

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(續約)委託經營(自102年9月14日至103年1月31日止)						
受託機構名稱	委託金額 (美元)	資產淨值 (美元)	103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	401,590,291.92	-3.80	5.39	-	3.73
合計	381,056,090.52	401,590,291.92	-3.80	5.39		

註：本批次委託經營係國際股票型，本會指定指標為MSCI全球指數。

98年度第2次委託經營(自99年4月28日至103年1月31日止)						
受託機構名稱	委託金額 (美元)	資產淨值 (美元)	103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	245,245,483.49	-4.07	22.62	1	14.68
瑞銀環球資產管理	200,000,000	227,862,991.42	-4.63	13.93	2	
合計	400,000,000	473,108,474.91	-4.34	18.28		

註：本批次委託經營係亞太股票型，本會指定指標為MSCI亞太(日本、臺灣除外)指數。

98年度第2次委託經營(自99年6月4日至103年1月31日止)						
受託機構名稱	委託金額 (美元)	資產淨值 (美元)	103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	415,385,061.84	-3.80	66.15	1	51.44
施羅德投資管理	250,000,000	377,959,180.86	-4.65	51.18	2	
合計	500,000,000	793,344,242.70	-4.21	58.67		

註：本批次委託經營係國際股票型，本會指定指標為MSCI全球指數。

100年度第1次委託經營(自100年8月16日至103年1月31日止)						
受託機構名稱	委託金額 (美元)	資產淨值 (美元)	103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	264,262,060.41	-4.69	32.13	3	34.01
景順德國資產管理	200,000,000	281,677,189.08	-3.23	40.84	2	
德盛安聯資產管理	200,000,000	293,905,870.20	-4.07	46.95	1	
國際股票型小計	600,000,000	839,845,119.69	-3.99	39.97		
摩根資產管理	200,000,000	197,816,165.18	-8.14	-1.09	2	-3.32
瑞萬通博資產管理	200,000,000	203,809,360.68	-6.43	1.90	1	
新興股票型小計	400,000,000	401,625,525.86	-7.28	0.41		
合計	1,000,000,000	1,241,470,645.55	-5.08	24.15		

註：本批次委託經營係國際股票型及新興股票型，本會指定指標分別為富時全球指數及MSCI新興市場(台灣除外)指數。

100年度第2次委託經營(自101年6月7日至103年1月31日止)						
受託機構名稱	委託金額 (美元)	資產淨值 (美元)	103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	133,196,227.97	0.46	11.00	1	9.40
施羅德投資管理	120,000,000	131,265,364.81	0.77	9.39	2	
貝萊德投資管理	120,000,000	131,187,922.11	0.77	9.32	3	
合計	360,000,000	395,649,514.89	0.67	9.90		

註：本批次委託經營係公司債券型，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次委託經營(自102年6月4日至103年1月31日止)						
受託機構名稱	委託金額 (美元)	資產淨值 (美元)	103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	187,930,746.21	-1.28	-6.03	2	-4.70
BlueBay	200,000,000	187,978,851.10	-1.73	-6.01	1	
Stone Harbor	200,000,000	186,028,985.51	-1.31	-6.99	3	
合計	600,000,000	561,938,582.82	-1.44	-6.34		

註：本批次委託經營係新興債券型，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%)。