

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12月31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12月31日)
委託經營金額	350,000,000
委託經營月底資產淨值	401,386,684
累積總損益	51,386,684
委託經營總報酬率	14.68%

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	106,969,823	6,969,823	6.97%	8.50%
Alliance Bernstein	100,000,000	107,100,751	7,100,751	7.10%	8.49%
小計	200,000,000	214,070,574	14,070,574	7.04%	8.49%
全球股票型委託					
Wellington	150,000,000	187,316,110	37,316,110	24.88%	16.95%
合計	350,000,000	401,386,684	51,386,684	14.68%	12.28%

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(98/11/01-99/12/31)市場報酬率為18.42%，今年以來市場報酬率為11.76%。
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(98/11/01-99/12/31)市場報酬率為4.21%，今年以來市場報酬率為5.70%。

(二)

自99年7月1日至99年12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~99年12月31日)
委託經營金額	79,276,014
委託經營月底資產淨值	101,335,516
累積總損益	22,059,502
委託經營總報酬率	27.83%

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	101,335,516	22,059,502	27.83%	27.83%

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(99/07/01-99/12/31)市場報酬率為23.96%，今年以來(自委託日起算)市場報酬率為23.96%。

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12月31日

單位：美元

第二梯次國外委託經營 (96年10月1日-99年12月31日)	
委託經營金額	700,000,000
委託經營月底資產淨值	798,511,095
累積總損益	98,511,095
委託經營總報酬率	14.07%

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	122,598,461	-27,401,539	-18.27%	14.75%
全球新興市場股票型委託					
Vontobel	150,000,000	184,539,820	34,539,820	23.03%	33.71%
小計	300,000,000	307,138,281	7,138,281	2.38%	25.44%
被動式全球債券型委託					
SSgA	200,000,000	248,817,047	48,817,047	24.41%	5.71%
Vanguard	200,000,000	242,555,767	42,555,767	21.28%	5.57%
小計	400,000,000	491,372,814	91,372,814	22.84%	5.64%
合計	700,000,000	798,511,095	98,511,095	14.07%	12.47%

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(96/10/1-99/12/31)市場報酬率為-12.18%，今年以來市場報酬率為14.46%。
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(96/10/1-99/12/31)市場報酬率為10.92%，今年以來市場報酬率為22.09%。
5. 被動式全球債券型委任市場指標為Barclays Capital Global Treasury Index，同期間(96/10/1-99/12/31)市場報酬率為24.28%，(96/11/1-99/12/31)市場報酬率為22.27%，今年以來市場報酬率為5.9%。
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12月31日

單位：美元

第三梯次國外委託經營 (99年2月1日~99年12月31日)	
委託經營金額	600,000,000
委託經營月底資產淨值	634,055,264
累積總損益	34,055,264
委託經營總報酬率	5.68%

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	210,089,983	10,089,983	5.04%	5.04%
Wellington	200,000,000	210,873,864	10,873,864	5.44%	5.44%
PIMCO	200,000,000	213,091,417	13,091,417	6.55%	6.55%
合計	600,000,000	634,055,264	34,055,264	5.68%	5.68%

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(99/2/01-99/12/31)市場報酬率為5.11%，今年以來(自撥款日起算)市場報酬率為5.11%。