

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5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	475,760,796.21	6.31	24.85	-	18.33
合計	381,056,090.52	475,760,796.21	6.31	24.85		

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5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	287,735,769.12	8.55	9.37	-	6.89
合計	263,076,477.07	287,735,769.12	8.55	9.37		

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5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	492,026,077.49	6.31	8.29	-	4.94
合計	454,341,586.67	492,026,077.49	6.31	8.29		

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5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	302,827,340.38	7.05	51.41	3	53.17
景順德國資產管理	200,000,000	330,605,615.03	6.38	65.30	2	
德盛安聯資產管理	250,000,000	405,402,533.42	6.62	73.65	1	
國際股票型小計	650,000,000	1,038,835,488.83	6.67	63.59		
摩根資產管理	200,000,000	211,468,765.42	4.74	5.73	2	6.86
瑞萬通博資產管理	200,000,000	230,669,149.59	1.07	15.33	1	
新興股票型小計	400,000,000	442,137,915.01	2.79	10.53		
合計	1,050,000,000	1,480,973,403.84	5.48	42.46		

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5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	134,797,715.48	-1.62	12.33	1	10.12
施羅德投資管理	120,000,000	131,634,523.63	-1.54	9.70	2	
貝萊德投資管理	120,000,000	131,420,971.94	-1.93	9.52	3	
合計	360,000,000	397,853,211.05	-1.69	10.51		

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5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	195,915,519.75	0.51	-2.04	1	1.97
BlueBay	200,000,000	194,896,822.37	-1.21	-2.55	3	
Stone Harbor	200,000,000	195,684,625.90	0.86	-2.16	2	
合計	600,000,000	586,496,968.02	0.04	-2.25		

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5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	134,080,794.92	5.73	7.26	1	0.52
貝萊德法人信託	125,000,000	126,158,479.91	4.11	0.93	2	
合計	250,000,000	260,239,274.83	4.94	4.10		

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5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	74,921,610.01	-0.10	-0.10	2	3.63
Cohen & Steers	75,000,000	77,905,009.12	3.87	3.87	1	
合計	150,000,000	152,826,619.13	1.88	1.88		

註：本會指定指標為道瓊Brookfield全球基礎建設指數。