

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103年2月28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	420,953,690.89	0.84	10.47	-	8.74
合計	381,056,090.52	420,953,690.89	0.84	10.47		

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103年2月28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	258,371,225.13	1.06	29.19	1	20.30
瑞銀環球資產管理	200,000,000	238,939,772.68	0.00	19.47	2	
合計	400,000,000	497,310,997.81	0.55	24.33		

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103年2月28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	435,402,093.71	0.83	74.16	1	58.76
施羅德投資管理	250,000,000	400,064,381.83	0.92	60.03	2	
合計	500,000,000	835,466,475.54	0.88	67.09		

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103年2月28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	279,406,807.52	0.77	39.70	3	40.34
景順德國資產管理	200,000,000	294,320,750.05	1.11	47.16	2	
德盛安聯資產管理	250,000,000	358,571,341.79	0.26	53.59	1	
國際股票型小計	650,000,000	932,298,899.36	0.70	46.82		
摩根資產管理	200,000,000	204,270,828.36	-5.14	2.14	2	0.15
瑞萬通博資產管理	200,000,000	211,369,325.42	-2.96	5.68	1	
新興股票型小計	400,000,000	415,640,153.78	-4.05	3.91		
合計	1,050,000,000	1,347,939,053.14	-0.86	29.66		

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103年2月28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	135,485,655.44	2.19	12.90	1	11.19
施羅德投資管理	120,000,000	133,533,337.20	2.51	11.28	2	
貝萊德投資管理	120,000,000	133,484,379.01	2.54	11.24	3	
合計	360,000,000	402,503,371.65	2.41	11.81		

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103年2月28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	192,848,342.49	1.30	-3.58	2	-1.76
BlueBay	200,000,000	194,165,256.03	1.50	-2.92	1	
Stone Harbor	200,000,000	191,518,449.95	1.60	-4.24	3	
合計	600,000,000	578,532,048.47	1.47	-3.58		

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%)