

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8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	453,874,363.34	3.00	19.11	-	16.42
合計	381,056,090.52	453,874,363.34	3.00	19.11		

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8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	279,082,792.33	10.04	6.08	-	-1.07
合計	263,076,477.07	279,082,792.33	10.04	6.08		

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8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	469,196,521.55	2.98	3.27	-	3.25
合計	454,341,586.67	469,196,521.55	2.98	3.27		

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8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	302,168,085.28	4.31	51.08	3	50.78
景順德國資產管理	200,000,000	322,529,438.28	2.73	61.26	2	
安聯環球投資	250,000,000	393,509,122.63	3.94	68.56	1	
國際股票型小計	650,000,000	1,018,206,646.19	3.66	60.34		
瑞萬通博資產管理	200,000,000	237,354,992.18	14.30	18.68	-	-2.66
新興股票型小計	200,000,000	237,354,992.18	14.30	18.68		
合計	850,000,000	1,255,561,638.37	5.52	49.89		

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8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	244,972,575.44	8.65	19.90	1	17.42
貝萊德投資管理	120,000,000	138,792,072.93	7.92	15.66	2	
合計	340,000,000	383,764,648.37	8.32	17.82		

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8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	206,232,157.86	12.62	3.12	1	7.94
BlueBay	200,000,000	202,517,465.00	11.70	1.26	3	
Stone Harbor	200,000,000	202,949,488.43	11.80	1.47	2	
合計	600,000,000	611,699,111.29	12.04	1.95		

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8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	273,935,508.00	6.52	7.76	1	1.14
貝萊德法人信託	250,000,000	269,606,465.74	8.76	2.32	2	
合計	500,000,000	543,541,973.74	7.62	5.06		

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8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	136,232,566.51	10.23	8.99	2	8.40
瑞銀資產管理	125,000,000	136,408,107.73	10.29	9.13	1	
合計	250,000,000	272,640,674.24	10.26	9.06		

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8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	76,473,586.83	15.63	1.96	1	1.96
Cohen & Steers	75,000,000	73,178,589.23	12.69	-2.43	2	
合計	150,000,000	149,652,176.06	14.17	-0.23		

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8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	79,526,146.73	7.21	6.03	2	7.95
Cohen & Steers	75,000,000	82,283,102.06	9.75	9.71	1	
合計	150,000,000	161,809,248.79	8.49	7.87		

註：本會指定指標為富時歐洲/北美不動產協會全球指數。