

## 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105年5月31日止)						
受託機構名稱	委託金額 (美元)	資產淨值 (美元)	105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	445,576,794.79	1.12	16.93	-	11.91
<b>合計</b>	<b>381,056,090.52</b>	<b>445,576,794.79</b>	<b>1.12</b>	<b>16.93</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105年5月31日止)						
受託機構名稱	委託金額 (美元)	資產淨值 (美元)	105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	256,711,859.08	1.22	-2.42	-	-9.76
<b>合計</b>	<b>263,076,477.07</b>	<b>256,711,859.08</b>	<b>1.22</b>	<b>-2.42</b>		

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105年5月31日止)						
受託機構名稱	委託金額 (美元)	資產淨值 (美元)	105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	460,690,131.65	1.11	1.40	-	-0.75
<b>合計</b>	<b>454,341,586.67</b>	<b>460,690,131.65</b>	<b>1.11</b>	<b>1.40</b>		

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105年5月31日止)						
受託機構名稱	委託金額 (美元)	資產淨值 (美元)	105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	291,800,891.24	0.73	45.90	3	45.00
景順德國資產管理	200,000,000	312,221,782.81	-0.55	56.11	2	
安聯環球投資	250,000,000	388,396,091.37	2.59	66.37	1	
<b>國際股票型小計</b>	<b>650,000,000</b>	<b>992,418,765.42</b>	<b>1.04</b>	<b>56.28</b>		
瑞萬通博資產管理	200,000,000	219,511,432.47	5.71	9.76	-	-12.55
<b>新興股票型小計</b>	<b>200,000,000</b>	<b>219,511,432.47</b>	<b>5.71</b>	<b>9.76</b>		
<b>合計</b>	<b>850,000,000</b>	<b>1,211,930,197.89</b>	<b>1.85</b>	<b>44.68</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105年5月31日止)						
受託機構名稱	委託金額 (美元)	資產淨值 (美元)	105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	139,345,331.93	5.22	16.12	1	13.56
施羅德投資管理	120,000,000	134,533,706.78	4.62	12.11	2	
貝萊德投資管理	120,000,000	134,478,850.41	4.56	12.07	3	
<b>合計</b>	<b>360,000,000</b>	<b>408,357,889.12</b>	<b>4.81</b>	<b>13.43</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105年5月31日止)						
受託機構名稱	委託金額 (美元)	資產淨值 (美元)	105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	194,043,050.59	5.97	-2.98	1	1.74
BlueBay	200,000,000	190,265,321.03	4.94	-4.87	3	
Stone Harbor	200,000,000	192,144,566.52	5.85	-3.93	2	
<b>合計</b>	<b>600,000,000</b>	<b>576,452,938.14</b>	<b>5.59</b>	<b>-3.92</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105年5月31日止)						
受託機構名稱	委託金額 (美元)	資產淨值 (美元)	105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	268,755,054.22	4.51	5.72	1	-1.99
貝萊德法人信託	250,000,000	260,088,369.64	4.92	-1.29	2	
<b>合計</b>	<b>500,000,000</b>	<b>528,843,423.86</b>	<b>4.71</b>	<b>2.22</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105年5月31日止)						
受託機構名稱	委託金額 (美元)	資產淨值 (美元)	105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	131,332,082.78	6.26	5.07	2	4.52
瑞銀資產管理	125,000,000	131,487,784.45	6.31	5.19	1	
<b>合計</b>	<b>250,000,000</b>	<b>262,819,867.23</b>	<b>6.29</b>	<b>5.13</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105年5月31日止)						
受託機構名稱	委託金額 (美元)	資產淨值 (美元)	105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	74,218,788.33	12.22	-1.04	1	-2.36
Cohen & Steers	75,000,000	70,496,941.14	8.56	-6.00	2	
<b>合計</b>	<b>150,000,000</b>	<b>144,715,729.47</b>	<b>10.41</b>	<b>-3.52</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105年5月31日止)						
受託機構名稱	委託金額 (美元)	資產淨值 (美元)	105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	76,789,972.47	3.52	2.39	2	1.35
Cohen & Steers	75,000,000	76,938,786.13	2.62	2.59	1	
<b>合計</b>	<b>150,000,000</b>	<b>153,728,758.60</b>	<b>3.07</b>	<b>2.49</b>		

註：本會指定指標為富時歐洲/北美不動產協會全球指數。