

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11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	447,422,785.50	-0.02	17.42	-	11.90
合計	381,056,090.52	447,422,785.50	-0.02	17.42		

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11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	251,719,947.69	-5.03	-4.32	-	-9.97
合計	263,076,477.07	251,719,947.69	-5.03	-4.32		

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11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	462,704,506.42	-0.03	1.84	-	-0.76
合計	454,341,586.67	462,704,506.42	-0.03	1.84		

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11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	294,643,372.45	4.15	47.32	3	44.87
景順德國資產管理	200,000,000	318,548,530.00	2.50	59.27	2	
德盛安聯資產管理	250,000,000	383,495,202.63	0.86	64.27	1	
國際股票型小計	650,000,000	996,687,105.08	2.34	56.96		
瑞萬通博資產管理	200,000,000	210,901,146.58	-7.59	5.45	-	-12.11
新興股票型小計	200,000,000	210,901,146.58	-7.59	5.45		
合計	850,000,000	1,207,588,251.66	0.46	44.16		

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11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	132,763,414.15	-3.10	10.64	1	8.20
施羅德投資管理	120,000,000	129,369,668.99	-3.23	7.81	2	
貝萊德投資管理	120,000,000	128,900,817.16	-3.81	7.42	3	
合計	360,000,000	391,033,900.30	-3.38	8.62		

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11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	186,181,220.09	-4.49	-6.91	1	-2.51
BlueBay	200,000,000	184,543,675.08	-6.46	-7.73	3	
Stone Harbor	200,000,000	184,974,529.69	-4.66	-7.51	2	
合計	600,000,000	555,699,424.86	-5.21	-7.38		

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11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	260,192,185.61	0.89	2.35	1	-5.78
貝萊德法人信託	250,000,000	252,921,650.35	-0.99	-4.01	2	
合計	500,000,000	513,113,835.96	-0.02	-0.82		

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11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	122,800,505.16	-1.76	-1.76	2	-2.19
瑞銀環球資產管理	125,000,000	122,859,267.75	-1.71	-1.71	1	
合計	250,000,000	245,659,772.91	-1.74	-1.74		

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11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	68,239,063.47	-9.01	-9.01	1	-7.75
Cohen & Steers	75,000,000	68,130,809.90	-9.16	-9.16	2	
合計	150,000,000	136,369,873.37	-9.09	-9.09		

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11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	73,483,137.99	-2.02	-2.02	2	-3.88
Cohen & Steers	75,000,000	73,511,003.46	-1.99	-1.99	1	
合計	150,000,000	146,994,141.45	-2.00	-2.00		

註：本會指定指標為富時歐洲/北美不動產協會全球指數。