

退撫基金國外委託經營績效統計表

單位：美元，%

第4次續約-國際股票型(自102年9月14日至103年12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	447,523,953.50	7.20	17.44	-	12.55
合計	381,056,090.52	447,523,953.50	7.20	17.44		

註：本會指定指標為MSCI全球指數。

第5次續約-亞太股票型(自103年4月28日至103年12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	265,064,742.43	0.76	0.76	-	-0.56
合計	263,076,477.07	265,064,742.43	0.76	0.76		

註：本會指定指標為MSCI亞太(日本、臺灣除外)指數。

第5次續約-國際股票型(自103年6月4日至103年12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	462,831,998.60	1.87	1.87	-	-0.19
合計	454,341,586.67	462,831,998.60	1.87	1.87		

註：本會指定指標為MSCI全球指數。

第6次-國際股票型及新興股票型(自100年8月16日至103年12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	282,896,993.07	2.03	41.45	3	45.49
景順德國資產管理	200,000,000	310,768,322.19	6.77	55.38	2	
德盛安聯資產管理	250,000,000	380,216,757.17	6.31	62.86	1	
國際股票型小計	650,000,000	973,882,072.43	5.20	53.36		
摩根資產管理	200,000,000	201,903,801.67	-6.24	0.95	2	0.32
瑞萬通博資產管理	200,000,000	228,234,673.29	4.78	14.12	1	
新興股票型小計	400,000,000	430,138,474.96	-0.70	7.53		
合計	1,050,000,000	1,404,020,547.39	3.26	35.06		

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。

第7次-公司債券型(自101年6月7日至103年12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	137,016,024.85	3.34	14.18	1	11.86
施羅德投資管理	120,000,000	133,690,464.22	2.63	11.41	3	
貝萊德投資管理	120,000,000	134,005,680.23	2.94	11.67	2	
合計	360,000,000	404,712,169.30	2.97	12.42		

註：本會指定指標為巴克萊資本全球綜合公司債券指數。

第8次-新興債券型(自102年6月4日至103年12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	194,927,236.01	2.39	-2.54	2	1.29
BlueBay	200,000,000	197,288,391.71	3.14	-1.36	1	
Stone Harbor	200,000,000	194,023,223.69	2.93	-2.99	3	
合計	600,000,000	586,238,851.41	2.82	-2.29		

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%)。

第9次-高股利股票型(自103年10月1日至103年12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	126,813,458.71	1.45	1.45	1	-2.37
貝萊德投資管理	125,000,000	121,183,623.82	-3.05	-3.05	2	
合計	250,000,000	247,997,082.53	-0.80	-0.80		

註：本會指定指標為MSCI全球高股利指數(臺灣除外)。