

勞工保險基金國外委託經營 第一梯次(續約)績效統計表

自98年11月1日至99年1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1月31日)
委託經營金額	434,050,915
委託經營季末資產淨值	438,281,640
累積總損益	4,230,725
委託經營總報酬率	0.97%

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	100,105,644	105,644	0.11%	1.53%
Alliance Bernstein	100,000,000	99,876,520	-123,480	-0.12%	1.17%
小計	200,000,000	199,982,164	-17,836	-0.01%	1.35%
全球股票型委託					
Wellington	150,000,000	153,701,575	3,701,575	2.47%	-4.04%
移轉管理帳戶(股票型)	84,050,915	84,597,901	546,986	0.65%	-4.39%
小計	234,050,915	238,299,475	4,248,561	1.82%	-4.16%
合計	434,050,915	438,281,640	4,230,725	0.97%	-1.72%

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(98/11/01-99/1/31)市場報酬率為1.58%，今年以來市場報酬率為-4.13%。
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(98/11/01-99/1/31)市場報酬率為-0.98%，今年以來市場報酬率為0.44%。