

退撫基金國外委託經營績效統計表

單位：美元，%

98年度第1次國外委託經營國際股票型續約(自102年9月14日至103年4月30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	427,458,761.89	2.39	12.18	-	10.26
合計	381,056,090.52	427,458,761.89	2.39	12.18		

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續約(自103年4月28日至103年4月30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	263,076,477.07	261,874,264.56	-0.46	-0.46	-	-0.55
合計	263,076,477.07	261,874,264.56	-0.46	-0.46		

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次國外委託經營亞太股票型未續約移轉管理(自99年4月28日至103年4月30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(%)
移轉管理 (原瑞銀環球)	200,000,000	241,835,897.11	1.22	20.92	-	-
合計	200,000,000	241,835,897.11	1.22	20.92		

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4月30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	442,101,568.87	2.38	76.84	1	60.98
施羅德投資管理	250,000,000	398,902,376.56	0.63	59.56	2	
合計	500,000,000	841,003,945.43	1.55	68.20		

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4月30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	278,273,351.14	0.36	39.14	3	42.40
景順德國資產管理	200,000,000	299,956,368.42	3.05	49.98	2	
德盛安聯資產管理	250,000,000	369,955,373.35	3.45	58.47	1	
國際股票型小計	650,000,000	948,185,092.91	2.42	49.32		
摩根資產管理	200,000,000	209,798,973.89	-2.58	4.90	2	3.52
瑞萬通博資產管理	200,000,000	223,005,893.69	2.38	11.50	1	
新興股票型小計	400,000,000	432,804,867.58	-0.08	8.20		
合計	1,050,000,000	1,380,989,960.49	1.57	32.84		

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4月30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	137,491,422.07	3.70	14.58	1	12.76
施羅德投資管理	120,000,000	135,386,027.34	3.93	12.82	3	
貝萊德投資管理	120,000,000	135,445,785.17	4.04	12.87	2	
合計	360,000,000	408,323,234.58	3.89	13.42		

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4月30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	196,770,613.18	3.36	-1.61	2	0.64
BlueBay	200,000,000	198,941,922.64	4.00	-0.53	1	
Stone Harbor	200,000,000	195,903,165.61	3.92	-2.05	3	
合計	600,000,000	591,615,701.43	3.76	-1.40		

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%)