

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7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7月31日)
委託經營金額	350,000,000
委託經營月底資產淨值	368,631,731
累積總損益	18,631,731
委託經營總報酬率	5.32%

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
<b>全球債券型委託</b>					
PIMCO	100,000,000	103,797,070	3,797,070	3.80%	5.28%
Alliance Bernstein	100,000,000	104,021,523	4,021,523	4.02%	5.37%
<b>小計</b>	<b>200,000,000</b>	<b>207,818,593</b>	<b>7,818,593</b>	<b>3.91%</b>	<b>5.32%</b>
<b>全球股票型委託</b>					
Wellington	150,000,000	160,813,138	10,813,138	7.21%	0.40%
<b>合計</b>	<b>350,000,000</b>	<b>368,631,731</b>	<b>18,631,731</b>	<b>5.32%</b>	<b>3.12%</b>

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(98/11/01-99/7/31)市場報酬率為3.28%，今年以來市場報酬率為-2.53%。
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(98/11/01-99/7/31)市場報酬率為1.77%，今年以來市場報酬率為3.23%。

(二)

自99年7月1日至99年7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7月31日)
委託經營金額	79,276,014
委託經營月底資產淨值	87,166,675
累積總損益	7,890,661
委託經營總報酬率	9.95%

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
<b>全球股票型委託</b>					
Wellington (II)	79,276,014	87,166,675	7,890,661	9.95%	9.95%

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(99/07/01-99/7/31)市場報酬率為8.11%，今年以來(自委託日起算)市場報酬率為8.11%。

## 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7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7月31日)	
委託經營金額	800,000,000
委託經營月底資產淨值	797,419,056
累積總損益	-2,580,944
委託經營總報酬率	-0.32%

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
<b>歐洲股票型委託</b>					
Alliance Bernstein	100,000,000	52,094,418	-47,905,582	-47.91%	-10.49%
<b>美國股票型委託</b>					
Janus	150,000,000	107,918,982	-42,081,018	-28.05%	1.01%
<b>全球新興市場股票型委託</b>					
Vontobel	150,000,000	159,185,555	9,185,555	6.12%	15.34%
<b>小計</b>	<b>400,000,000</b>	<b>319,198,955</b>	<b>-80,801,046</b>	<b>-20.20%</b>	<b>5.33%</b>
<b>被動式全球債券型委託</b>					
SSgA	200,000,000	242,202,542	42,202,542	21.10%	2.90%
Vanguard	200,000,000	236,017,559	36,017,559	18.01%	2.73%
<b>小計</b>	<b>400,000,000</b>	<b>478,220,101</b>	<b>78,220,101</b>	<b>19.56%</b>	<b>2.81%</b>
<b>合計</b>	<b>800,000,000</b>	<b>797,419,056</b>	<b>-2,580,944</b>	<b>-0.32%</b>	<b>3.80%</b>

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. 歐洲股票型委任市場指標為FTSE AW Europe，同期間(96/10/1-99/7/31)市場報酬率為-32.18%，今年以來市場報酬率為-6.82%。
4. 美國股票型委任市場指標為FTSE AW US，同期間(96/10/1-99/7/31)市場報酬率為-23.71%，今年以來市場報酬率為-0.58%。
5. 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(96/10/1-99/7/31)市場報酬率為-5.23%，今年以來市場報酬率為4.31%。
6. 被動式全球債券型委任市場指標為Barclays Capital Global Treasury Index，同期間(96/10/1-99/7/31)市場報酬率為20.83%，96/11/1-99/7/31市場報酬率為18.89%，今年以來市場報酬率為2.96%。

## 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7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7月31日)	
委託經營金額	600,000,000
委託經營月底資產淨值	618,470,342
累積總損益	18,470,342
委託經營總報酬率	3.08%

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
<b>全球債券型委託</b>					
Standish Mellon	200,000,000	205,602,592	5,602,592	2.80%	2.80%
Wellington	200,000,000	205,997,260	5,997,260	3.00%	3.00%
PIMCO	200,000,000	206,870,490	6,870,490	3.44%	3.44%
<b>合計</b>	<b>600,000,000</b>	<b>618,470,342</b>	<b>18,470,342</b>	<b>3.08%</b>	<b>3.08%</b>

附註

1. 本表資訊採「市價法」評估。
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(99/2/01-99/7/31)市場報酬率為2.65%，今年以來(自撥款日起算)市場報酬率為2.65%。