

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2月28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	463,400,017.22	3.55	21.61	-	16.95
合計	381,056,090.52	463,400,017.22	3.55	21.61		

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2月28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	276,870,933.84	4.45	5.24	-	4.14
合計	263,076,477.07	276,870,933.84	4.45	5.24		

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2月28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	479,246,038.36	3.55	5.48	-	3.72
合計	454,341,586.67	479,246,038.36	3.55	5.48		

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2月28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	295,366,830.28	4.41	47.68	3	51.24
景順德國資產管理	200,000,000	326,068,803.14	4.92	63.03	2	
德盛安聯資產管理	250,000,000	395,477,877.91	4.01	69.40	1	
國際股票型小計	650,000,000	1,016,913,511.33	4.42	60.14		
摩根資產管理	200,000,000	207,235,393.51	2.64	3.62	2	3.94
瑞萬通博資產管理	200,000,000	238,849,169.01	4.65	19.42	1	
新興股票型小計	400,000,000	446,084,562.52	3.71	11.52		
合計	1,050,000,000	1,462,998,073.85	4.20	40.73		

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2月28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	137,844,715.77	0.60	14.87	1	11.69
施羅德投資管理	120,000,000	134,166,812.24	0.36	11.81	2	
貝萊德投資管理	120,000,000	133,658,836.90	-0.26	11.38	3	
合計	360,000,000	405,670,364.91	0.24	12.69		

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2月28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	197,041,911.16	1.08	-1.48	2	2.47
BlueBay	200,000,000	198,590,156.37	0.66	-0.70	1	
Stone Harbor	200,000,000	196,135,844.27	1.09	-1.93	3	
合計	600,000,000	591,767,911.80	0.94	-1.37		

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2月28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	131,520,899.05	3.71	5.22	1	0.30
貝萊德投資管理	125,000,000	124,383,597.99	2.64	-0.49	2	
合計	250,000,000	255,904,497.04	3.19	2.36		

註：本會指定指標為MSCI全球高股利指數(臺灣除外)。