

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7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	442,409,380.39	5.97	16.10	-	13.33
合計	381,056,090.52	442,409,380.39	5.97	16.10		

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7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	279,995,323.19	6.43	6.43	-	7.98
合計	263,076,477.07	279,995,323.19	6.43	6.43		

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續約(自103年6月4日至103年7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	457,530,417.52	0.70	0.70	-	0.51
合計	454,341,586.67	457,530,417.52	0.70	0.70		

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7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	284,018,385.83	2.43	42.01	3	46.49
景順德國資產管理	200,000,000	309,336,421.40	6.27	54.67	2	
德盛安聯資產管理	250,000,000	385,309,204.13	7.74	65.04	1	
國際股票型小計	650,000,000	978,664,011.36	5.71	54.12		
摩根資產管理	200,000,000	224,857,533.53	4.42	12.43	2	11.70
瑞萬通博資產管理	200,000,000	242,812,300.24	11.47	21.41	1	
新興股票型小計	400,000,000	467,669,833.77	7.97	16.92		
合計	1,050,000,000	1,446,333,845.13	6.37	39.13		

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7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	138,259,380.69	4.28	15.22	1	13.49
施羅德投資管理	120,000,000	136,092,767.02	4.47	13.41	3	
貝萊德投資管理	120,000,000	136,219,048.81	4.64	13.52	2	
合計	360,000,000	410,571,196.52	4.46	14.05		

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7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	202,222,733.89	6.23	1.11	2	3.55
BlueBay	200,000,000	202,629,027.84	5.93	1.31	1	
Stone Harbor	200,000,000	200,999,033.02	6.63	0.50	3	
合計	600,000,000	605,850,794.75	6.26	0.98		

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%)