

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7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	465,197,741.03	3.95	22.08	-	16.55
合計	381,056,090.52	465,197,741.03	3.95	22.08		

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7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	266,752,407.28	0.64	1.40	-	-2.26
合計	263,076,477.07	266,752,407.28	0.64	1.40		

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7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	481,100,274.38	3.95	5.89	-	3.36
合計	454,341,586.67	481,100,274.38	3.95	5.89		

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7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	303,781,425.90	7.38	51.89	3	50.83
景順德國資產管理	200,000,000	324,965,899.54	4.57	62.48	2	
德盛安聯資產管理	250,000,000	398,448,791.26	4.80	70.67	1	
國際股票型小計	650,000,000	1,027,196,116.70	5.47	61.76		
摩根資產管理	200,000,000	190,060,697.90	-5.87	-4.97	2	-3.26
瑞萬通博資產管理	200,000,000	225,113,120.82	-1.37	12.56	1	
新興股票型小計	400,000,000	415,173,818.72	-3.48	3.79		
合計	1,050,000,000	1,442,369,935.42	2.73	38.75		

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7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	133,323,110.16	-2.70	11.10	1	9.25
施羅德投資管理	120,000,000	130,301,988.30	-2.53	8.58	2	
貝萊德投資管理	120,000,000	130,284,605.00	-2.78	8.57	3	
合計	360,000,000	393,909,703.46	-2.67	9.42		

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7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	191,683,511.33	-1.66	-4.16	1	-0.05
BlueBay	200,000,000	189,911,583.93	-3.74	-5.04	3	
Stone Harbor	200,000,000	190,882,962.06	-1.62	-4.56	2	
合計	600,000,000	572,478,057.32	-2.35	-4.59		

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7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	132,211,039.03	4.26	5.77	1	-1.98
貝萊德法人信託	125,000,000	124,731,194.58	2.93	-0.22	2	
合計	250,000,000	256,942,233.61	3.61	2.78		

註：本會指定指標為MSCI全球高股利指數(臺灣除外)。

第9次-低波動股票型(自104年6月1日至104年7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 (%)
貝萊德法人信託	125,000,000	125,046,253.56	0.04	0.04	2	-0.04
瑞銀環球資產管理	125,000,000	125,115,919.49	0.09	0.09	1	
合計	250,000,000	250,162,173.05	0.06	0.06		

註：本會指定指標為MSCI全球低波動指數(臺灣除外)。

第10次-基礎建設股票型(自104年3月18日至104年7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 (%)
德意志資產管理	75,000,000	72,796,540.12	-2.94	-2.94	2	-0.80
Cohen & Steers	75,000,000	74,821,144.47	-0.24	-0.24	1	
合計	150,000,000	147,617,684.59	-1.59	-1.59		

註：本會指定指標為道瓊Brookfield全球基礎建設指數。

第10次-不動產股票型(自104年6月1日至104年7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 (%)
Cornerstone	75,000,000	74,482,714.53	-0.69	-0.69	1	-1.79
Cohen & Steers	75,000,000	73,957,097.74	-1.39	-1.39	2	
合計	150,000,000	148,439,812.27	-1.04	-1.04		

註：本會指定指標為富時歐洲/北美不動產協會全球指數。