

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7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 | 335,995,159.03 | 7.72 | 34.40 | 3 | 42.35 |
| 德盛安聯資產管理 | 250,000,000 | 374,528,251.60 | 13.51 | 49.81 | 1 | |
| 貝萊德投資管理 | 250,000,000 | 352,482,270.93 | 13.55 | 40.99 | 2 | |
| 合計 | 750,000,000 | 1,063,005,681.56 | 11.63 | 41.73 | | |

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7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 | 238,323,907.43 | -0.87 | 19.16 | 1 | 12.52 |
| 瑞銀環球資產管理 | 200,000,000 | 230,341,691.42 | -3.30 | 15.17 | 2 | |
| 合計 | 400,000,000 | 468,665,598.85 | -2.08 | 17.17 | | |

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7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 | 387,393,458.10 | 13.51 | 54.96 | 1 | 42.76 |
| 施羅德投資管理 | 250,000,000 | 356,270,082.56 | 11.33 | 42.51 | 2 | |
| 合計 | 500,000,000 | 743,663,540.66 | 12.46 | 48.73 | | |

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7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 | 248,958,895.12 | 11.88 | 24.48 | 3 | 26.32 |
| 景順德國資產管理 | 200,000,000 | 264,299,933.54 | 12.80 | 32.15 | 2 | |
| 德盛安聯資產管理 | 200,000,000 | 275,169,031.50 | 11.60 | 37.58 | 1 | |
| 國際股票型小計 | 600,000,000 | 788,427,860.16 | 12.09 | 31.40 | | |
| 摩根資產管理 | 200,000,000 | 199,887,706.71 | -8.09 | -0.06 | 2 | -2.64 |
| 瑞萬通博資產管理 | 200,000,000 | 220,143,296.02 | -5.33 | 10.07 | 1 | |
| 新興股票型小計 | 400,000,000 | 420,031,002.73 | -6.67 | 5.01 | | |
| 合計 | 1,000,000,000 | 1,208,458,862.89 | 4.77 | 20.85 | | |

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7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 | 128,262,422.85 | -2.15 | 6.89 | 1 | 5.80 |
| 施羅德投資管理 | 120,000,000 | 126,967,067.29 | -2.78 | 5.81 | 2 | |
| 貝萊德投資管理 | 120,000,000 | 126,827,937.44 | -2.04 | 5.69 | 3 | |
| 合計 | 360,000,000 | 382,057,427.58 | -2.32 | 6.13 | | |

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7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 (%) |
| Ashmore | 200,000,000 | 191,236,744.58 | -4.38 | -4.38 | 2 | -3.63 |
| BlueBay | 200,000,000 | 192,489,514.29 | -3.76 | -3.76 | 1 | |
| Stone Harbor | 200,000,000 | 191,102,363.45 | -4.45 | -4.45 | 3 | |
| 合計 | 600,000,000 | 574,828,622.32 | -4.20 | -4.20 | | |

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%)