

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5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	438,089,951.97	4.94	14.97	-	12.61
合計	381,056,090.52	438,089,951.97	4.94	14.97		

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5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	268,108,219.51	1.91	1.91	-	2.57
合計	263,076,477.07	268,108,219.51	1.91	1.91		

註：亞太股票型本會指定指標為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(自99年6月4日至103年5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	250,000,000	453,085,051.30	4.93	81.23	1	64.41
施羅德投資管理	250,000,000	410,599,781.65	3.58	64.24	2	
合計	500,000,000	863,684,832.95	4.28	72.74		

註：國際股票型本會指定指標為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5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	286,163,533.87	3.21	43.08	3	45.48
景順德國資產管理	200,000,000	306,536,919.68	5.31	53.27	2	
德盛安聯資產管理	250,000,000	380,279,942.19	6.33	62.89	1	
國際股票型小計	650,000,000	972,980,395.74	5.10	53.22		
摩根資產管理	200,000,000	216,671,206.54	0.62	8.34	2	6.98
瑞萬通博資產管理	200,000,000	231,756,542.52	6.40	15.88	1	
新興股票型小計	400,000,000	448,427,749.06	3.52	12.11		
合計	1,050,000,000	1,421,408,144.80	4.54	36.73		

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。

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5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	138,205,736.15	4.24	15.17	1	13.64
施羅德投資管理	120,000,000	136,387,121.26	4.70	13.66	2	
貝萊德投資管理	120,000,000	136,232,653.84	4.65	13.53	3	
合計	360,000,000	410,825,511.25	4.53	14.12		

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5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	202,589,585.20	6.42	1.29	2	3.52
BlueBay	200,000,000	203,923,925.76	6.61	1.96	1	
Stone Harbor	200,000,000	201,342,997.70	6.81	0.67	3	
合計	600,000,000	607,856,508.66	6.61	1.31		

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%)