

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9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	436,711,082.81	4.61	14.61	-	12.08
合計	381,056,090.52	436,711,082.81	4.61	14.61		

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9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	262,285,039.47	-0.30	-0.30	-	0.51
合計	263,076,477.07	262,285,039.47	-0.30	-0.30		

註：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續約(自103年6月4日至103年9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	454,341,586.67	451,650,131.70	-0.59	-0.59	-	-0.60
合計	454,341,586.67	451,650,131.70	-0.59	-0.59		

註：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9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	282,743,510.81	1.97	41.37	3	44.91
景順德國資產管理	200,000,000	308,005,416.09	5.82	54.00	2	
德盛安聯資產管理	250,000,000	376,077,605.78	5.16	61.09	1	
國際股票型小計	650,000,000	966,826,532.68	4.43	52.25		
摩根資產管理	200,000,000	212,094,505.39	-1.51	6.05	2	6.10
瑞萬通博資產管理	200,000,000	234,987,710.71	7.88	17.49	1	
新興股票型小計	400,000,000	447,082,216.10	3.21	11.77		
合計	1,050,000,000	1,413,908,748.78	3.99	36.01		

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9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	136,410,057.66	2.89	13.68	1	11.79
施羅德投資管理	120,000,000	133,783,609.65	2.70	11.49	3	
貝萊德投資管理	120,000,000	134,274,769.89	3.15	11.90	2	
合計	360,000,000	404,468,437.20	2.91	12.35		

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9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	198,716,448.45	4.38	-0.64	2	1.96
BlueBay	200,000,000	199,103,749.53	4.09	-0.45	1	
Stone Harbor	200,000,000	197,686,797.79	4.87	-1.16	3	
合計	600,000,000	595,506,995.77	4.44	-0.75		

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%)