

## 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8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	433,349,092.78	-3.17	13.72	-	8.56
<b>合計</b>	<b>381,056,090.52</b>	<b>433,349,092.78</b>	<b>-3.17</b>	<b>13.72</b>		

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8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	<b>263,076,477.07</b>	240,089,085.64	-9.42	-8.74	-	-12.46
<b>合計</b>	<b>263,076,477.07</b>	<b>240,089,085.64</b>	<b>-9.42</b>	<b>-8.74</b>		

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8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	448,163,746.63	-3.17	-1.36	-	-3.73
<b>合計</b>	<b>454,341,586.67</b>	<b>448,163,746.63</b>	<b>-3.17</b>	<b>-1.36</b>		

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8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	282,303,732.41	-0.21	41.15	3	40.57
景順德國資產管理	200,000,000	305,083,581.10	-1.83	52.54	2	
德盛安聯資產管理	250,000,000	372,276,727.76	-2.09	59.46	1	
<b>國際股票型小計</b>	<b>650,000,000</b>	<b>959,664,041.27</b>	<b>-1.46</b>	<b>51.12</b>		
瑞萬通博資產管理	200,000,000	206,172,794.95	-9.67	3.09	-	-12.24
<b>新興股票型小計</b>	<b>200,000,000</b>	<b>206,172,794.95</b>	<b>-9.67</b>	<b>3.09</b>		
<b>合計</b>	<b>850,000,000</b>	<b>1,165,836,836.22</b>	<b>-3.02%</b>	<b>39.18%</b>		
移轉管理(原摩根)	200,000,000	181,942,859.87	-9.89%	-9.03%		

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8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	132,268,440.12	-3.46	10.22	1	8.72
施羅德投資管理	120,000,000	129,343,056.29	-3.25	7.79	3	
貝萊德投資管理	120,000,000	129,519,037.63	-3.35	7.93	2	
<b>合計</b>	<b>360,000,000</b>	<b>391,130,534.04</b>	<b>-3.36</b>	<b>8.65</b>		

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8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	187,433,099.92	-3.84	-6.28	1	-2.49
BlueBay	200,000,000	185,290,169.69	-6.08	-7.35	3	
Stone Harbor	200,000,000	185,646,312.03	-4.32	-7.18	2	
<b>合計</b>	<b>600,000,000</b>	<b>558,369,581.64</b>	<b>-4.75</b>	<b>-6.94</b>		

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8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	124,335,426.58	-1.95	-0.53	1	-8.19
貝萊德法人信託	125,000,000	116,465,427.70	-3.89	-6.83	2	
<b>合計</b>	<b>250,000,000</b>	<b>240,800,854.28</b>	<b>-2.90</b>	<b>-3.68</b>		

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8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	119,003,637.38	-4.80	-4.80	2	-5.15
瑞銀環球資產管理	125,000,000	119,083,517.38	-4.73	-4.73	1	
<b>合計</b>	<b>250,000,000</b>	<b>238,087,154.76</b>	<b>-4.77</b>	<b>-4.77</b>		

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8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	68,514,246.66	-8.65	-8.65	2	-5.55
Cohen & Steers	75,000,000	71,124,895.48	-5.17	-5.17	1	
<b>合計</b>	<b>150,000,000</b>	<b>139,639,142.14</b>	<b>-6.91</b>	<b>-6.91</b>		

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8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	70,296,497.06	-6.27	-6.27	1	-8.07
Cohen & Steers	75,000,000	69,434,161.33	-7.42	-7.42	2	
<b>合計</b>	<b>150,000,000</b>	<b>139,730,658.39</b>	<b>-6.85</b>	<b>-6.85</b>		

註：本會指定指標為富時歐洲/北美不動產協會全球指數。