

勞工保險基金第一梯次國外委託經營績效統計表

自94年12月1日至98年9月30日

單位：美元

	第一梯次國外委託經營 (94年12月1日-98年9月30日)
委託經營金額	400,000,000
委託經營季末資產淨值	454,321,385
累積總損益	54,321,385
委託經營總報酬率	13.58%

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
全球股票型委託					
Wellington	100,000,000	103,929,121	3,929,121	3.93%	30.82%
Alliance Bernstein	100,000,000	85,750,202	-14,249,798	-14.25%	28.76%
小計	200,000,000	189,679,323	-10,320,677	-5.16%	29.88%
全球債券型委託					
PIMCO	100,000,000	133,874,380	33,874,380	33.87%	13.73%
Alliance Bernstein	100,000,000	130,767,682	30,767,682	30.77%	11.51%
小計	200,000,000	264,642,062	64,642,062	32.32%	12.62%
合計	400,000,000	454,321,385	54,321,385	13.58%	19.24%

附註

1. 本表資訊採「市價法」評估。
2. 本基金第一梯次委託經營日期為94年12月1日。
3. 全球股票型委任市場指標為MSCI World Index，同期間(94/12/01-98/9/30)市場報酬率為-1.95%，今年以來市場報酬率為24.90%。
4. 全球債券型委任市場指標為Barclays Capital Global Aggregate A- or better Bond Index (原Lehman Brother更名為Barclays Capital)，同期間(94/12/01-98/9/30)市場報酬率為33.84%，今年以來市場報酬率為6.95%。

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9月30日

單位：美元

	第二梯次國外委託經營 (96年10月1日-98年09月30)
委託經營金額	865,000,000
委託經營季末資產淨值	803,167,820
累積總損益	-61,832,180
委託經營總報酬率	-7.15%

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	57,523,262	-42,476,738	-42.48%	32.11%
美國股票型委託					
Janus	150,000,000	101,254,346	-48,745,654	-32.50%	23.05%
日本股票型委託					
Invesco	65,000,000	40,687,743	-24,312,257	-37.40%	12.93%
全球新興市場股票型委託					
Vontobel	150,000,000	129,643,246	-20,356,754	-13.57%	43.11%
小計	465,000,000	329,108,598	-135,891,402	-29.22%	30.37%
被動式全球債券型委託					
SSgA	200,000,000	239,987,033	39,987,033	19.99%	4.39%
Vanguard	200,000,000	234,072,189	34,072,189	17.04%	4.40%
小計	400,000,000	474,059,222	74,059,222	18.51%	4.39%
合計	865,000,000	803,167,820	-61,832,180	-7.15%	13.68%

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(96/10/1-98/9/30)市場報酬率為-29.54%，今年以來市場報酬率為33.43%。
4. 美國股票型委任市場指標為FTSE AW US，同期間(96/10/1-98/9/30)市場報酬率為-27.48%，今年以來市場報酬率為19.34%。
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(96/10/1-98/9/30)市場報酬率為-21.30%，今年以來市場報酬率為10.73%。
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(96/10/1-98/9/30)市場報酬率為-16.74%，今年以來
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(96/10/1-98/9/30)市場報酬率為19.61%，另