

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97年12月31日

單位：美元

第二梯次國外委託經營 (96年10月1日~97年12月31日)	
委託經營金額	865,000,000
委託經營季末資產淨值	706,546,576
累積總損益	-158,453,424
委託經營總報酬率	-18.32%

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
歐洲股票型委託				
Alliance Bernstein	100,000,000	43,540,602	(56,459,398)	-56.46%
美國股票型委託				
Janus	150,000,000	82,287,590	(67,712,410)	-45.14%
日本股票型委託				
Invesco	65,000,000	36,027,963	(28,972,037)	-44.57%
全球新興市場股票型委託				
Vontobel	150,000,000	90,588,072	(59,411,928)	-39.61%
小計	465,000,000	252,444,227		-45.71%
被動式全球債券型委託				
SSgA	200,000,000	229,904,285	29,904,285	14.95%
Vanguard	200,000,000	224,198,064	24,198,064	12.10%
小計	400,000,000	454,102,349	54,102,349	13.53%

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(96/10/1-97/12/31)市場報酬率為-47.190%。
4. 美國股票型委任市場指標為FTSE AW US，同期間(96/10/1-97/12/31)市場報酬率為-39.235%。
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(96/10/1-97/12/31)市場報酬率為-28.930%。
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(96/10/1-97/12/31)市場報酬率為-50.952%。
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(96/10/1-97/12/31)市場報酬率為14.344%，另96/11/1-97/12/31市場報酬率