

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1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	410,119,657.36	-6.93	7.63	-	3.26
合計	381,056,090.52	410,119,657.36	-6.93	7.63		

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1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	233,286,418.87	-8.02	-11.32	-	-17.02
合計	263,076,477.07	233,286,418.87	-8.02	-11.32		

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1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	424,076,899.65	-6.93	-6.66	-	-8.43
合計	454,341,586.67	424,076,899.65	-6.93	-6.66		

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1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	273,755,345.13	-5.50	36.88	3	33.72
景順德國資產管理	200,000,000	292,192,830.63	-6.93	46.10	2	
安聯環球投資	250,000,000	356,073,916.83	-5.95	52.52	1	
國際股票型小計	650,000,000	922,022,092.59	-6.13	45.20		
瑞萬通博資產管理	200,000,000	202,217,668.70	-2.62	1.11	-	-19.98
新興股票型小計	200,000,000	202,217,668.70	-2.62	1.11		
合計	850,000,000	1,124,239,761.29	-5.52%	34.21%		

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1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	120,000,000	131,803,096.25	-0.47	9.84	1	7.91
施羅德投資管理	120,000,000	127,241,375.83	-1.05	6.03	3	
貝萊德投資管理	120,000,000	128,669,883.32	0.05	7.22	2	
合計	360,000,000	387,714,355.40	-0.49	7.70		

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1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	183,553,866.72	0.24	-8.22	1	-3.39
BlueBay	200,000,000	181,799,395.14	0.27	-9.10	3	
Stone Harbor	200,000,000	182,538,232.62	0.56	-8.73	2	
合計	600,000,000	547,891,494.48	0.36	-8.68		

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1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	245,119,660.90	-4.68	-3.58	1	-10.40
貝萊德法人信託	250,000,000	240,016,041.64	-3.18	-8.91	2	
合計	500,000,000	485,135,702.54	-3.94	-6.23		

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1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	121,251,306.16	-1.89	-3.00	2	-3.44
瑞銀資產管理	125,000,000	121,281,994.20	-1.94	-2.97	1	
合計	250,000,000	242,533,300.36	-1.92	-2.99		

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1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	66,978,592.94	1.28	-10.70	1	-12.06
Cohen & Steers	75,000,000	64,763,452.17	-0.27	-13.65	2	
合計	150,000,000	131,742,045.11	0.51	-12.17		

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1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	70,641,023.95	-4.77	-5.81	2	-7.83
Cohen & Steers	75,000,000	71,205,711.03	-5.03	-5.06	1	
合計	150,000,000	141,846,734.98	-4.90	-5.44		

註：本會指定指標為富時歐洲/北美不動產協會全球指數。