

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5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	335,115,803.53	7.44	34.05	3	39.93
德盛安聯資產管理	250,000,000	363,749,908.41	10.25	45.50	1	
貝萊德投資管理	250,000,000	345,867,731.35	11.42	38.35	2	
合計	750,000,000	1,044,733,443.29	9.71	39.30		

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5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	252,298,703.05	4.94	26.15	1	17.51
瑞銀環球資產管理	200,000,000	243,750,149.31	2.33	21.88	2	
合計	400,000,000	496,048,852.36	3.64	24.01		

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5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	376,241,692.13	10.24	50.50	1	40.34
施羅德投資管理	250,000,000	351,428,412.45	9.82	40.57	2	
合計	500,000,000	727,670,104.58	10.04	45.53		

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5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	245,349,679.64	10.25	22.67	3	24.20
景順德國資產管理	200,000,000	258,772,055.84	10.44	29.39	2	
德盛安聯資產管理	200,000,000	268,938,111.72	9.07	34.47	1	
國際股票型小計	600,000,000	773,059,847.20	9.90	28.84		
摩根資產管理	200,000,000	212,202,120.99	-2.43	6.10	2	3.98
瑞萬通博資產管理	200,000,000	236,894,380.26	1.87	18.45	1	
新興股票型小計	400,000,000	449,096,501.25	-0.21	12.27		
合計	1,000,000,000	1,222,156,348.45	5.96	22.22		

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5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	129,842,261.38	-0.95	8.20	1	6.74
施羅德投資管理	120,000,000	128,454,381.84	-1.64	7.05	2	
貝萊德投資管理	120,000,000	128,108,598.29	-1.05	6.76	3	
合計	360,000,000	386,405,241.51	-1.21	7.33		

註：本會指定指標為巴克萊資本全球綜合公司債券指數。