

退撫基金國外委託經營績效統計表

單位：美元，%

98年度第1次國外委託經營國際股票型(自98年9月14日至102年1月31日止)						
受託機構名稱	委託金額 (美元)	資產淨值 (美元)	102年度報酬 率(%)	委託迄今		
				報酬率(%)	委託 經營 排名	指定指標報 酬率(%)
ING資產管理	250,000,000	324,574,523.29	4.06%	29.83%	2	33.99%
德盛安聯資產管理	250,000,000	346,506,640.31	5.02%	38.60%	1	
貝萊德投資管理	250,000,000	324,464,442.53	4.52%	29.79%	3	
合計	750,000,000	995,545,606.13	4.54%	32.74%		

註：本會指定指標為MSCI全球指數。

98年度第2次國外委託經營亞太股票型(自99年4月28日至102年1月31日止)						
受託機構名稱	委託金額 (美元)	資產淨值 (美元)	102年度報酬 率(%)	委託迄今		
				報酬率(%)	委託 經營 排名	指定指標報 酬率(%)
富達國際	200,000,000	248,289,907.63	3.28%	24.14%	1	21.37%
瑞銀環球資產管理	200,000,000	247,935,478.19	4.08%	23.97%	2	
合計	400,000,000	496,225,385.82	3.68%	24.06%		

註：亞太股票型本會指定指標為MSCI亞太(日本、臺灣除外)指數。

98年度第2次國外委託經營國際股票型(自99年6月4日至102年1月31日止)						
受託機構名稱	委託金額 (美元)	資產淨值 (美元)	102年度報酬 率(%)	委託迄今		
				報酬率(%)	委託 經營 排名	指定指標報 酬率(%)
德盛安聯資產管理	250,000,000	358,406,038.11	5.02%	43.36%	1	34.38%
施罗德投資管理	250,000,000	336,577,995.87	5.18%	34.63%	2	
合計	500,000,000	694,984,033.98	5.10%	39.00%		

註：國際股票型本會指定指標為MSCI全球指數。

100年度第1次國外委託經營(自100年8月16日至102年1月31日止)

受託機構名稱	委託金額 (美元)	資產淨值 (美元)	102年度報酬 率(%)	委託迄今		
				報酬率(%)	委託 經營 排名	指定指標報 酬率(%)
施羅德投資管理	200,000,000	234,226,812.19	5.25%	17.11%	3	19.01%
景順德國資產管理	200,000,000	246,359,347.77	5.14%	23.18%	2	
德盛安聯資產管理	200,000,000	257,331,612.78	4.37%	28.67%	1	
國際股票型小計	600,000,000	737,917,772.74	4.91%	22.99%		
摩根資產管理	200,000,000	223,254,251.07	2.65%	11.63%	2	9.40%
瑞萬通博資產管理	200,000,000	236,536,558.07	1.72%	18.27%	1	
新興股票型小計	400,000,000	459,790,809.14	2.17%	14.95%		
合計	1,000,000,000	1,197,708,581.88	3.84%	19.77%		

註：1. 國際股票型本會指定指標為富時全球指數。

2. 新興股票型本會指定指標為MSCI新興市場(台灣除外)指數。

100年度第2次國外委託經營公司債券型(自101年6月7日至102年1月31日止)

受託機構名稱	委託金額 (美元)	資產淨值 (美元)	102年度報酬 率(%)	委託迄今		
				報酬率(%)	委託 經營 排名	指定指標報 酬率(%)
東方匯理資產管理	120,000,000	130,312,517.90	-0.59%	8.59%	1	7.55%
施羅德投資管理	120,000,000	129,606,219.49	-0.76%	8.01%	2	
貝萊德投資管理	120,000,000	128,891,237.33	-0.44%	7.41%	3	
合計	360,000,000	388,809,974.72	-0.60%	8.00%		

註：本會指定指標為巴克萊資本全球綜合公司債券指數。