

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12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	381,056,090.52	417,467,830.78	9.56	9.56	-	8.05
合計	381,056,090.52	417,467,830.78	9.56	9.56		

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12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	255,655,114.48	6.34	27.83	1	21.11
瑞銀環球資產管理	200,000,000	238,930,511.61	0.30	19.47	2	
合計	400,000,000	494,585,626.09	3.34	23.65		

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12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	431,807,824.07	26.53	72.72	1	57.75
施羅德投資管理	250,000,000	396,398,833.25	23.87	58.56	2	
合計	500,000,000	828,206,657.32	25.24	65.64		

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12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	277,275,889.06	24.60	38.64	3	39.59
景順德國資產管理	200,000,000	291,076,411.55	24.23	45.54	2	
德盛安聯資產管理	200,000,000	306,379,079.77	24.26	53.19	1	
國際股票型小計	600,000,000	874,731,380.38	24.36	45.79		
摩根資產管理	200,000,000	215,344,753.90	-0.99	7.67	2	3.36
瑞萬通博資產管理	200,000,000	217,820,486.21	-6.33	8.91	1	
新興股票型小計	400,000,000	433,165,240.11	-3.75	8.29		
合計	1,000,000,000	1,307,896,620.49	13.39	30.79		

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12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	132,581,690.44	1.14	10.48	1	8.44
施羅德投資管理	120,000,000	130,266,039.59	-0.25	8.56	2	
貝萊德投資管理	120,000,000	130,180,277.88	0.55	8.48	3	
合計	360,000,000	393,028,007.91	0.48	9.17		

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12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	190,370,998.70	-4.81	-4.81	2	-3.46
BlueBay	200,000,000	191,287,160.09	-4.36	-4.36	1	
Stone Harbor	200,000,000	188,507,045.01	-5.75	-5.75	3	
合計	600,000,000	570,165,203.80	-4.97	-4.97		

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%)