

## 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6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	465,270,657.82	3.97	22.10	-	15.54
<b>合計</b>	<b>381,056,090.52</b>	<b>465,270,657.82</b>	<b>3.97</b>	<b>22.10</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6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	<b>263,076,477.07</b>	278,130,472.15	4.93	5.72	-	2.58
<b>合計</b>	<b>263,076,477.07</b>	<b>278,130,472.15</b>	<b>4.93</b>	<b>5.72</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6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	481,182,674.10	3.96	5.91	-	2.47
<b>合計</b>	<b>454,341,586.67</b>	<b>481,182,674.10</b>	<b>3.96</b>	<b>5.91</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6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	297,289,599.29	5.09	48.64	3	49.57
景順德國資產管理	200,000,000	321,526,133.89	3.46	60.76	2	
德盛安聯資產管理	250,000,000	398,522,737.18	4.81	70.70	1	
<b>國際股票型小計</b>	<b>650,000,000</b>	<b>1,017,338,470.36</b>	<b>4.46</b>	<b>60.21</b>		
摩根資產管理	200,000,000	204,793,307.79	1.43	2.40	2	3.90
瑞萬通博資產管理	200,000,000	228,837,115.06	0.26	14.42	1	
<b>新興股票型小計</b>	<b>400,000,000</b>	<b>433,630,422.85</b>	<b>0.81</b>	<b>8.41</b>		
<b>合計</b>	<b>1,050,000,000</b>	<b>1,450,968,893.21</b>	<b>3.34</b>	<b>39.57</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6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	132,449,909.15	-3.33	10.37	1	8.82
施羅德投資管理	120,000,000	130,069,667.22	-2.71	8.39	2	
貝萊德投資管理	120,000,000	129,615,655.03	-3.28	8.01	3	
<b>合計</b>	<b>360,000,000</b>	<b>392,135,231.40</b>	<b>-3.11</b>	<b>8.93</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6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	192,651,562.19	-1.17	-3.67	1	0.35
BlueBay	200,000,000	191,160,328.49	-3.11	-4.42	3	
Stone Harbor	200,000,000	192,608,289.69	-0.73	-3.70	2	
<b>合計</b>	<b>600,000,000</b>	<b>576,420,180.37</b>	<b>-1.67</b>	<b>-3.93</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6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	131,137,905.67	3.41	4.91	1	-2.80
貝萊德法人信託	125,000,000	123,167,259.86	1.64	-1.47	2	
<b>合計</b>	<b>250,000,000</b>	<b>254,305,165.53</b>	<b>2.54</b>	<b>1.72</b>		

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6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	122,246,397.57	-2.20	-2.20	2	-2.27
瑞銀環球資產管理	125,000,000	122,293,370.72	-2.17	-2.17	1	
<b>合計</b>	<b>250,000,000</b>	<b>244,539,768.29</b>	<b>-2.18</b>	<b>-2.18</b>		

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6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	71,722,924.06	-4.37	-4.37	2	-0.57
Cohen & Steers	75,000,000	75,433,901.52	0.58	0.58	1	
<b>合計</b>	<b>150,000,000</b>	<b>147,156,825.58</b>	<b>-1.90</b>	<b>-1.90</b>		

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6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	71,172,624.06	-5.10	-5.10	2	-4.07
Cohen & Steers	75,000,000	71,954,299.28	-4.06	-4.06	1	
<b>合計</b>	<b>150,000,000</b>	<b>143,126,923.34</b>	<b>-4.58</b>	<b>-4.58</b>		

註：本會指定指標為富時歐洲/北美不動產協會全球指數。