

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9月30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9月30日)	
委託經營金額	350,000,000
委託經營月底資產淨值	388,127,980
累積總損益	38,127,980
委託經營總報酬率	10.89%

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	108,870,806	8,870,806	8.87%	10.42%
Alliance Bernstein	100,000,000	108,437,926	8,437,926	8.44%	9.84%
小計	200,000,000	217,308,732	17,308,732	8.65%	10.13%
全球股票型委託					
Wellington	150,000,000	170,819,248	20,819,248	13.88%	6.65%
合計	350,000,000	388,127,980	38,127,980	10.89%	8.57%

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)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(98/11/01-99/9/30)市場報酬率為8.69%，今年以來市場報酬率為2.58%。
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(98/11/01-99/9/30)市場報酬率為5.58%，今年以來市場報酬率為7.10%。

(二)

自99年7月1日至99年9月30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9月30日)	
委託經營金額	79,276,014
委託經營月底資產淨值	92,441,556
累積總損益	13,165,542
委託經營總報酬率	16.61%

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	92,441,556	13,165,542	16.61%	16.61%

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(99/07/01-99/9/30)市場報酬率為13.78%，今年以來(自委託日起算)市場報酬率為13.78%。

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9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9月30日)	
委託經營金額	800,000,000
委託經營月底資產淨值	845,796,027
累積總損益	45,796,027
委託經營總報酬率	5.72%

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
歐洲股票型委託					
Alliance Bernstein	100,000,000	55,134,493	-44,865,507	-44.87%	-5.27%
美國股票型委託					
Janus	150,000,000	112,698,953	-37,301,047	-24.87%	5.48%
全球新興市場股票型委託					
Vontobel	150,000,000	178,340,147	28,340,147	18.89%	29.22%
小計	400,000,000	346,173,594	-53,826,406	-13.46%	14.23%
被動式全球債券型委託					
SSgA	200,000,000	253,019,402	53,019,402	26.51%	7.49%
Vanguard	200,000,000	246,603,031	46,603,031	23.30%	7.33%
小計	400,000,000	499,622,433	99,622,433	24.91%	7.41%
合計	800,000,000	845,796,027	45,796,027	5.72%	10.10%

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(96/10/1-99/9/30)市場報酬率為-27.55%，今年以來市場報酬率為-0.47%。
4. 美國股票型委任市場指標為FTSE AW US，同期間(96/10/1-99/9/30)市場報酬率為-20.62%，今年以來市場報酬率為3.45%。
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(96/10/1-99/9/30)市場報酬率為3.96%，今年以來市場報酬率為14.43%。
6. 被動式全球債券型委任市場指標為Barclays Capital Global Treasury Index，同期間(96/10/1-99/9/30)市場報酬率為26.28%，(96/11/1-99/9/30)市場報酬率為24.24%，今年以來市場報酬率為7.6%。
7. 日本股票型已於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9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9月30日)	
委託經營金額	600,000,000
委託經營月底資產淨值	645,142,754
累積總損益	45,142,754
委託經營總報酬率	7.52%

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	214,098,379	14,098,379	7.05%	7.05%
Wellington	200,000,000	214,732,251	14,732,251	7.37%	7.37%
PIMCO	200,000,000	216,312,124	16,312,124	8.16%	8.16%
合計	600,000,000	645,142,754	45,142,754	7.52%	7.52%

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(99/2/01-99/9/30)市場報酬率為6.52%，今年以來(自撥款日起算)市場報酬率為6.52%。