

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10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	448,094,029.17	1.69	17.59	-	15.14
合計	381,056,090.52	448,094,029.17	1.69	17.59		

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10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	273,879,003.28	7.98	4.11	-	-1.50
合計	263,076,477.07	273,879,003.28	7.98	4.11		

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10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	463,230,091.18	1.67	1.96	-	2.11
合計	454,341,586.67	463,230,091.18	1.67	1.96		

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10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	296,767,230.38	2.44	48.38	3	49.20
景順德國資產管理	200,000,000	318,643,466.26	1.49	59.32	2	
安聯環球投資	250,000,000	393,328,319.96	3.89	68.48	1	
國際股票型小計	650,000,000	1,008,739,016.60	2.70	58.85		
瑞萬通博資產管理	200,000,000	233,104,383.23	12.26	16.55	-	-1.71
新興股票型小計	200,000,000	233,104,383.23	12.26	16.55		
合計	850,000,000	1,241,843,399.83	4.37	48.25		

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10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	239,784,008.07	6.35	17.36	1	15.24
貝萊德投資管理	120,000,000	135,570,894.20	5.41	12.98	2	
合計	340,000,000	375,354,902.27	5.95	15.23		

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10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	204,618,054.60	11.74	2.31	1	6.54
BlueBay	200,000,000	199,652,893.93	10.12	-0.17	3	
Stone Harbor	200,000,000	200,687,664.81	10.56	0.34	2	
合計	600,000,000	604,958,613.34	10.81	0.83		

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10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	269,419,395.67	4.77	5.98	1	-1.08
貝萊德法人信託	250,000,000	264,359,489.87	6.64	0.33	2	
合計	500,000,000	533,778,885.54	5.69	3.17		

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10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	132,273,303.67	7.03	5.82	2	5.26
瑞銀資產管理	125,000,000	132,488,059.60	7.12	5.99	1	
合計	250,000,000	264,761,363.27	7.07	5.90		

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10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	74,473,575.98	12.61	-0.70	1	1.48
Cohen & Steers	75,000,000	71,727,476.94	10.45	-4.36	2	
合計	150,000,000	146,201,052.92	11.54	-2.53		

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10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(%)
Barings	75,000,000	74,335,918.85	0.22	-0.89	2	1.25
Cohen & Steers	75,000,000	77,773,244.81	3.73	3.70	1	
合計	150,000,000	152,109,163.66	1.98	1.41		

註：本會指定指標為富時歐洲/北美不動產協會全球指數。