

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9月30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	420,598,934.51	-6.02	10.38	-	4.62
合計	381,056,090.52	420,598,934.51	-6.02	10.38		

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9月30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	237,890,016.53	-10.25	-9.57	-	-14.43
合計	263,076,477.07	237,890,016.53	-10.25	-9.57		

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9月30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	434,984,685.42	-6.02	-4.26	-	-7.22
合計	454,341,586.67	434,984,685.42	-6.02	-4.26		

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9月30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	273,108,245.08	-3.46	36.55	3	35.48
景順德國資產管理	200,000,000	295,357,279.10	-4.96	47.68	2	
德盛安聯資產管理	250,000,000	361,118,573.62	-5.02	54.68	1	
國際股票型小計	650,000,000	929,584,097.80	-4.55	46.39		
瑞萬通博資產管理	200,000,000	204,209,718.88	-10.53	2.10	-	-14.70
新興股票型小計	200,000,000	204,209,718.88	-10.53	2.10		
合計	850,000,000	1,133,793,816.68	-5.68%	35.35%		

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9月30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	132,183,682.95	-3.53	10.15	1	8.77
施羅德投資管理	120,000,000	129,589,432.77	-3.07	7.99	2	
貝萊德投資管理	120,000,000	129,473,962.34	-3.38	7.89	3	
合計	360,000,000	391,247,078.06	-3.33	8.68		

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9月30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	184,097,789.14	-5.56	-7.95	1	-4.46
BlueBay	200,000,000	181,128,225.46	-8.19	-9.44	3	
Stone Harbor	200,000,000	181,597,792.65	-6.40	-9.20	2	
合計	600,000,000	546,823,807.25	-6.72	-8.86		

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9月30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	250,000,000	246,634,934.78	-4.37	-2.98	1	-10.79
貝萊德法人信託	250,000,000	239,472,359.14	-6.25	-9.11	2	
合計	500,000,000	486,107,293.92	-5.29	-6.04		

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9月30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	117,537,543.13	-5.97	-5.97	2	-6.34
瑞銀環球資產管理	125,000,000	117,605,778.96	-5.92	-5.92	1	
合計	250,000,000	235,143,322.09	-5.94	-5.94		

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9月30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	67,101,091.12	-10.53	-10.53	2	-9.01
Cohen & Steers	75,000,000	67,600,437.65	-9.87	-9.87	1	
合計	150,000,000	134,701,528.77	-10.20	-10.20		

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9月30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	71,062,776.91	-5.25	-5.25	1	-7.31
Cohen & Steers	75,000,000	70,476,562.45	-6.03	-6.03	2	
合計	150,000,000	141,539,339.36	-5.64	-5.64		

註：本會指定指標為富時歐洲/北美不動產協會全球指數。