

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9月30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	383,344,255.53	0.60	0.60	-	0.69
合計	381,056,090.52	383,344,255.53	0.60	0.60		

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9月30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	250,326,983.27	4.12	25.16	1	18.70
瑞銀環球資產管理	200,000,000	238,550,432.55	0.14	19.28	2	
合計	400,000,000	488,877,415.82	2.14	22.22		

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9月30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	396,530,020.89	16.19	58.61	1	47.00
施羅德投資管理	250,000,000	365,100,083.34	14.09	46.04	2	
合計	500,000,000	761,630,104.23	15.17	52.33		

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9月30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	255,151,508.54	14.66	27.58	3	30.13
景順德國資產管理	200,000,000	267,901,287.01	14.34	33.95	2	
德盛安聯資產管理	200,000,000	281,938,298.66	14.35	40.97	1	
國際股票型小計	600,000,000	804,991,094.21	14.44	34.17		
摩根資產管理	200,000,000	212,600,357.60	-2.25	6.30	2	1.92
瑞萬通博資產管理	200,000,000	216,696,989.21	-6.82	8.35	1	
新興股票型小計	400,000,000	429,297,346.81	-4.61	7.32		
合計	1,000,000,000	1,234,288,441.02	7.01	23.43		

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9月30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	129,670,166.30	-1.08	8.06	1	7.09
施羅德投資管理	120,000,000	128,335,570.49	-1.73	6.95	2	
貝萊德投資管理	120,000,000	128,246,949.67	-0.94	6.87	3	
合計	360,000,000	386,252,686.46	-1.25	7.29		

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9月30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	190,677,686.94	-4.66	-4.66	3	-3.31
BlueBay	200,000,000	192,791,377.26	-3.60	-3.60	1	
Stone Harbor	200,000,000	191,308,922.73	-4.35	-4.35	2	
合計	600,000,000	574,777,986.93	-4.20	-4.20		

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%)