

退撫基金國外委託經營績效統計表

單位：美元，%

98年度第1次國外委託經營續約國際股票型(自102年9月14日至102年11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	381,056,090.52	409,879,697.36	7.56	7.56	-	6.22
合計	381,056,090.52	409,879,697.36	7.56	7.56		

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11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	259,330,950.53	7.87	29.67	1	23.07
瑞銀環球資產管理	200,000,000	245,312,089.64	2.98	22.66	2	
合計	400,000,000	504,643,040.17	5.44	26.16		

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11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	423,949,321.17	24.22	69.58	1	55.08
施羅德投資管理	250,000,000	387,546,626.93	21.11	55.02	2	
合計	500,000,000	811,495,948.10	22.72	62.30		

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11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	271,004,294.66	21.78	35.50	3	37.24
景順德國資產管理	200,000,000	286,235,684.30	22.16	43.12	2	
德盛安聯資產管理	200,000,000	301,563,697.06	22.30	50.78	1	
國際股票型小計	600,000,000	858,803,676.02	22.09	43.13		
摩根資產管理	200,000,000	220,422,775.32	1.35	10.21	1	5.19
瑞萬通博資產管理	200,000,000	218,759,457.66	-5.93	9.38	2	
新興股票型小計	400,000,000	439,182,232.98	-2.41	9.80		
合計	1,000,000,000	1,297,985,909.00	12.53	29.80		

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11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	131,933,520.54	0.65	9.94	1	8.44
施羅德投資管理	120,000,000	129,983,183.68	-0.47	8.32	3	
貝萊德投資管理	120,000,000	130,011,291.66	0.42	8.34	2	
合計	360,000,000	391,927,995.88	0.20	8.87		

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11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	190,751,406.57	-4.62	-4.62	2	-3.32
BlueBay	200,000,000	191,688,769.47	-4.16	-4.16	1	
Stone Harbor	200,000,000	189,888,544.44	-5.06	-5.06	3	
合計	600,000,000	572,328,720.48	-4.61	-4.61		

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%)