

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10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	443,680,724.80	6.28	16.43	-	12.87
合計	381,056,090.52	443,680,724.80	6.28	16.43		

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10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	263,076,477.07	272,061,138.28	3.42	3.42	-	3.29
合計	263,076,477.07	272,061,138.28	3.42	3.42		

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10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	454,341,586.67	458,874,939.75	1.00	1.00	-	0.10
合計	454,341,586.67	458,874,939.75	1.00	1.00		

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10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	283,659,203.00	2.30	41.83	3	45.90
景順德國資產管理	200,000,000	311,271,125.03	6.94	55.64	2	
德盛安聯資產管理	250,000,000	379,769,355.41	6.19	62.67	1	
國際股票型小計	650,000,000	974,699,683.44	5.28	53.49		
摩根資產管理	200,000,000	214,527,180.52	-0.38	7.26	2	6.96
瑞萬通博資產管理	200,000,000	242,156,381.62	11.17	21.08	1	
新興股票型小計	400,000,000	456,683,562.14	5.43	14.17		
合計	1,050,000,000	1,431,383,245.58	5.27	37.69		

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10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	137,115,316.30	3.42	14.26	1	12.24
施羅德投資管理	120,000,000	134,164,178.06	2.99	11.80	3	
貝萊德投資管理	120,000,000	134,544,665.89	3.35	12.12	2	
合計	360,000,000	405,824,160.25	3.26	12.73		

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10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	201,592,737.70	5.89	0.80	2	3.78
BlueBay	200,000,000	201,963,313.33	5.58	0.98	1	
Stone Harbor	200,000,000	200,785,593.22	6.51	0.39	3	
合計	600,000,000	604,341,644.25	5.99	0.72		

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%)。

102年度第1次國外委託經營高股利股票型(自103年10月1日至103年10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	125,000,000	125,849,320.62	0.68	0.68	1	-0.24
貝萊德投資管理	125,000,000	123,970,620.26	-0.82	-0.82	2	
合計	250,000,000	249,819,940.88	-0.07	-0.07		

註：本會指定指標為MSCI全球高股利指數(臺灣除外)。