

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3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	425,503,698.14	1.92	11.66	-	9.22
合計	381,056,090.52	425,503,698.14	1.92	11.66		

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3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	258,682,200.12	1.18	29.34	1	22.30
瑞銀環球資產管理	200,000,000	239,886,937.42	0.40	19.94	2	
合計	400,000,000	498,569,137.54	0.81	24.64		

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3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	440,058,110.93	1.91	76.02	1	59.46
施罗德投資管理	250,000,000	397,291,049.04	0.23	58.92	2	
合計	500,000,000	837,349,159.97	1.10	67.47		

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3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	277,270,681.57	0.00	38.64	3	41.09
景順德國資產管理	200,000,000	298,434,200.78	2.53	49.22	2	
德盛安聯資產管理	250,000,000	366,539,378.74	2.49	57.00	1	
國際股票型小計	650,000,000	942,244,261.09	1.78	48.38		
摩根資產管理	200,000,000	209,118,337.80	-2.89	4.56	2	3.20
瑞萬通博資產管理	200,000,000	222,150,665.29	1.99	11.08	1	
新興股票型小計	400,000,000	431,269,003.09	-0.44	7.82		
合計	1,050,000,000	1,373,513,264.18	1.02	32.12		

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3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	135,622,940.99	2.29	13.02	1	11.27
施羅德投資管理	120,000,000	133,650,089.73	2.60	11.38	2	
貝萊德投資管理	120,000,000	133,607,191.96	2.63	11.34	3	
合計	360,000,000	402,880,222.68	2.51	11.91		

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3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	195,282,567.44	2.58	-2.36	2	-0.51
BlueBay	200,000,000	196,191,373.65	2.56	-1.90	1	
Stone Harbor	200,000,000	193,459,180.42	2.63	-3.27	3	
合計	600,000,000	584,933,121.51	2.59	-2.51		

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%)