

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4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4月30日)
委託經營金額	434,050,915
委託經營季末資產淨值	459,525,605
累積總損益	25,474,690
委託經營總報酬率	5.87%

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	100,216,824	216,824	0.22%	1.65%
Alliance Bernstein	100,000,000	100,166,322	166,322	0.17%	1.47%
小計	200,000,000	200,383,146	383,146	0.19%	1.56%
全球股票型委託					
Wellington	150,000,000	168,187,817	18,187,817	12.13%	5.01%
移轉管理帳戶(股票型)	84,050,915	90,954,643	6,903,728	8.21%	2.79%
小計	234,050,915	259,142,459	25,091,545	10.72%	4.22%
合計	434,050,915	459,525,605	25,474,690	5.87%	3.04%

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(98/11/01-99/4/30)市場報酬率為9.40%，今年以來市場報酬率為3.25%。
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(98/11/01-99/4/30)市場報酬率為-1.68%，今年以來市場報酬率為-0.27%。

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4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4月30日)	
委託經營金額	865,000,000
委託經營季末資產淨值	821,068,002
累積總損益	-43,931,998
委託經營總報酬率	-5.08%

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	54,976,568	-45,023,432	-45.02%	-5.54%
美國股票型委託					
Janus	150,000,000	116,792,781	-33,207,219	-22.14%	9.32%
日本股票型委託					
Invesco	65,000,000	41,907,290	-23,092,710	-35.53%	7.05%
全球新興市場股票型委託					
Vontobel	150,000,000	148,799,249	-1,200,751	-0.80%	7.81%
小計	465,000,000	362,475,887	-102,524,113	-22.05%	5.92%
被動式全球債券型委託					
SSgA	200,000,000	232,149,578	32,149,578	16.07%	-1.38%
Vanguard	200,000,000	226,442,536	26,442,536	13.22%	-1.44%
小計	400,000,000	458,592,114	58,592,114	14.65%	-1.41%
合計	865,000,000	821,068,002	-43,931,998	-5.08%	1.70%

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(96/10/1-99/4/30)市場報酬率為-30.12%，今年以來市場報酬率為-4.00%。
4. 美國股票型委任市場指標為FTSE AW US，同期間(96/10/1-99/4/30)市場報酬率為-17.88%，今年以來市場報酬率為7.02%。
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(96/10/1-99/4/30)市場報酬率為-18.51%，今年以來市場報酬率為9.72%。
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(96/10/1-99/4/30)市場報酬率為-4.03%，今年以來市場報酬率為5.64%。
7. 被動式全球債券型委任市場指標為Barclays Capital Global Treasury Index，同期間(96/10/1-99/4/30)市場報酬率為15.87%，96/11/1-99/4/30市場報酬率為14.00%，今年以來市場報酬率為-1.27%。

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4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4月30日)
委託經營金額	600,000,000
委託經營季末資產淨值	597,280,300
累積總損益	-2,719,700
委託經營總報酬率	-0.45%

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	200,439,082	439,082	0.22%	0.22%
Wellington	200,000,000	198,308,195	-1,691,805	-0.85%	-0.85%
PIMCO	200,000,000	198,533,022	-1,466,978	-0.73%	-0.73%
合計	600,000,000	597,280,300	-2,719,700	-0.45%	-0.45%

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(99/2/01-99/4/30)市場報酬率為-0.67%，今年以來(自撥款日起算)市場報酬率為-0.67%。