

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11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	452,627,977.93	8.42	18.78	-	14.76
合計	381,056,090.52	452,627,977.93	8.42	18.78		

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11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	270,844,103.71	2.95	2.95	-	1.59
合計	263,076,477.07	270,844,103.71	2.95	2.95		

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11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	468,115,107.69	3.03	3.03	-	1.77
合計	454,341,586.67	468,115,107.69	3.03	3.03		

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11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	289,000,836.24	4.23	44.50	3	48.33
景順德國資產管理	200,000,000	315,187,300.78	8.28	57.59	2	
德盛安聯資產管理	250,000,000	384,663,239.19	7.56	64.77	1	
國際股票型小計	650,000,000	988,851,376.21	6.81	55.72		
摩根資產管理	200,000,000	213,301,957.38	-0.95	6.65	2	5.44
瑞萬通博資產管理	200,000,000	242,053,703.52	11.13	21.03	1	
新興股票型小計	400,000,000	455,355,660.90	5.12	13.84		
合計	1,050,000,000	1,444,207,037.11	6.22	38.92		

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11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	137,782,836.57	3.92	14.82	1	12.54
施羅德投資管理	120,000,000	134,715,521.26	3.42	12.26	3	
貝萊德投資管理	120,000,000	134,976,077.97	3.68	12.48	2	
合計	360,000,000	407,474,435.80	3.68	13.19		

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11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	200,672,104.22	5.41	0.34	2	3.81
BlueBay	200,000,000	201,815,047.99	5.50	0.91	1	
Stone Harbor	200,000,000	200,066,439.89	6.13	0.03	3	
合計	600,000,000	602,553,592.10	5.68	0.43		

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11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	125,000,000	128,144,936.58	2.52	2.52	1	0.57
貝萊德投資管理	125,000,000	124,771,741.61	-0.18	-0.18	2	
合計	250,000,000	252,916,678.19	1.17	1.17		

註：本會指定指標為MSCI全球高股利指數(臺灣除外)。