

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8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	333,487,811.71	6.92	33.40	3	39.38
德盛安聯資產管理	250,000,000	365,578,676.12	10.80	46.23	1	
貝萊德投資管理	250,000,000	344,822,982.45	11.08	37.93	2	
合計	750,000,000	1,043,889,470.28	9.62	39.19		

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8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	235,433,757.48	-2.07	17.72	1	11.64
瑞銀環球資產管理	200,000,000	223,684,377.66	-6.10	11.84	2	
合計	400,000,000	459,118,135.14	-4.07	14.78		

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8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	378,132,048.71	10.80	51.25	1	39.78
施羅德投資管理	250,000,000	345,852,985.17	8.08	38.34	2	
合計	500,000,000	723,985,033.88	9.48	44.80		

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8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	241,996,580.56	8.75	21.00	3	23.69
景順德國資產管理	200,000,000	256,725,346.64	9.57	28.36	2	
德盛安聯資產管理	200,000,000	269,252,816.53	9.20	34.63	1	
國際股票型小計	600,000,000	767,974,743.73	9.18	28.00		
摩根資產管理	200,000,000	197,655,598.37	-9.12	-1.17	2	-4.75
瑞萬通博資產管理	200,000,000	202,736,045.20	-12.82	1.37	1	
新興股票型小計	400,000,000	400,391,643.57	-11.03	0.10		
合計	1,000,000,000	1,168,366,387.30	1.29	16.84		

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8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	127,377,864.98	-2.83	6.15	1	5.12
施羅德投資管理	120,000,000	125,788,426.48	-3.68	4.82	3	
貝萊德投資管理	120,000,000	125,966,169.55	-2.70	4.97	2	
合計	360,000,000	379,132,461.01	-3.07	5.31		

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8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	185,080,452.81	-7.46	-7.46	2	-6.49
BlueBay	200,000,000	185,486,536.44	-7.26	-7.26	1	
Stone Harbor	200,000,000	183,751,003.85	-8.12	-8.12	3	
合計	600,000,000	554,317,993.10	-7.61	-7.61		

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%)