

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97年12月31日

單位：美元

	第一梯次國外委託經營 (94年12月1日~97年12月31日)
委託經營金額	400,000,000
委託經營季末資產淨值	381,027,861
累積總損益	-18,972,139
委託經營總報酬率	-4.74%

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
全球股票型委託				
Wellington	100,000,000	79,441,399	(20,558,601)	-20.56%
Alliance Bernstein	100,000,000	66,597,185	(33,402,815)	-33.40%
小計	200,000,000	146,038,584	(53,961,416)	-26.98%
全球債券型委託				
PIMCO	100,000,000	117,715,906	17,715,906	17.72%
Alliance Bernstein	100,000,000	117,273,371	17,273,371	17.27%
小計	200,000,000	234,989,277	34,989,277	17.49%

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(94/12/01-97/12/31)市場報酬率為-21.497%。
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(94/12/01-97/12/31)市場報酬率為25.136%。