

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12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 (%) |
| 安聯環球投資 | 381,056,090.52 | 440,637,302.45 | -1.54 | 15.64 | - | 9.88 |
| 合計 | 381,056,090.52 | 440,637,302.45 | -1.54 | 15.64 | | |

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12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 | 253,627,390.20 | -4.31 | -3.59 | - | -9.59 |
| 合計 | 263,076,477.07 | 253,627,390.20 | -4.31 | -3.59 | | |

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12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 (%) |
| 安聯環球投資 | 454,341,586.67 | 455,632,817.20 | -1.56 | 0.28 | - | -2.55 |
| 合計 | 454,341,586.67 | 455,632,817.20 | -1.56 | 0.28 | | |

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12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 | 289,694,485.85 | 2.40 | 44.85 | 3 | 42.34 |
| 景順德國資產管理 | 200,000,000 | 313,961,614.53 | 1.03 | 56.98 | 2 | |
| 安聯環球投資 | 250,000,000 | 378,586,881.19 | -0.43 | 62.16 | 1 | |
| 國際股票型小計 | 650,000,000 | 982,242,981.57 | 0.86 | 54.68 | | |
| 瑞萬通博資產管理 | 200,000,000 | 207,653,693.45 | -9.02 | 3.83 | - | -13.96 |
| 新興股票型小計 | 200,000,000 | 207,653,693.45 | -9.02 | 3.83 | | |
| 合計 | 850,000,000 | 1,189,896,675.02 | -1.02 | 42.05 | | |

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12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 | 132,428,510.70 | -3.35 | 10.36 | 1 | 7.87 |
| 施羅德投資管理 | 120,000,000 | 128,591,377.62 | -3.81 | 7.16 | 3 | |
| 貝萊德投資管理 | 120,000,000 | 128,611,319.37 | -4.03 | 7.18 | 2 | |
| 合計 | 360,000,000 | 389,631,207.69 | -3.73 | 8.23 | | |

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12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 | 183,114,171.18 | -6.06 | -8.44 | 1 | -4.00 |
| BlueBay | 200,000,000 | 181,309,419.51 | -8.10 | -9.35 | 3 | |
| Stone Harbor | 200,000,000 | 181,522,560.96 | -6.44 | -9.24 | 2 | |
| 合計 | 600,000,000 | 545,946,151.65 | -6.87 | -9.01 | | |

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12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 (%) |
| 安聯環球投資 | 250,000,000 | 257,158,394.24 | -0.29 | 1.16 | 1 | -7.29 |
| 貝萊德法人信託 | 250,000,000 | 247,891,665.80 | -2.96 | -5.92 | 2 | |
| 合計 | 500,000,000 | 505,050,060.04 | -1.59 | -2.38 | | |

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12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 | 123,590,497.41 | -1.13 | -1.13 | 2 | -1.53 |
| 瑞銀環球資產管理 | 125,000,000 | 123,682,901.02 | -1.05 | -1.05 | 1 | |
| 合計 | 250,000,000 | 247,273,398.43 | -1.09 | -1.09 | | |

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12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 | 66,134,630.39 | -11.82 | -11.82 | 1 | -11.67 |
| Cohen & Steers | 75,000,000 | 64,940,758.35 | -13.41 | -13.41 | 2 | |
| 合計 | 150,000,000 | 131,075,388.74 | -12.62 | -12.62 | | |

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12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 | 74,176,303.55 | -1.10 | -1.10 | 2 | -2.98 |
| Cohen & Steers | 75,000,000 | 74,975,453.63 | -0.03 | -0.03 | 1 | |
| 合計 | 150,000,000 | 149,151,757.18 | -0.57 | -0.57 | | |

註：本會指定指標為富時歐洲/北美不動產協會全球指數。