

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7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	452,680,859.94	2.73	18.80	-	16.03
合計	381,056,090.52	452,680,859.94	2.73	18.80		

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7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	275,573,721.84	8.65	4.75	-	-3.11
合計	263,076,477.07	275,573,721.84	8.65	4.75		

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7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	467,992,368.28	2.71	3.00	-	2.90
合計	454,341,586.67	467,992,368.28	2.71	3.00		

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7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	300,858,852.90	3.85	50.43	3	50.32
景順德國資產管理	200,000,000	324,244,200.80	3.28	62.12	2	
安聯環球投資	250,000,000	393,702,254.28	3.99	68.64	1	
國際股票型小計	650,000,000	1,018,805,307.98	3.72	60.44		
瑞萬通博資產管理	200,000,000	232,883,148.86	12.15	16.44	-	-4.98
新興股票型小計	200,000,000	232,883,148.86	12.15	16.44		
合計	850,000,000	1,251,688,456.84	5.19	49.43		

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7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	220,000,000	244,069,958.85	8.25	19.46	1	17.21
貝萊德投資管理	120,000,000	138,613,316.34	7.78	15.51	2	
合計	340,000,000	382,683,275.19	8.01	17.48		

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7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	204,021,116.20	11.42	2.01	1	6.67
BlueBay	200,000,000	199,819,630.79	10.21	-0.09	3	
Stone Harbor	200,000,000	200,939,210.18	10.70	0.47	2	
合計	600,000,000	604,779,957.17	10.78	0.80		

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7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	275,456,392.19	7.12	8.36	1	1.62
貝萊德法人信託	250,000,000	272,002,276.82	9.73	3.23	2	
合計	500,000,000	547,458,669.01	8.40	5.81		

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7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	139,684,977.17	13.02	11.75	2	11.19
瑞銀資產管理	125,000,000	139,869,894.58	13.09	11.90	1	
合計	250,000,000	279,554,871.75	13.05	11.82		

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7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	78,314,944.89	18.42	4.42	1	3.80
Cohen & Steers	75,000,000	74,638,509.40	14.93	-0.48	2	
合計	150,000,000	152,953,454.29	16.69	1.97		

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7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	81,859,052.62	10.36	9.15	2	10.37
Cohen & Steers	75,000,000	83,147,033.68	10.90	10.86	1	
合計	150,000,000	165,006,086.30	10.63	10.00		

註：本會指定指標為富時歐洲/北美不動產協會全球指數。