

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6月30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	434,553,891.94	-1.38	14.04	-	11.24
合計	381,056,090.52	434,553,891.94	-1.38	14.04		

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6月30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	261,941,028.01	3.28	-0.43	-	-8.11
合計	263,076,477.07	261,941,028.01	3.28	-0.43		

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6月30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	449,296,780.45	-1.39	-1.11	-	-1.35
合計	454,341,586.67	449,296,780.45	-1.39	-1.11		

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6月30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	287,750,199.90	-0.67	43.88	3	44.10
景順德國資產管理	200,000,000	309,696,229.83	-1.36	54.85	2	
安聯環球投資	250,000,000	377,783,000.30	-0.21	61.82	1	
國際股票型小計	650,000,000	975,229,430.03	-0.71	53.58		
瑞萬通博資產管理	200,000,000	227,526,674.86	9.57	13.76	-	-9.26
新興股票型小計	200,000,000	227,526,674.86	9.57	13.76		
合計	850,000,000	1,202,756,104.89	1.08	43.59		

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6月30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	140,765,165.43	6.30	17.30	1	15.24
貝萊德投資管理	120,000,000	136,181,543.45	5.89	13.48	2	
合計	240,000,000	276,946,708.88	6.09	15.39		

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6月30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	201,759,916.02	10.18	0.88	1	5.65
BlueBay	200,000,000	198,067,794.83	9.24	-0.97	3	
Stone Harbor	200,000,000	199,648,555.36	9.99	-0.18	2	
合計	600,000,000	599,476,266.21	9.81	-0.09		

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6月30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	266,721,752.36	3.72	4.92	1	-0.82
貝萊德法人信託	250,000,000	264,628,054.19	6.75	0.43	2	
合計	500,000,000	531,349,806.55	5.21	2.70		

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6月30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	137,067,604.51	10.90	9.65	2	9.05
瑞銀資產管理	125,000,000	137,210,915.11	10.94	9.77	1	
合計	250,000,000	274,278,519.62	10.92	9.71		

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6月30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	77,894,034.12	17.78	3.86	1	2.63
Cohen & Steers	75,000,000	73,886,793.88	13.78	-1.48	2	
合計	150,000,000	151,780,828.00	15.80	1.19		

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6月30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	78,593,873.98	5.96	4.79	2	5.13
Cohen & Steers	75,000,000	78,895,319.39	5.23	5.19	1	
合計	150,000,000	157,489,193.37	5.59	4.99		

註：本會指定指標為富時歐洲/北美不動產協會全球指數。