

勞工保險基金第一梯次(續約)國外委託經營績效統計表

自98年11月1日至99年11月30日

(一)

單位：美元

國外委託經營 第一梯次(續約) (98年11月1日~99年11月30日)	
委託經營金額	350,000,000
委託經營月底資產淨值	386,816,059
累積總損益	36,816,059
委託經營總報酬率	10.52%

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	106,095,711	6,095,711	6.10%	7.61%
Alliance Bernstein	100,000,000	105,750,884	5,750,884	5.75%	7.12%
小計	200,000,000	211,846,594	11,846,594	5.92%	7.37%
全球股票型委託					
Wellington	150,000,000	174,969,465	24,969,465	16.65%	9.24%
合計	350,000,000	386,816,059	36,816,059	10.52%	8.21%

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(98/11/01-99/11/30)市場報酬率為10.31%，今年以來市場報酬率為4.11%。
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(98/11/01-99/11/30)市場報酬率為2.80%，今年以來市場報酬率為4.28%。

(二)

自99年7月1日至99年11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~99年11月30日)	
委託經營金額	79,276,014
委託經營月底資產淨值	94,676,100
累積總損益	15,400,086
委託經營總報酬率	19.43%

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	94,676,100	15,400,086	19.43%	19.43%

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(99/07/01-99/11/30)市場報酬率為15.47%，今年以來(自委託日起算)市場報酬率為15.47%。

勞工保險基金第二梯次國外委託經營績效統計表

自96年10月1日至99年11月30日

單位：美元

第二梯次國外委託經營 (96年10月1日~99年11月30日)	
委託經營金額	700,000,000
委託經營月底資產淨值	772,959,329
累積總損益	72,959,329
委託經營總報酬率	10.42%

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	115,574,275	-34,425,725	-22.95%	8.18%
全球新興市場股票型委託					
Vontobel	150,000,000	174,730,618	24,730,618	16.49%	26.60%
小計	300,000,000	290,304,892	-9,695,108	-3.23%	18.56%
被動式全球債券型委託					
SSgA	200,000,000	244,458,155	44,458,155	22.23%	3.85%
Vanguard	200,000,000	238,196,281	38,196,281	19.10%	3.68%
小計	400,000,000	482,654,436	82,654,436	20.66%	3.77%
合計	700,000,000	772,959,329	72,959,329	10.42%	8.87%

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. 美國股票型委任市場指標為FTSE AW US，同期間(96/10/1-99/11/30)市場報酬率為-17.64%，今年以來市場報酬率為7.34%。
4. 全球新興市場股票型委任市場指標為FTSE AW Emerging Markets ex PRC ex Taiwan，同期間(96/10/1-99/11/30)市場報酬率為2.71%，今年以來市場報酬率為13.05%。
5. 被動式全球債券型委任市場指標為Barclays Capital Global Treasury Index，同期間(96/10/1-99/11/30)市場報酬率為22.1%，(96/11/1-99/11/30)市場報酬率為20.13%，今年以來市場報酬率為4.04%。
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。

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99年11月30日

單位：美元

第三梯次國外委託經營 (99年2月1日~99年11月30日)	
委託經營金額	600,000,000
委託經營月底資產淨值	627,083,410
累積總損益	27,083,410
委託經營總報酬率	4.51%

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	207,710,877	7,710,877	3.86%	3.86%
Wellington	200,000,000	208,516,905	8,516,905	4.26%	4.26%
PIMCO	200,000,000	210,855,628	10,855,628	5.43%	5.43%
合計	600,000,000	627,083,410	27,083,410	4.51%	4.51%

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(99/2/01-99/11/30)市場報酬率為3.76%，今年以來(自撥款日起算)市場報酬率為3.76%。