETF	4,393,082
EPI US	WisdomTree印度收益基金	346,400
2318 HK	中國平安	801,612
XLV US	思柏達健康護理指數基金	41,659
NLE US	能源精選行業SPDR基金	2,174,909
HEDJ US	智慧樹歐洲股票型對沖基金	4,572,172
3188 HK	華夏基金ETF系列一華夏滬深300	7,151,571

註1：《\*》表今日有交易個股。

註2：『授權額度』調整明細

102/07/18	核定額度：0
102/07/19	核定額度：1,000,000,000
103/06/16	核定額度：500,000,000
103/12/22	核定額度：4,725,000,000

起算日期	2013/12/31
截止日期	2015/11/4
贷款科目(一级科目)	130501

指标		0.0%~0.1% (N=100000)	0.1%~0.2%
收益	Daily	-0.06%	-0.65%
	WTD	-0.51%	-1.91%
	MTD	-0.51%	-1.91%
	YTD	-0.06%	-4.77%
	期间收益率	0.66%	4.24%
	超额收益率	-3.56%	0.00%
风险	波动率(年化)	4.63%	12.74%
	$\beta$	0.29	1.00
CAPM模型参数	$r_f$	-1.53%	0.00%
	$K_f$	1.36%	1.36%
	$\beta R_m$	1.23%	4.24%
主动投资策略性能指标	Information Ratio	-77.35%	0.00%
风险调整绩效指标	Sharpe ratio	-15.14%	22.61%
	Treynor rate	-2.42%	2.88%

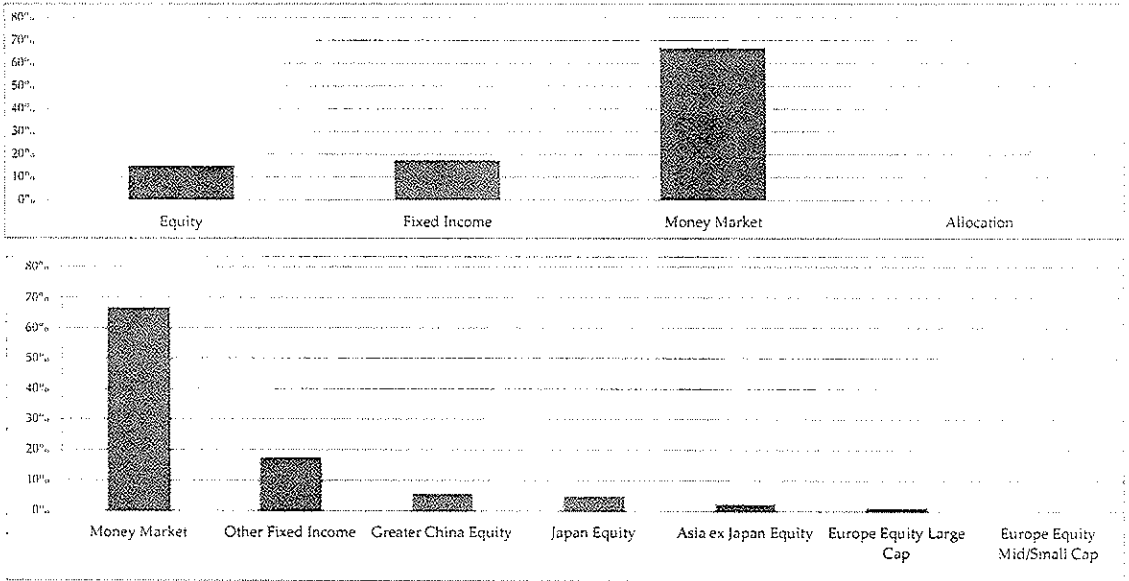
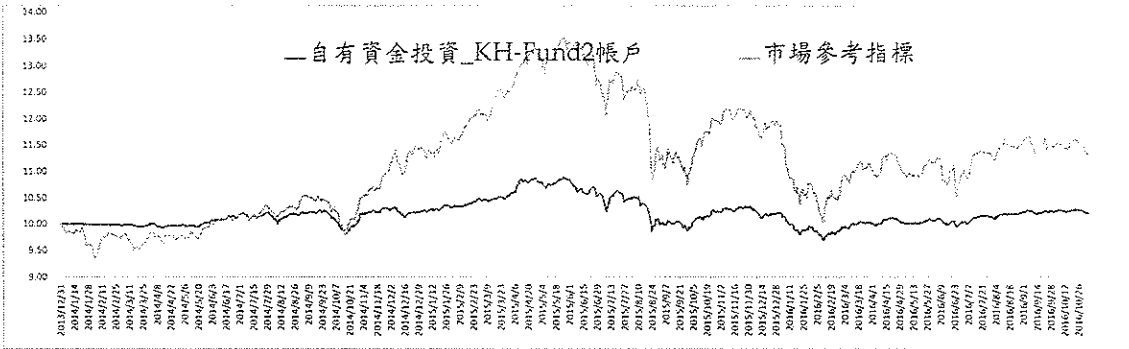
備註：在防範以外之損益計算，以MSCI全球股價(MXWD INDEX)指數為市場指數

资产类别		
占比	数量	金额
货币	15.32%	482,350,373
Fixed Income	17.72%	557,694,722
Money Market	30.85%	2,106,199,159
Allocated	0.00%	0

[illegible]

### 最新部编本

DATE	Fund Ticker	Fund Name	類別	資產類別	投資區域	Units	Fund Weighting	Total Cost (HK\$)	Market Value	Unrealized Gain/Loss	Last Price	最新淨值(日)	基金今年回報率	1D	5D	MTD	YTD
2016/11/4	IWD Index	新宏基	New Taiwan Dollar	Money Market	Money Market	2,106,199,159	66.95%	2,106,199,159	2,106,199,159	0	1.00	2016/11/2	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%
2016/11/4	AZYIA/DFIX Equity	AZ Fund I	Euro	Fixed Income	Other Fixed Income	2,866,425	17.75%	585,318,004	557,690,722	-27,627,282	4.99	2016/11/3	-4.72%	-0.06%	-0.32%	-0.32%	2.47%
2016/11/4	SCB CAAIX Equity	渣打環球基金系列 - 日本證券A類股份 - 累積單位	Japanese Yen	Equity	Japan Equity	319,601	3.89%	140,180,000	122,376,581	-17,803,419	1502.33	2016/11/4	-12.70%	-1.06%	-2.76%	-2.76%	-10.17%
2016/11/4	IDRIFAIX Equity	安達環球基金系列-中國基金(A)-欧元	Euro	Equity	Greater China Equity	13,549	3.86%	71,812,350	121,519,038	-50,293,212	261.01	2016/11/3	-29.27%	-0.51%	-3.84%	-3.84%	-7.92%
2016/11/4	HSANIAXIX Equity	富達基金-歐洲基金(EU)總回報系列-A(美元)	US Dollar	Equity	Asia ex Japan Equity	180,000	2.51%	87,395,727	78,830,561	-8,565,167	13.92	2016/11/4	-0.22%	-1.49%	-1.49%	-1.49%	9.45%
2016/11/3	HSRCHIAIX Equity	富達基金-中國基金(A)-美元	Fund	Equity	Greater China Equity	186,067	2.30%	99,628,000	72,290,155	-27,329,807	11.70	2016/11/4	-27.42%	-0.51%	-3.27%	-3.27%	-1.18%
2016/11/3	HSRPAIXIX Equity	富達基金-日本證券A類股份基金(A)	Fund	Equity	Europe Japan Large Cap	10,000	1.49%	55,925,007	46,949,840	-8,973,961	137.81	2016/11/3	-16.28%	-1.28%	-2.57%	-2.57%	-8.99%
2016/11/3	HSRPAIXIX Equity	富達基金-日本證券A類股份基金(A)-日元	Japanese Yen	Equity	Japan Equity	201,979	0.22%	49,820,006	38,444,214	-11,375,788	764.10	2016/11/4	-22.63%	-0.40%	-3.75%	-3.75%	-14.34%
2016/11/3	MISINATLIX Equity	MIS基金系列-MIS全球固定收益公司基金A(美元)	Fund	Equity	Europe Japan Mid/Small Cap	1,000	1.06%	1,721,777	1,739,941	18,164	49.43	2016/11/3	1.05%	0.22%	-1.48%	-1.48%	-5.58%



編號	帳戶名稱	淨資產價值(新台幣)	報酬率						Holding				計算截止日
			Daily	WTD	MTD	YTD	全期間報酬率	全期間超額報酬率	Equity	Fixed Income	Money Market	Allocation	
	總投資-KH+TG	39,325,531,475	0.04%	-0.51%	-0.51%	-1.65%	5.44%	5.89%	43.03%	3.62%	51.80%	1.55%	2016/11/4
	總投資-KH	18,102,374,293	-0.03%	-0.51%	-0.51%	-0.26%	1.95%	2.40%	41.48%	3.45%	54.92%	0.15%	2016/11/4
	總投資-TG	21,223,157,182	0.10%	-0.51%	-0.51%	-3.04%	7.33%	7.78%	44.35%	3.76%	49.14%	2.75%	2016/11/4
自有資金	自有資金投資-KH+TG	19,160,993,035	-0.03%	-0.28%	-0.28%	1.41%	1.69%	2.14%	27.92%	6.66%	62.23%	3.19%	2016/11/4
	自有資金投資-KH	15,087,556,861	-0.04%	-0.18%	-0.18%	1.51%	1.62%	2.07%	31.57%	4.14%	64.10%	0.18%	2016/11/4
	自有資金投資-TG	4,073,136,174	0.03%	-0.63%	-0.63%	1.70%	2.98%	3.43%	14.40%	15.96%	55.32%	14.31%	2016/11/4
全權委託	全權委託投資-KH+TG	20,164,538,440	0.10%	-0.73%	-0.73%	-4.35%	7.05%	7.50%	57.39%	0.73%	41.89%	0.00%	2016/11/4
	全權委託投資-KH	3,014,517,432	0.00%	-2.12%	-2.12%	-8.26%	2.09%	2.54%	91.06%	0.00%	8.94%	0.00%	2016/11/4
	全權委託投資-TG	17,150,021,008	0.12%	-0.48%	-0.48%	-3.58%	7.70%	8.15%	51.47%	0.86%	47.68%	0.00%	2016/11/4
另類投資	自有資金投資-KH+TG												
	自有資金投資-KH												
	自有資金投資-TG												
國內股票	TG+KH												
	TG												
	KH												

編號	帳戶名稱	淨資產價值(新台幣)	報酬率						Holding				計算截止日
			Daily	WTD	MTD	YTD	全期間報酬率 (年化)	全期間超額報酬率 (年化)	Equity	Fixed Income	Money Market	Allocation	
	總投資-KH+TG	39,325,531,475	0.04%	-0.51%	-0.51%	-1.65%	5.44%	5.89%	43.03%	3.62%	51.80%	1.55%	2016/11/4
	MSCI全球股價指數		-0.43%	-1.92%	-1.92%	0.94%	-0.45%	0.00%					
1	自有資金投資-KH+TG	19,160,902,064	-0.03%	-0.28%	-0.28%	1.41%	1.68%	2.59%	27.92%	6.66%	62.23%	3.19%	2016/11/4
	Benchmark: Absolute Return 8%		0.02%	0.08%	0.08%	6.73%	7.67%	0.00%					
2	自有資金投資-KH	15,087,765,890	-0.04%	-0.18%	-0.18%	1.51%	1.62%	2.05%	31.57%	4.14%	64.10%	0.18%	2016/11/4
	Benchmark: Absolute Return 8%		0.02%	0.08%	0.08%	6.73%	7.67%	0.00%					
3	自有資金投資-KH-Fund1	2,360,430,466	0.04%	-1.41%	-1.41%	6.35%	9.67%	4.88%	19.23%	0.00%	79.59%	1.18%	2016/11/4
	Benchmark: Absolute Return5%		0.01%	0.05%	0.05%	4.22%	4.80%	0.00%					
4	自有資金投資-KH-Fund2	3,146,040,254	-0.06%	-0.51%	-0.51%	-0.06%	0.66%	-3.58%	15.33%	17.73%	66.95%	0.00%	2016/11/4
	Benchmark: 市場基準指標		-0.65%	-1.91%	-1.91%	-4.77%	-0.10%	0.00%					
5	自有資金投資-KH: FE1	4,739,006,712	-0.01%	-0.04%	-0.04%	-0.95%	0.20%	0.30%	22.02%	0.00%	77.98%	0.00%	2016/11/4
	Benchmark: 市場基準指標		-0.65%	-1.91%	-1.91%	-4.77%	-0.10%	0.00%					
6	自有資金投資-KH: FE2	4,842,379,429	-0.10%	-0.51%	-0.51%	0.51%	2.79%	0.86%	57.49%	1.40%	41.12%	0.00%	2016/11/4
	Benchmark: 市場基準指標		-0.65%	-1.91%	-1.91%	-4.77%	-0.10%	0.00%					
7	自有資金投資-TG: Fund	4,073,136,174	0.03%	-0.63%	-0.63%	1.70%	2.98%	-4.69%	14.40%	15.96%	55.32%	14.31%	2016/11/4
	Benchmark: Absolute Return5%		0.02%	0.08%	0.08%	6.73%	7.67%	0.00%					
8	自有資金投資-TG: Fund1	553,421,745	0.01%	-1.00%	-1.00%	1.22%	2.81%	-1.99%	29.67%	5.71%	27.40%	34.02%	2016/11/4
	Benchmark: Absolute Return5%		0.01%	0.05%	0.05%	4.22%	4.80%	0.00%					
9	自有資金投資-TG: Fund2	1,497,038,686	0.07%	-1.04%	-1.04%	-0.20%	-0.20%	-4.40%	15.04%	26.81%	29.78%	26.37%	2016/11/4
	Benchmark: Absolute Return5%		0.01%	0.05%	0.05%	4.20%	4.20%	0.00%					
10	自有資金投資-TG: Fund3	2,022,675,743	0.01%	-0.22%	-0.22%	1.13%	1.13%	-1.55%	9.70%	8.44%	81.86%	0.00%	2016/11/4
	Benchmark: Absolute Return5%		0.01%	0.05%	0.05%	2.68%	2.68%	0.00%					
11	全權委託投資-TG: 瑞聯全球台股代辦帳戶	6,822,751,083	0.31%	-1.12%	-1.12%	6.95%	6.39%	2.73%	32.80%	0.00%	67.20%	0.00%	2016/11/4
	Benchmark: TWSE INDEX		0.01%	-2.39%	-2.39%	8.76%	3.67%	0.00%					
12	全權委託投資-TG: 復華投信台股代辦帳戶	548,318,255	-0.11%	-1.52%	-1.52%	3.33%	3.86%	2.97%	31.74%	0.00%	68.26%	0.00%	2016/11/4
	Benchmark: TWSE INDEX		0.01%	-2.39%	-2.39%	8.76%	0.89%	0.00%					
13	全權委託投資-TG: 施羅德信台股代辦帳戶	497,922,250	0.01%	-1.45%	-1.45%	-2.18%	-0.17%	-1.06%	36.78%	0.00%	63.22%	0.00%	2016/11/4
	Benchmark: TWSE INDEX		0.01%	-2.39%	-2.39%	8.76%	0.89%	0.00%					
14	全權委託投資-TG: UBP亞稅代辦帳戶(原幣)	66,232,044	-0.39%	-1.28%	-1.28%	-14.64%	-4.26%	-4.85%	93.51%	0.00%	6.49%	0.00%	2016/11/3
	Benchmark		0.00%	-0.98%	-0.98%	8.12%	0.60%	0.00%					
15	全權委託投資-TG: QFII-1代辦帳戶(原幣)	806,573,547	0.22%	0.68%	0.68%	-3.96%	25.23%	6.56%	58.13%	0.00%	41.85%	0.00%	2016/11/3
	Benchmark: 滬深300指數		0.95%	0.86%	0.86%	-9.81%	18.67%	0.00%					
16	全權委託投資-TG: QFII-2代辦帳戶(原幣)	708,951,050	0.34%	0.22%	0.22%	-10.60%	17.54%	7.98%	62.86%	4.29%	32.85%	0.00%	2016/11/3
	Benchmark: 滬深300指數		0.95%	0.86%	0.86%	-9.81%	9.56%	0.00%					
17	全權委託投資-KH: UBP 歐股代辦帳戶(原幣)	37,659,855	-0.00%	-1.80%	-1.80%	-9.92%	-3.01%	-3.02%	85.66%	0.00%	14.34%	0.00%	2016/11/3
	Benchmark: MSDEE15N Index		-0.03%	-2.23%	-2.23%	-6.27%	0.01%	0.00%					
18	全權委託投資-KH: SNAM 日股代辦帳戶(原幣)	5,600,369,282	-2.24%	-2.41%	-2.41%	-6.64%	5.99%	1.74%	96.09%	0.00%	3.91%	0.00%	2016/11/2
	Benchmark: TPXDDVD INDEX		-1.78%	-1.76%	-1.76%	-9.72%	4.25%	0.00%					

基金交易投資前檢查表 - 買進交易

2016/7/14

名稱	BB ID	一年內累積買進金額 (公告後) (計入此次交易後)	庫存部位 (TG+KH) (含未交割部位)	今日建議 買進金額	預估買進 單位數	基金規模	交易後佔基金 發行規模比值	Buylist 標的	SIL 上限	投資前 合規檢核
復華全球平衡基金	FUHGBAL TT Equity	\$200,000,000	\$45,350,190	\$15,000,000	843,170.32	\$3,112,766,636	1.94%	Yes	\$1,000,000,000	OK

過去一年交易紀錄(含本次交易)

復華全球平衡基金	交易日期	買進金額	帳戶別	備註
	2016/1/6	\$35,000,000	TG	
	2016/1/14	\$15,000,000	TG	
	2016/1/21	\$15,000,000	TG	
	2016/1/25	\$15,000,000	TG	
	2016/1/26	\$15,000,000	TG	
	2016/2/26	\$15,000,000	TG	
	2016/3/1	\$15,000,000	TG	
	2016/4/1	\$15,000,000	TG	
	2016/5/24	\$15,000,000	TG	
	2016/5/27	\$15,000,000	TG	
	2016/7/5	\$15,000,000	TG	
	2016/7/14	\$15,000,000	TG	
小計		\$200,000,000		

基金交易投資前檢查表 - 賣出交易

2016/11/3

名稱	BB ID	一年內累積賣出金額 (公告後) (計入此次交易後)	庫存部位 (TG+KH) (含未交割部位)	今日預估 賣出金額	今日減碼 單位數	基金規模	交易後佔基金 發行規模比值	Buylist 標的	SIL 上限	投資前 合規檢核
復華全球平衡基金	FUHGBAL TT Equity	\$216,400,649	\$38,344,159	\$38,344,159	2,168,787.3	\$2,784,015,530	0.00%	Yes	\$1,000,000,000	OK

過去一年交易紀錄(含本次交易)

復華全球平衡基金	交易日期	賣出金額	帳戶別
	2016/2/4	\$44,356,000	TG
	2016/4/26	\$15,312,480	TG
	2016/5/5	\$22,571,300	TG
	2016/6/14	\$30,363,000	TG
	2016/6/27	\$27,728,000	TG
	2016/10/31	\$37,725,710	TG
	2016/11/03*	\$38,344,159	TG
小計		\$216,400,649	

\*尚未交割，賣出金額為預估