

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4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	470,778,390.97	5.20	23.55	-	18.48
合計	381,056,090.52	470,778,390.97	5.20	23.55		

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4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	295,957,047.08	11.65	12.50	-	10.18
合計	263,076,477.07	295,957,047.08	11.65	12.50		

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4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	486,883,605.18	5.20	7.16	-	5.07
合計	454,341,586.67	486,883,605.18	5.20	7.16		

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4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	300,420,610.21	6.19	50.21	3	53.28
景順德國資產管理	200,000,000	329,155,452.83	5.92	64.58	2	
德盛安聯資產管理	250,000,000	401,877,051.10	5.70	72.14	1	
國際股票型小計	650,000,000	1,031,453,114.14	5.91	62.43		
摩根資產管理	200,000,000	220,148,953.97	9.04	10.07	2	11.13
瑞萬通博資產管理	200,000,000	235,192,479.00	3.05	17.60	1	
新興股票型小計	400,000,000	455,341,432.97	5.86	13.84		
合計	1,050,000,000	1,486,794,547.11	5.90	43.02		

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4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	136,716,516.65	-0.22	13.93	1	11.37
施羅德投資管理	120,000,000	133,497,760.39	-0.14	11.25	2	
貝萊德投資管理	120,000,000	132,933,589.04	-0.80	10.78	3	
合計	360,000,000	403,147,866.08	-0.39	11.99		

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4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	197,994,335.51	1.57	-1.00	2	3.09
BlueBay	200,000,000	197,458,299.03	0.09	-1.27	3	
Stone Harbor	200,000,000	198,039,379.84	2.07	-0.98	1	
合計	600,000,000	593,492,014.38	1.24	-1.08		

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4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	125,000,000	133,476,436.16	5.25	6.78	1	1.81
貝萊德投資管理	125,000,000	127,691,060.74	5.37	2.15	2	
合計	250,000,000	261,167,496.90	5.31	4.47		

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4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	76,278,347.51	1.70	1.70	2	5.52
Cohen & Steers	75,000,000	79,268,071.57	5.69	5.69	1	
合計	150,000,000	155,546,419.08	3.70	3.70		

註：本會指定指標為道瓊Brookfield全球基礎建設指數。