

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3月31日

單位：美元

	第一梯次國外委託經營 (94年12月1日-98年3月31日)
委託經營金額	400,000,000
委託經營季末資產淨值	357,552,394
累積總損益	-42,447,606
委託經營總報酬率	-10.61%

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	72,910,157	-27,089,843	-27.09%	-8.22%
Alliance Bernstein	100,000,000	58,988,504	-41,011,496	-41.01%	-11.42%
小計	200,000,000	131,898,661	-68,101,339	-34.05%	-9.68%
全球債券型委託					
PIMCO	100,000,000	114,456,040	14,456,040	14.46%	-2.77%
Alliance Bernstein	100,000,000	111,197,694	11,197,694	11.20%	-5.18%
小計	200,000,000	225,653,733	25,653,733	12.83%	-3.97%
合計	400,000,000	357,552,394	-42,447,606	-10.61%	-6.16%

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(94/12/01-98/3/31)市場報酬率為-30.86%，今年以來市場報酬率為-11.92%。
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(94/12/01-98/3/31)市場報酬率為20.91%，今年以來市場報酬率為-3.38%。

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3月31日

單位：美元

	第二梯次國外委託經營 (96年10月1日-98年3月31日)
委託經營金額	865,000,000
委託經營季末資產淨值	651,205,139
累積總損益	-213,794,861
委託經營總報酬率	-24.72%

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	36,937,671	-63,062,329	-63.06%	-15.16%
美國股票型委託					
Janus	150,000,000	67,433,828	-82,566,172	-55.04%	-18.05%
日本股票型委託					
Invesco	65,000,000	29,126,813	-35,873,187	-55.19%	-19.15%
全球新興市場股票型委託					
Vontobel	150,000,000	86,648,056	-63,351,944	-42.23%	-4.35%
小計	465,000,000	220,146,367		-52.66%	-12.79%
被動式全球債券型委託					
SSgA	200,000,000	218,307,231	18,307,231	9.15%	-5.04%
Vanguard	200,000,000	212,751,541	12,751,541	6.38%	-5.11%
小計	400,000,000	431,058,772	31,058,772	7.76%	-5.07%
合計	865,000,000	651,205,139	-213,794,861	-24.72%	-7.83%

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(96/10/1-98/3/31)市場報酬率為-54.74%，今年以來市場報酬率為-14.3%。
4. 美國股票型委任市場指標為FTSE AW US，同期間(96/10/1-98/3/31)市場報酬率為-45.76%，今年以來市場報酬率為-10.73%。
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(96/10/1-98/3/31)市場報酬率為-40.55%，今年以來市場報酬率為-16.35%。
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(96/10/1-98/3/31)市場報酬率為-51.24%，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(96/10/1-98/3/31)市場報酬率為8.66%，另