

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5月31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5月31日)	
委託經營金額	434,050,915
委託經營月底資產淨值	432,265,748
累積總損益	-1,785,167
委託經營總報酬率	-0.41%

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	98,696,535	-1,303,465	-1.30%	0.10%
Alliance Bernstein	100,000,000	98,842,341	-1,157,659	-1.16%	0.12%
小計	200,000,000	197,538,876	-2,461,124	-1.23%	0.11%
全球股票型委託					
Wellington	150,000,000	152,394,727	2,394,727	1.60%	-4.85%
移轉管理帳戶(股票型)	84,050,915	82,332,144	-1,718,770	-2.04%	-6.95%
小計	234,050,915	234,726,872	675,957	0.29%	-5.60%
合計	434,050,915	432,265,748	-1,785,167	-0.41%	-3.07%

附註

1. 本表資訊採「市價法」評估。
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(98/11/01-99/5/31)市場報酬率為-1.08%，今年以來市場報酬率為-6.64%。
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(98/11/01-99/5/31)市場報酬率為-3.10%，今年以來市場報酬率為-1.71%。

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5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5月31日)	
委託經營金額	865,000,000
委託經營月底資產淨值	788,640,231
累積總損益	-76,359,769
委託經營總報酬率	-8.83%

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
歐洲股票型委託					
Alliance Bernstein	100,000,000	47,375,268	-52,624,732	-52.62%	-18.60%
美國股票型委託					
Janus	150,000,000	106,364,912	-43,635,088	-29.09%	-0.44%
日本股票型委託					
Invesco	65,000,000	38,462,085	-26,537,915	-40.83%	-1.75%
全球新興市場股票型委託					
Vontobel	150,000,000	143,263,773	-6,736,227	-4.49%	3.80%
小計	465,000,000	335,466,038	-129,533,962	-27.86%	-1.97%
被動式全球債券型委託					
SSgA	200,000,000	229,441,136	29,441,136	14.72%	-2.53%
Vanguard	200,000,000	223,733,056	23,733,056	11.87%	-2.62%
小計	400,000,000	453,174,192	53,174,192	13.29%	-2.57%
合計	865,000,000	788,640,230	-76,359,770	-8.83%	-2.32%

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(96/10/1-99/5/31)市場報酬率為-38.74%，今年以來市場報酬率為-15.84%。
4. 美國股票型委任市場指標為FTSE AW US，同期間(96/10/1-99/5/31)市場報酬率為-24.60%，今年以來市場報酬率為-1.74%。
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(96/10/1-99/5/31)市場報酬率為-24.63%，今年以來市場報酬率為1.47%。
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(96/10/1-99/5/31)市場報酬率為-12.22%，今年以來市場報酬率為-3.38%。
7. 被動式全球債券型委任市場指標為Barclays Capital Global Treasury Index，同期間(96/10/1-99/5/31)市場報酬率為14.56%，96/11/1-99/5/31市場報酬率為12.71%，今年以來市場報酬率為-2.39%。

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5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5月31日)	
委託經營金額	600,000,000
委託經營月底資產淨值	587,070,707
累積總損益	-12,929,293
委託經營總報酬率	-2.15%

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	195,296,843	-4,703,157	-2.35%	-2.35%
Wellington	200,000,000	195,358,996	-4,641,004	-2.32%	-2.32%
PIMCO	200,000,000	196,414,868	-3,585,132	-1.79%	-1.79%
合計	600,000,000	587,070,707	-12,929,293	-2.15%	-2.15%

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(99/2/01-99/5/31)市場報酬率為-2.22%，今年以來(自撥款日起算)市場報酬率為-2.22%。