

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104年1月31日止)						
受託機構名稱	委託金額 (美元)	資產淨值 (美元)	104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	438,843,594.78	-1.94	15.17	-	10.79
合計	381,056,090.52	438,843,594.78	-1.94	15.17		

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104年1月31日止)						
受託機構名稱	委託金額 (美元)	資產淨值 (美元)	104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	269,341,123.69	1.61	2.38	-	0.99
合計	263,076,477.07	269,341,123.69	1.61	2.38		

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104年1月31日止)						
受託機構名稱	委託金額 (美元)	資產淨值 (美元)	104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	453,872,077.63	-1.94	-0.10	-	-1.75
合計	454,341,586.67	453,872,077.63	-1.94	-0.10		

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104年1月31日止)						
受託機構名稱	委託金額 (美元)	資產淨值 (美元)	104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	277,497,359.82	-1.91	38.75	3	43.33
景順德國資產管理	200,000,000	306,139,718.06	-1.49	53.07	2	
德盛安聯資產管理	250,000,000	373,139,014.35	-1.86	59.83	1	
國際股票型小計	650,000,000	956,776,092.23	-1.76	50.67		
摩根資產管理	200,000,000	201,695,404.94	-0.10	0.85	2	0.99
瑞萬通博資產管理	200,000,000	234,750,603.05	2.85	17.38	1	
新興股票型小計	400,000,000	436,446,007.99	1.47	9.11		
合計	1,050,000,000	1,393,222,100.22	-0.77	34.02		

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104年1月31日止)						
受託機構名稱	委託金額 (美元)	資產淨值 (美元)	104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	138,009,992.55	0.73	15.01	1	12.31
施羅德投資管理	120,000,000	134,298,335.37	0.45	11.92	3	
貝萊德投資管理	120,000,000	134,305,361.15	0.22	11.92	2	
合計	360,000,000	406,613,689.07	0.47	12.95		

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104年1月31日止)						
受託機構名稱	委託金額 (美元)	資產淨值 (美元)	104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	197,446,414.70	1.29	-1.28	2	2.71
BlueBay	200,000,000	200,305,485.97	1.53	0.15	1	
Stone Harbor	200,000,000	196,240,152.48	1.14	-1.88	3	
合計	600,000,000	593,992,053.15	1.32	-1.00		

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104年1月31日止)						
受託機構名稱	委託金額 (美元)	資產淨值 (美元)	104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	125,176,879.36	-1.29	0.14	1	-3.71
貝萊德投資管理	125,000,000	119,445,270.52	-1.43	-4.44	2	
合計	250,000,000	244,622,149.88	-1.36	-2.15		

註：本會指定指標為MSCI全球高股利指數(臺灣除外)。