

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6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	320,175,696.93	2.65	28.07	3	35.84
德盛安聯資產管理	250,000,000	354,462,507.69	7.43	41.79	1	
貝萊德投資管理	250,000,000	339,225,917.31	9.28	35.69	2	
合計	750,000,000	1,013,864,121.93	6.47	35.18		

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6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	233,734,079.58	-2.78	16.87	1	10.05
瑞銀環球資產管理	200,000,000	226,630,973.13	-4.86	13.32	2	
合計	400,000,000	460,365,052.71	-3.81	15.09		

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6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	366,611,221.20	7.42	46.64	1	36.24
施羅德投資管理	250,000,000	340,446,943.26	6.39	36.18	2	
合計	500,000,000	707,058,164.46	6.92	41.41		

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6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	238,126,075.82	7.01	19.06	3	20.59
景順德國資產管理	200,000,000	250,707,522.26	7.00	25.35	2	
德盛安聯資產管理	200,000,000	261,889,698.06	6.21	30.94	1	
國際股票型小計	600,000,000	750,723,296.14	6.73	25.12		
摩根資產管理	200,000,000	196,833,990.27	-9.50	-1.58	2	-3.54
瑞萬通博資產管理	200,000,000	220,576,769.64	-5.15	10.29	1	
新興股票型小計	400,000,000	417,410,759.91	-7.25	4.35		
合計	1,000,000,000	1,168,134,056.05	1.27	16.81		

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6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	126,132,670.61	-3.78	5.11	1	4.16
施羅德投資管理	120,000,000	124,674,633.06	-4.54	3.90	3	
貝萊德投資管理	120,000,000	124,947,314.06	-3.49	4.12	2	
合計	360,000,000	375,754,617.73	-3.94	4.38		

註：本會指定指標為巴克萊資本全球綜合公司債券指數。

101年度第1次國外委託經營新興債券型(自102年6月4日至102年6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(%)
Ashmore	200,000,000	189,426,122.08	-5.29	-5.29	3	-4.38
BlueBay	200,000,000	191,252,054.40	-4.37	-4.37	1	
Stone Harbor	200,000,000	189,547,912.97	-5.23	-5.23	2	
合計	600,000,000	570,226,089.45	-4.96	-4.96		

註：本會指定指標為JPMorgan新興市場美元外債指數(權重為70%)及JPMorgan新興市場當地貨幣債券指數(權重為30%)