

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6月30日

單位：美元

	國外委託經營 第一梯次(續約) (98年11月1日~99年6月30日)
委託經營金額	434,050,915
委託經營月底資產淨值	427,148,005
累積總損益	-6,902,910
委託經營總報酬率	-1.59%

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	100,488,626	488,626	0.49%	1.92%
Alliance Bernstein	100,000,000	100,630,873	630,873	0.63%	1.94%
小計	200,000,000	201,119,500	1,119,500	0.56%	1.93%
全球股票型委託					
Wellington	150,000,000	146,752,491	-3,247,509	-2.17%	-8.38%
移轉管理帳戶(股票型)	84,050,915	79,276,014	-4,774,901	-5.68%	-10.41%
小計	234,050,915	226,028,505	-8,022,410	-3.43%	-9.10%
合計	434,050,915	427,148,005	-6,902,910	-1.59%	-4.22%

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(98/11/01-99/6/30)市場報酬率為-4.47%，今年以來市場報酬率為-9.84%。
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(98/11/01-99/6/30)市場報酬率為-1.53%，今年以來市場報酬率為-0.11%。

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6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6月30日)	
委託經營金額	865,000,000
委託經營月底資產淨值	793,979,594
累積總損益	-71,020,406
委託經營總報酬率	-8.21%

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	46,011,705	-53,988,295	-53.99%	-20.95%
美國股票型委託					
Janus	150,000,000	101,618,043	-48,381,957	-32.25%	-4.89%
日本股票型委託					
Invesco	65,000,000	38,136,373	-26,863,627	-41.33%	-2.59%
全球新興市場股票型委託					
Vontobel	150,000,000	146,897,011	-3,102,989	-2.07%	6.44%
小計	465,000,000	332,663,132	-132,336,867	-28.46%	-2.79%
被動式全球債券型委託					
SSgA	200,000,000	233,656,065	33,656,065	16.83%	-0.74%
Vanguard	200,000,000	227,660,397	27,660,397	13.83%	-0.91%
小計	400,000,000	461,316,462	61,316,462	15.33%	-0.82%
合計	865,000,000	793,979,594	-71,020,406	-8.21%	-1.66%

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(96/10/1-99/6/30)市場報酬率為-39.32%，今年以來市場報酬率為-16.64%。
4. 美國股票型委任市場指標為FTSE AW US，同期間(96/10/1-99/6/30)市場報酬率為-28.60%，今年以來市場報酬率為-6.94%。
5. 日本股票型委任市場指標為0.6*FTSE AW Japan+0.4*FTSE Japan Small Cap，同期間(96/10/1-99/6/30)市場報酬率為-25.35%，今年以來市場報酬率為0.50%。本基金已於99年6月30日終止日本股票型帳戶委任合約。
6. 全球新興市場股票型委任市場指標為FTSE AW Emerging Markets ex the People's Republic of China (PRC) ex Taiwan，同期間(96/10/1-99/6/30)市場報酬率為-13.19%，今年以來市場報酬率為-4.45%。
7. 被動式全球債券型委任市場指標為Barclays Capital Global Treasury Index，同期間(96/10/1-99/6/30)市場報酬率為16.57%，96/11/1-99/6/30市場報酬率為14.69%，今年以來市場報酬率為-0.67%。

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6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6月30日)	
委託經營金額	600,000,000
委託經營月底資產淨值	598,122,260
累積總損益	-1,877,740
委託經營總報酬率	-0.31%

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	198,817,180	-1,182,820	-0.59%	-0.59%
Wellington	200,000,000	198,951,019	-1,048,981	-0.52%	-0.52%
PIMCO	200,000,000	200,354,061	354,061	0.18%	0.18%
合計	600,000,000	598,122,260	-1,877,740	-0.31%	-0.31%

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(99/2/01-99/6/30)市場報酬率為-0.72%，今年以來(自撥款日起算)市場報酬率為-0.72%。