

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3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	322,925,107.22	3.53	29.17	3	36.42
德盛安聯資產管理	250,000,000	354,290,680.27	7.38	41.72	1	
貝萊德投資管理	250,000,000	336,394,831.12	8.36	34.56	2	
合計	750,000,000	1,013,610,618.61	6.44	35.15		

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3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	247,495,677.08	2.95	23.75	2	20.52
瑞銀環球資產管理	200,000,000	250,226,467.73	5.04	25.11	1	
合計	400,000,000	497,722,144.81	3.99	24.43		

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3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	366,454,475.33	7.38	46.58	1	36.82
施羅德投資管理	250,000,000	339,894,386.80	6.22	35.96	2	
合計	500,000,000	706,348,862.13	6.81	41.27		

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3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	236,573,614.30	6.31	18.29	3	21.01
景順德國資產管理	200,000,000	252,652,793.79	7.83	26.33	2	
德盛安聯資產管理	200,000,000	262,762,480.91	6.57	31.38	1	
國際股票型小計	600,000,000	751,988,889.00	6.91	25.33		
摩根資產管理	200,000,000	218,021,448.25	0.25	9.01	2	6.36
瑞萬通博資產管理	200,000,000	235,845,551.58	1.42	17.92	1	
新興股票型小計	400,000,000	453,866,999.83	0.85	13.47		
合計	1,000,000,000	1,205,855,888.83	4.54	20.59		

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3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	128,944,405.93	-1.63	7.45	1	6.85
施羅德投資管理	120,000,000	128,526,271.22	-1.59	7.11	2	
貝萊德投資管理	120,000,000	127,751,010.72	-1.32	6.46	3	
合計	360,000,000	385,221,687.87	-1.51	7.01		

註：本會指定指標為巴克萊資本全球綜合公司債券指數。