

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2月28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	319,639,790.07	2.48%	27.86%	3	33.97%
德盛安聯資產管理	250,000,000	347,106,281.47	5.20%	38.84%	1	
貝萊德投資管理	250,000,000	325,937,511.60	5.00%	30.38%	2	
合計	750,000,000	992,683,583.14	4.24%	32.36%		

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2月28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	253,781,813.75	5.56%	26.89%	1	22.56%
瑞銀環球資產管理	200,000,000	252,208,786.85	5.88%	26.10%	2	
合計	400,000,000	505,990,600.60	5.72%	26.50%		

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2月28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	359,023,218.78	5.20%	43.61%	1	34.36%
施罗德投資管理	250,000,000	338,023,635.13	5.63%	35.21%	2	
合計	500,000,000	697,046,853.91	5.41%	39.41%		

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2月28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	234,881,567.43	5.55%	17.44%	3	18.93%
景順德國資產管理	200,000,000	248,954,245.18	6.25%	24.48%	2	
德盛安聯資產管理	200,000,000	258,332,869.21	4.77%	29.17%	1	
國際股票型小計	600,000,000	742,168,681.82	5.51%	23.69%		
摩根資產管理	200,000,000	221,757,891.71	1.96%	10.88%	2	8.11%
瑞萬通博資產管理	200,000,000	233,542,678.63	0.43%	16.77%	1	
新興股票型小計	400,000,000	455,300,570.34	1.17%	13.83%		
合計	1,000,000,000	1,197,469,252.16	3.82%	19.75%		

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2月28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	129,432,256.27	-1.26%	7.86%	1	7.00%
施羅德投資管理	120,000,000	128,805,328.83	-1.37%	7.34%	2	
貝萊德投資管理	120,000,000	128,040,139.94	-1.10%	6.70%	3	
合計	360,000,000	386,277,725.04	-1.24%	7.30%		

註：本會指定指標為巴克萊資本全球綜合公司債券指數。