

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9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	455,848,054.78	3.45	19.63	-	17.13
合計	381,056,090.52	455,848,054.78	3.45	19.63		

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9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	281,837,072.29	11.12	7.13	-	0.56
合計	263,076,477.07	281,837,072.29	11.12	7.13		

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9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	471,243,588.84	3.43	3.72	-	3.88
合計	454,341,586.67	471,243,588.84	3.43	3.72		

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9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	303,787,234.20	4.86	51.89	3	51.68
景順德國資產管理	200,000,000	325,874,081.55	3.79	62.94	2	
安聯環球投資	250,000,000	397,630,395.68	5.03	70.32	1	
國際股票型小計	650,000,000	1,027,291,711.43	4.59	61.77		
瑞萬通博資產管理	200,000,000	238,236,769.70	14.73	19.12	-	-1.61
新興股票型小計	200,000,000	238,236,769.70	14.73	19.12		
合計	850,000,000	1,265,528,481.13	6.36	51.08		

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9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	220,000,000	244,049,473.46	8.24	19.45	1	17.39
貝萊德投資管理	120,000,000	138,559,789.27	7.74	15.47	2	
合計	340,000,000	382,609,262.73	7.99	17.46		

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9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	206,981,447.32	13.03	3.49	1	8.07
BlueBay	200,000,000	202,804,754.67	11.86	1.40	3	
Stone Harbor	200,000,000	203,145,279.28	11.91	1.57	2	
合計	600,000,000	612,931,481.27	12.27	2.16		

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9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	276,143,338.63	7.38	8.63	1	1.84
貝萊德法人信託	250,000,000	271,813,504.51	9.65	3.16	2	
合計	500,000,000	547,956,843.14	8.50	5.91		

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9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	136,532,636.04	10.47	9.23	2	8.64
瑞銀資產管理	125,000,000	136,756,077.01	10.57	9.40	1	
合計	250,000,000	273,288,713.05	10.52	9.32		

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9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	77,474,688.40	17.15	3.30	1	4.89
Cohen & Steers	75,000,000	75,195,156.56	15.79	0.26	2	
合計	150,000,000	152,669,844.96	16.47	1.78		

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9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 (%)
Barings (原Cornerstone)	75,000,000	78,651,254.41	6.03	4.87	2	7.04
Cohen & Steers	75,000,000	81,808,451.55	9.11	9.08	1	
合計	150,000,000	160,459,705.96	7.58	6.97		

註：本會指定指標為富時歐洲/北美不動產協會全球指數。