

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8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	451,590,597.43	8.17	18.51	-	15.84
合計	381,056,090.52	451,590,597.43	8.17	18.51		

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8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	281,957,636.51	7.18	7.18	-	8.41
合計	263,076,477.07	281,957,636.51	7.18	7.18		

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8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	467,000,165.93	2.79	2.79	-	2.73
合計	454,341,586.67	467,000,165.93	2.79	2.79		

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8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	291,301,296.47	5.06	45.65	3	49.72
景順德國資產管理	200,000,000	319,243,408.64	9.68	59.62	2	
德盛安聯資產管理	250,000,000	392,859,816.33	9.85	68.28	1	
國際股票型小計	650,000,000	1,003,404,521.44	8.39	58.01		
摩根資產管理	200,000,000	231,670,914.47	7.58	15.84	2	14.16
瑞萬通博資產管理	200,000,000	250,186,365.43	14.86	25.09	1	
新興股票型小計	400,000,000	481,857,279.90	11.24	20.46		
合計	1,050,000,000	1,485,261,801.34	9.24	42.87		

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8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	139,495,826.40	5.22	16.25	1	14.44
施羅德投資管理	120,000,000	137,272,612.87	5.38	14.39	3	
貝萊德投資管理	120,000,000	137,342,828.88	5.50	14.45	2	
合計	360,000,000	414,111,268.15	5.36	15.03		

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8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	205,106,020.13	7.74	2.55	2	5.07
BlueBay	200,000,000	205,914,705.14	7.65	2.96	1	
Stone Harbor	200,000,000	203,408,500.19	7.90	1.70	3	
合計	600,000,000	614,429,225.46	7.76	2.40		

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%)