

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3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3月31日)
委託經營金額	434,050,915
委託經營季末資產淨值	459,402,221
累積總損益	25,351,306
委託經營總報酬率	5.84%

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	99,779,126	-220,874	-0.22%	1.20%
Alliance Bernstein	100,000,000	99,600,866	-399,134	-0.40%	0.89%
小計	200,000,000	199,379,992	-620,008	-0.31%	1.05%
全球股票型委託					
Wellington	150,000,000	168,594,395	18,594,395	12.40%	5.26%
移轉管理帳戶(股票型)	84,050,915	91,427,834	7,376,919	8.78%	3.33%
小計	234,050,915	260,022,229	25,971,314	11.10%	4.57%
合計	434,050,915	459,402,221	25,351,306	5.84%	3.01%

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(98/11/01-99/3/31)市場報酬率為9.39%，今年以來市場報酬率為3.24%。
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(98/11/01-99/3/31)市場報酬率為-1.77%，今年以來市場報酬率為-0.36%。

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3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3月31日)	
委託經營金額	865,000,000
委託經營季末資產淨值	816,181,405
累積總損益	-48,818,595
委託經營總報酬率	-5.64%

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	56,996,918	-43,003,082	-43.00%	-2.07%
美國股票型委託					
Janus	150,000,000	115,357,982	-34,642,018	-23.09%	7.97%
日本股票型委託					
Invesco	65,000,000	40,616,627	-24,383,373	-37.51%	3.75%
全球新興市場股票型委託					
Vontobel	150,000,000	143,419,477	-6,580,523	-4.39%	3.92%
小計	465,000,000	356,391,004	-108,608,996	-23.36%	4.15%
被動式全球債券型委託					
SSgA	200,000,000	232,714,923	32,714,923	16.36%	-1.13%
Vanguard	200,000,000	227,075,478	27,075,478	13.54%	-1.17%
小計	400,000,000	459,790,401	59,790,401	14.95%	-1.15%
合計	865,000,000	816,181,405	-48,818,595	-5.64%	1.09%

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(96/10/1-99/3/31)市場報酬率為-28.35%，今年以來市場報酬率為-1.57%。
4. 美國股票型委任市場指標為FTSE AW US，同期間(96/10/1-99/3/31)市場報酬率為-19.11%，今年以來市場報酬率為5.42%。
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(96/10/1-99/3/31)市場報酬率為-19.47%，今年以來市場報酬率為8.42%。
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(96/10/1-99/3/31)市場報酬率為-5.06%，今年以來市場報酬率為4.49%。
7. 被動式全球債券型委任市場指標為Barclays Capital Global Treasury Index，同期間(96/10/1-99/3/31)市場報酬率為16.15%，另96/11/1-99/3/31市場報酬率為14.27%，今年以來市場報酬率為-1.03%。

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3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3月31日)
委託經營金額	600,000,000
委託經營季末資產淨值	595,082,494
累積總損益	-4,917,506
委託經營總報酬率	-0.82%

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	198,777,384	-1,222,616	-0.61%	-0.61%
Wellington	200,000,000	198,160,918	-1,839,082	-0.92%	-0.92%
PIMCO	200,000,000	198,144,192	-1,855,808	-0.93%	-0.93%
合計	600,000,000	595,082,494	-4,917,506	-0.82%	-0.82%

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(99/2/01-99/3/31)市場報酬率為-0.68%，今年以來(自撥款日起算)市場報酬率為-0.68%。