

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8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8月31日)
委託經營金額	350,000,000
委託經營月底資產淨值	366,790,291
累積總損益	16,790,291
委託經營總報酬率	4.80%

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					
PIMCO	100,000,000	105,993,215	5,993,215	5.99%	7.51%
Alliance Bernstein	100,000,000	105,746,820	5,746,820	5.75%	7.12%
小計	200,000,000	211,740,035	11,740,035	5.87%	7.31%
全球股票型委託					
Wellington	150,000,000	155,050,256	5,050,256	3.37%	-3.20%
合計	350,000,000	366,790,291	16,790,291	4.80%	2.60%

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(98/11/01-99/8/31)市場報酬率為-0.58%，今年以來市場報酬率為-6.17%。
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(98/11/01-99/8/31)市場報酬率為3.21%，今年以來市場報酬率為4.69%。

(二)

自99年7月1日至99年8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8月31日)
委託經營金額	79,276,014
委託經營月底資產淨值	83,975,242
累積總損益	4,699,228
委託經營總報酬率	5.93%

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	83,975,242	4,699,228	5.93%	5.93%

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(99/07/01-99/8/31)市場報酬率為4.07%，今年以來(自委託日起算)市場報酬率為4.07%。

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8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8月31日)	
委託經營金額	800,000,000
委託經營月底資產淨值	803,145,530
累積總損益	3,145,530
委託經營總報酬率	0.39%

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
歐洲股票型委託					
Alliance Bernstein	100,000,000	49,952,148	-50,047,852	-50.05%	-14.18%
美國股票型委託					
Janus	150,000,000	105,048,506	-44,951,494	-29.97%	-1.68%
全球新興市場股票型委託					
Vontobel	150,000,000	160,619,307	10,619,307	7.08%	16.38%
小計	400,000,000	315,619,961	-84,380,040	-21.10%	4.15%
被動式全球債券型委託					
SSgA	200,000,000	246,912,925	46,912,925	23.46%	4.90%
Vanguard	200,000,000	240,612,643	40,612,643	20.31%	4.73%
小計	400,000,000	487,525,569	87,525,569	21.88%	4.81%
合計	800,000,000	803,145,530	3,145,530	0.39%	4.55%

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. 歐洲股票型委任市場指標為FTSE AW Europe，同期間(96/10/1-99/8/31)市場報酬率為-34.77%，今年以來市場報酬率為-10.39%。
4. 美國股票型委任市場指標為FTSE AW US，同期間(96/10/1-99/8/31)市場報酬率為-27.17%，今年以來市場報酬率為-5.08%。
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(96/10/1-99/8/31)市場報酬率為-6.78%，今年以來市場報酬率為2.61%。
6. 被動式全球債券型委任市場指標為Barclays Capital Global Treasury Index，同期間(96/10/1-99/8/31)市場報酬率為23.20%，96/11/1-99/8/31市場報酬率為21.21%，今年以來市場報酬率為4.98%。
7. 日本股票型委託已於99年6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8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8月31日)	
委託經營金額	600,000,000
委託經營月底資產淨值	628,324,509
累積總損益	28,324,509
委託經營總報酬率	4.72%

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	208,416,395	8,416,395	4.21%	4.21%
Wellington	200,000,000	209,073,110	9,073,110	4.54%	4.54%
PIMCO	200,000,000	210,835,005	10,835,005	5.42%	5.42%
合計	600,000,000	628,324,509	28,324,509	4.72%	4.72%

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(99/2/01-99/8/31)市場報酬率為4.08%，今年以來(自撥款日起算)市場報酬率為4.08%。