

退撫基金國外委託經營績效統計表

單位：美元，%

98年度第1次國外委託經營績約國際股票型(自102年9月14日至102年10月31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	400,117,589.26	5.00	5.00	-	4.73
合計	381,056,090.52	400,117,589.26	5.00	5.00		

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10月31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	261,256,125.15	8.67	30.63	1	24.28
瑞銀環球資產管理	200,000,000	249,327,666.35	4.67	24.66	2	
合計	400,000,000	510,583,791.50	6.68	27.65		

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10月31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	413,888,965.00	21.28	65.56	1	52.91
施羅德投資管理	250,000,000	381,346,052.93	19.17	52.54	2	
合計	500,000,000	795,235,017.93	20.26	59.05		

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10月31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	266,300,716.34	19.67	33.15	3	35.34
景順德國資產管理	200,000,000	279,077,312.40	19.11	39.54	2	
德盛安聯資產管理	200,000,000	294,591,341.75	19.48	47.30	1	
國際股票型小計	600,000,000	839,969,370.49	19.41	39.99		
摩根資產管理	200,000,000	222,213,831.61	2.17	11.11	2	6.79
瑞萬通博資產管理	200,000,000	227,708,482.75	-2.08	13.85	1	
新興股票型小計	400,000,000	449,922,314.36	-0.02	12.48		
合計	1,000,000,000	1,289,891,684.85	11.83	28.99		

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10月31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	132,001,415.70	0.70	10.00	1	8.57
施羅德投資管理	120,000,000	130,320,141.73	-0.21	8.60	2	
貝萊德投資管理	120,000,000	130,105,285.80	0.50	8.42	3	
合計	360,000,000	392,426,843.23	0.33	9.01		

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10月31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	195,043,147.74	-2.48	-2.48	3	-1.12
BlueBay	200,000,000	197,037,552.52	-1.48	-1.48	1	
Stone Harbor	200,000,000	195,525,114.13	-2.24	-2.24	2	
合計	600,000,000	587,605,814.39	-2.07	-2.07		

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%)