

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98年12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-98年12月31日)
委託經營金額	434,050,915
委託經營季末資產淨值	445,964,207
累積總損益	11,913,292
委託經營總報酬率	2.74%

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	98,593,125	(1,406,875)	-1.41%	-1.41%
Alliance Bernstein	100,000,000	98,719,617	(1,280,383)	-1.28%	-1.28%
小計	200,000,000	197,312,742	(2,687,258)	-1.34%	-1.34%
全球股票型委託					
Wellington	150,000,000	160,168,350	10,168,350	6.78%	6.78%
移轉管理帳戶(股票型)	84,050,915	88,483,115	4,432,200	5.27%	5.27%
小計	234,050,915	248,651,465	14,600,550	6.24%	6.24%
合計	434,050,915	445,964,207	11,913,292	2.74%	2.74%

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(98/11/01-98/12/31)市場報酬率為5.96%。
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(98/11/01-98/12/31)市場報酬率為-1.42%。

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98年12月31日

單位：美元

	(96年10月1日-98年12月31日)
委託經營金額	865,000,000
委託經營季末資產淨值	807,343,804
累積總損益	-57,656,196
委託經營總報酬率	-6.67%

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	58,202,623	-41,797,377	-41.80%	33.67%
美國股票型委託					
Janus	150,000,000	106,839,162	-43,160,838	-28.77%	29.84%
日本股票型委託					
Invesco	65,000,000	39,148,611	-25,851,389	-39.77%	8.66%
全球新興市場股票型委託					
Vontobel	150,000,000	138,014,729	-11,985,271	-7.99%	52.35%
小計	465,000,000	342,205,125	-122,794,875	-26.41%	35.56%
被動式全球債券型委託					
SS&A	200,000,000	235,386,235	35,386,235	17.69%	2.38%
Vanguard	200,000,000	229,752,444	29,752,444	14.88%	2.48%
小計	400,000,000	465,138,679	65,138,679	16.28%	2.43%
合計	865,000,000	807,343,804	-57,656,196	-6.67%	14.27%

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(96/10/1-98/12/31)市場報酬率為-27.21%，今年以來市場報酬率為37.83%。
4. 美國股票型委任市場指標為FTSE AW US, 同期間(96/10/1-98/12/31)市場報酬率為-23.27%，今年以來市場報酬率為26.27%。
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(96/10/1-98/12/31)市場報酬率為-25.84%，今年以來市場報酬率為4.34%。
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(96/10/1-98/12/31)市場報酬率為-9.15%，今年以來市場報酬率為-9.15%。
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(96/10/1-98/12/31)市場報酬率為17.36%，另