

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10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10月31日)	
委託經營金額	350,000,000
委託經營月底資產淨值	398,106,681
累積總損益	48,106,681
委託經營總報酬率	13.74%

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	110,327,263	10,327,263	10.33%	11.90%
Alliance Bernstein	100,000,000	109,664,749	9,664,749	9.66%	11.09%
小計	200,000,000	219,992,012	19,992,012	10.00%	11.49%
全球股票型委託					
Wellington	150,000,000	178,114,669	28,114,669	18.74%	11.20%
合計	350,000,000	398,106,681	48,106,681	13.74%	11.36%

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(98/11/01-99/10/31)市場報酬率為12.74%，今年以來市場報酬率為6.41%。
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(98/11/01-99/10/31)市場報酬率為6.90%，今年以來市場報酬率為8.44%。

(二)

自99年7月1日至99年10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10月31日)	
委託經營金額	79,276,014
委託經營月底資產淨值	96,373,939
累積總損益	17,097,925
委託經營總報酬率	21.57%

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	96,373,939	17,097,925	21.57%	21.57%

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(99/07/01-99/10/31)市場報酬率為18.02%，今年以來(自委託日起算)市場報酬率為18.02%。

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10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10月31日)	
委託經營金額	700,000,000
委託經營月底資產淨值	804,014,267
累積總損益	104,014,267
委託經營總報酬率	14.86%

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	116,917,613	-33,082,387	-22.05%	9.43%
全球新興市場股票型委託					
Vontobel	150,000,000	180,479,799	30,479,799	20.32%	30.77%
小計	300,000,000	297,397,411	-2,602,589	-0.87%	21.46%
被動式全球債券型委託					
SSgA	200,000,000	256,572,075	56,572,075	28.29%	9.00%
Vanguard	200,000,000	250,044,780	50,044,780	25.02%	8.83%
小計	400,000,000	506,616,856	106,616,856	26.65%	8.92%
合計	700,000,000	804,014,267	104,014,267	14.86%	13.24%

附註

1. 本表資訊採「市價法」評估。
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(96/10/1-99/10/31)市場報酬率為-17.56%，今年以來市場報酬率為7.44%。
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(96/10/1-99/10/31)市場報酬率為6.68%，今年以來市場報酬率為17.42%。
5. 被動式全球債券型委任市場指標為Barclays Capital Global Treasury Index，同期間(96/10/1-99/10/31)市場報酬率為28.07%，(96/11/1-99/10/31)市場報酬率為26%，今年以來市場報酬率為9.13%。
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10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10月31日)	
委託經營金額	600,000,000
委託經營月底資產淨值	652,799,964
累積總損益	52,799,964
委託經營總報酬率	8.80%

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	216,336,254	16,336,254	8.17%	8.17%
Wellington	200,000,000	217,401,119	17,401,119	8.70%	8.70%
PIMCO	200,000,000	219,062,590	19,062,590	9.53%	9.53%
合計	600,000,000	652,799,964	52,799,964	8.80%	8.80%

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(99/2/01-99/10/31)市場報酬率為7.86%，今年以來(自撥款日起算)市場報酬率為7.86%。