

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10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	451,141,049.47	0.81	18.39	-	12.83
合計	381,056,090.52	451,141,049.47	0.81	18.39		

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10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	256,700,379.27	-3.16	-2.42	-	-7.76
合計	263,076,477.07	256,700,379.27	-3.16	-2.42		

註：亞太股票型本會指定指標為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10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	466,571,943.30	0.81	2.69	-	0.07
合計	454,341,586.67	466,571,943.30	0.81	2.69		

註：國際股票型本會指定指標為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10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	294,960,663.78	4.26	47.48	3	46.06
景順德國資產管理	200,000,000	319,717,437.99	2.88	59.86	2	
德盛安聯資產管理	250,000,000	386,484,923.91	1.65	65.55	1	
國際股票型小計	650,000,000	1,001,163,025.68	2.80	57.66		
瑞萬通博資產管理	200,000,000	217,071,671.86	-4.89	8.54	-	-8.62
新興股票型小計	200,000,000	217,071,671.86	-4.89	8.54		
合計	850,000,000	1,218,234,697.54	1.34%	45.44%		

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10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	133,745,512.66	-2.39	11.45	1	9.41
施羅德投資管理	120,000,000	130,734,043.24	-2.21	8.95	2	
貝萊德投資管理	120,000,000	130,519,703.17	-2.60	8.77	3	
合計	360,000,000	394,999,259.07	-2.40	9.72		

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10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	188,382,641.51	-3.36	-5.81	1	-1.76
BlueBay	200,000,000	186,554,318.05	-5.44	-6.72	3	
Stone Harbor	200,000,000	186,898,134.30	-3.67	-6.55	2	
合計	600,000,000	561,835,093.86	-4.16	-6.36		

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10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	250,000,000	263,442,010.59	2.15	3.63	1	-4.11
貝萊德法人信託	250,000,000	257,390,565.53	0.76	-2.31	2	
合計	500,000,000	520,832,576.12	1.48	0.67		

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10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	124,574,413.16	-0.34	-0.34	2	-0.78
瑞銀環球資產管理	125,000,000	124,613,087.44	-0.31	-0.31	1	
合計	250,000,000	249,187,500.60	-0.32	-0.32		

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10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	70,340,040.81	-6.21	-6.21	2	-3.33
Cohen & Steers	75,000,000	71,786,949.96	-4.28	-4.28	1	
合計	150,000,000	142,126,990.77	-5.25	-5.25		

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10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	75,086,004.63	0.11	0.11	1	-1.77
Cohen & Steers	75,000,000	74,938,228.89	-0.08	-0.08	2	
合計	150,000,000	150,024,233.52	0.02	0.02		

註：本會指定指標為富時歐洲/北美不動產協會全球指數。