

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6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6月30日)
委託經營金額	400,000,000
委託經營季末資產淨值	402,165,206
累積總損益	2,165,206
委託經營總報酬率	0.54%

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	87,560,240	-12,439,760	-12.44%	10.22%
Alliance Bernstein	100,000,000	71,850,224	-28,149,776	-28.15%	7.89%
小計	200,000,000	159,410,464	-40,589,536	-20.29%	9.16%
全球債券型委託					
PIMCO	100,000,000	122,630,646	22,630,646	22.63%	4.18%
Alliance Bernstein	100,000,000	120,124,096	20,124,096	20.12%	2.43%
小計	200,000,000	242,754,742	42,754,742	21.38%	3.30%
合計	400,000,000	402,165,206	2,165,206	0.54%	5.55%

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(94/12/01-98/6/30)市場報酬率為-16.51%，今年以來市場報酬率為6.35%。
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(94/12/01-98/6/30)市場報酬率為26.27%，今年以來市場報酬率為0.91%。

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6月30日

單位：美元

	經營 (96年 10月1日-98年06月 30日)
委託經營金額	865,000,000
委託經營季末資產淨值	726,771,852
累積總損益	-138,228,148
委託經營總報酬率	-15.98%

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	46,710,387	-53,289,613	-53.29%	7.28%
美國股票型委託					
Janus	150,000,000	85,540,594	-64,459,406	-42.97%	3.95%
日本股票型委託					
Invesco	65,000,000	36,892,430	-28,107,570	-43.24%	2.40%
全球新興市場股票型委託					
Vontobel	150,000,000	110,858,436	-39,141,564	-26.09%	22.38%
小計	465,000,000	280,001,847	-184,998,153	-39.78%	10.92%
被動式全球債券型委託					
SSgA	200,000,000	226,219,460	26,219,460	13.11%	-1.60%
Vanguard	200,000,000	220,550,545	20,550,545	10.28%	-1.63%
小計	400,000,000	446,770,005	46,770,005	11.69%	-1.61%
合計	865,000,000	726,771,852	-138,228,148	-15.98%	2.86%

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(96/10/1-98/6/30)市場報酬率為-43.0%，今年以來市場報酬率為7.94%。
4. 美國股票型委任市場指標為FTSE AW US，同期間(96/10/1-98/6/30)市場報酬率為-37.23%，今年以來市場報酬率為3.30%。
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(96/10/1-98/6/30)市場報酬率為-26.32%，今年以來市場報酬率為-
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(96/10/1-98/6/30)市場報酬率為-
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(96/10/1-98/6/30)市場報酬率