

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2月28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2月28日)
委託經營金額	434,050,915
委託經營季末資產淨值	442,679,063
累積總損益	8,628,148
委託經營總報酬率	1.99%

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	100,404,154	404,154	0.40%	1.84%
Alliance Bernstein	100,000,000	100,277,520	277,520	0.28%	1.58%
小計	200,000,000	200,681,674	681,674	0.34%	1.71%
全球股票型委託					
Wellington	150,000,000	155,929,567	5,929,567	3.95%	-2.65%
移轉管理帳戶(股票型)	84,050,915	86,067,822	2,016,907	2.40%	-2.73%
小計	234,050,915	241,997,389	7,946,474	3.40%	-2.68%
合計	434,050,915	442,679,063	8,628,148	1.99%	-0.74%

附註

1. 本表資訊採「市價法」評估。
2. 本基金第一梯次(續約)之委託經營日期為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(98/11/01-99/2/28)市場報酬率為3.01%，今年以來市場報酬率為-2.78%。
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(98/11/01-99/2/28)市場報酬率為-0.90%，今年以來市場報酬率為0.52%。

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2月28日

單位：美元

第二梯次國外委託經營 (96年10月1日~99年2月28日)	
委託經營金額	865,000,000
委託經營季末資產淨值	802,015,228
累積總損益	-62,984,772
委託經營總報酬率	-7.28%

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	53,056,879	-46,943,121	-46.94%	-8.84%
美國股票型委託					
Janus	150,000,000	107,515,751	-42,484,249	-28.32%	0.63%
日本股票型委託					
Invesco	65,000,000	39,072,730	-25,927,270	-39.89%	-0.19%
全球新興市場股票型委託					
Vontobel	150,000,000	135,214,696	-14,785,304	-9.86%	-2.03%
小計	465,000,000	334,860,056	-130,139,944	-27.99%	-2.15%
被動式全球債券型委託					
SSgA	200,000,000	236,424,416	36,424,416	18.21%	0.44%
Vanguard	200,000,000	230,730,756	30,730,756	15.37%	0.43%
小計	400,000,000	467,155,172	67,155,172	16.79%	0.43%
合計	865,000,000	802,015,228	-62,984,772	-7.28%	-0.66%

附註

1. 本表資訊採「市價法」評估。
2. 本基金第二梯次委託經營日期為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(96/10/1-99/2/28)市場報酬率為-32.91%，今年以來市場報酬率為-7.83%。
4. 美國股票型委任市場指標為FTSE AW US，同期間(96/10/1-99/2/28)市場報酬率為-23.65%，今年以來市場報酬率為-0.49%。
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(96/10/1-99/2/28)市場報酬率為-23.20%，今年以來市場報酬率為3.39%。
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(96/10/1-99/2/28)市場報酬率為-12.85%，今年以來市場報酬率為-4.08%。
7. 被動式全球債券型委任市場指標為Barclays Capital Global Treasury Index (原Lehman Brother更名為Barclays Capital)，同期間(96/10/1-99/2/28)市場報酬率為17.97%，另96/11/1-99/2/28市場報酬率為16.06%，今年以來市場報酬率為0.52%。

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2月28日

單位：美元

第三梯次國外委託經營 (99年2月1日~99年2月28日)	
委託經營金額	600,000,000
委託經營季末資產淨值	600,443,606
累積總損益	443,606
委託經營總報酬率	0.07%

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	200,232,123	232,123	0.12%	0.12%
Wellington	200,000,000	199,881,273	-118,727	-0.06%	-0.06%
PIMCO	200,000,000	200,330,210	330,210	0.17%	0.17%
合計	600,000,000	600,443,606	443,606	0.07%	0.07%

附註

1. 本表資訊採「市價法」評估。
2. 本基金第三梯次之委託經營日期為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(99/2/01-99/2/28)市場報酬率為0.07%，今年以來市場報酬率(自撥款日起算)為0.07%。