

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4月30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	329,919,909.36	5.78	31.97	3	40.32
德盛安聯資產管理	250,000,000	362,992,034.14	10.02	45.20	1	
貝萊德投資管理	250,000,000	343,599,876.00	10.69	37.44	2	
合計	750,000,000	1,036,511,819.50	8.85	38.20		

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4月30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	258,330,783.77	7.45	29.17	1	23.38
瑞銀環球資產管理	200,000,000	254,997,548.70	7.05	27.50	2	
合計	400,000,000	513,328,332.47	7.25	28.33		

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4月30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	375,452,113.14	10.01	50.18	1	40.72
施羅德投資管理	250,000,000	347,956,301.78	8.73	39.18	2	
合計	500,000,000	723,408,414.92	9.39	44.68		

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4月30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	242,235,378.30	8.85	21.12	3	24.51
景順德國資產管理	200,000,000	259,190,557.28	10.62	29.60	2	
德盛安聯資產管理	200,000,000	270,520,602.64	9.71	35.26	1	
國際股票型小計	600,000,000	771,946,538.22	9.74	28.66		
摩根資產管理	200,000,000	218,545,553.51	0.49	9.27	2	6.91
瑞萬通博資產管理	200,000,000	243,038,046.09	4.51	21.52	1	
新興股票型小計	400,000,000	461,583,599.60	2.57	15.40		
合計	1,000,000,000	1,233,530,137.82	6.94	23.35		

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4月30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	132,698,668.17	1.23	10.58	1	9.38
施羅德投資管理	120,000,000	131,942,358.26	1.03	9.95	2	
貝萊德投資管理	120,000,000	130,984,797.49	1.17	9.15	3	
合計	360,000,000	395,625,823.92	1.14	9.90		

註：本會指定指標為巴克萊資本全球綜合公司債券指數。