

## 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3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	458,115,485.59	2.37	20.22	-	15.14
<b>合計</b>	<b>381,056,090.52</b>	<b>458,115,485.59</b>	<b>2.37</b>	<b>20.22</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3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>	278,521,172.27	5.08	5.87	-	3.92
<b>合計</b>	<b>263,076,477.07</b>	<b>278,521,172.27</b>	<b>5.08</b>	<b>5.87</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3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	473,768,384.62	2.36	4.28	-	2.11
<b>合計</b>	<b>454,341,586.67</b>	<b>473,768,384.62</b>	<b>2.36</b>	<b>4.28</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3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	293,097,916.00	3.61	46.55	3	48.93
景順德國資產管理	200,000,000	321,925,037.04	3.59	60.96	2	
德盛安聯資產管理	250,000,000	390,906,389.64	2.81	67.44	1	
<b>國際股票型小計</b>	<b>650,000,000</b>	<b>1,005,929,342.68</b>	<b>3.29</b>	<b>58.41</b>		
摩根資產管理	200,000,000	203,662,427.23	0.87	1.83	2	2.49
瑞萬通博資產管理	200,000,000	231,334,828.57	1.36	15.67	1	
<b>新興股票型小計</b>	<b>400,000,000</b>	<b>434,997,255.80</b>	<b>1.13</b>	<b>8.75</b>		
<b>合計</b>	<b>1,050,000,000</b>	<b>1,440,926,598.48</b>	<b>2.63</b>	<b>38.61</b>		

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3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	136,279,093.23	-0.54	13.57	1	10.54
施羅德投資管理	120,000,000	132,568,096.22	-0.84	10.47	2	
貝萊德投資管理	120,000,000	132,150,979.16	-1.38	10.13	3	
<b>合計</b>	<b>360,000,000</b>	<b>400,998,168.61</b>	<b>-0.92</b>	<b>11.39</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3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	195,580,352.42	0.34	-2.21	2	1.94
BlueBay	200,000,000	196,445,788.69	-0.43	-1.78	1	
Stone Harbor	200,000,000	194,772,524.45	0.39	-2.61	3	
<b>合計</b>	<b>600,000,000</b>	<b>586,798,665.56</b>	<b>0.10</b>	<b>-2.20</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3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	128,986,667.92	1.71	3.19	1	-2.37
貝萊德投資管理	125,000,000	122,152,198.56	0.80	-2.28	2	
<b>合計</b>	<b>250,000,000</b>	<b>251,138,866.48</b>	<b>1.27</b>	<b>0.46</b>		

註：本會指定指標為MSCI全球高股利指數(臺灣除外)。

第10次-基礎建設股票型(自104年3月18日至104年3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	75,118,088.63	0.16	0.16	2	2.08
Cohen & Steers	75,000,000	76,315,348.98	1.75	1.75	1	
<b>合計</b>	<b>150,000,000</b>	<b>151,433,437.61</b>	<b>0.96</b>	<b>0.96</b>		

註：本會指定指標為道瓊Brookfield全球基礎建設指數。