

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2月29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	409,614,583.58	-7.04	7.49	-	2.55
合計	381,056,090.52	409,614,583.58	-7.04	7.49		

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2月29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	230,165,575.33	-9.25	-12.51	-	-18.28
合計	263,076,477.07	230,165,575.33	-9.25	-12.51		

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2月29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	423,516,662.47	-7.05	-6.78	-	-9.06
合計	454,341,586.67	423,516,662.47	-7.05	-6.78		

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2月29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	267,776,750.31	-7.57	33.89	3	32.76
景順德國資產管理	200,000,000	290,795,773.34	-7.38	45.40	2	
安聯環球投資	250,000,000	359,779,248.70	-4.97	54.11	1	
國際股票型小計	650,000,000	918,351,772.35	-6.50	44.62		
瑞萬通博資產管理	200,000,000	197,456,279.62	-4.91	-1.27	-	-20.67
新興股票型小計	200,000,000	197,456,279.62	-4.91	-1.27		
合計	850,000,000	1,115,808,051.97	-6.23%	33.21		

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2月29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	133,088,508.41	0.50	10.91	1	8.76
施羅德投資管理	120,000,000	128,109,506.49	-0.37	6.76	3	
貝萊德投資管理	120,000,000	129,830,755.63	0.95	8.19	2	
合計	360,000,000	391,028,770.53	0.36	8.62		

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2月29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	186,202,198.43	1.69	-6.90	1	-1.87
BlueBay	200,000,000	184,674,133.99	1.86	-7.66	3	
Stone Harbor	200,000,000	185,338,639.10	2.10	-7.33	2	
合計	600,000,000	556,214,971.52	1.88	-7.30		

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2月29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	247,335,291.55	-3.82	-2.70	1	-9.90
貝萊德法人信託	250,000,000	239,926,651.79	-3.21	-8.94	2	
合計	500,000,000	487,261,943.34	-3.52	-5.82		

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2月29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	123,393,644.71	-0.16	-1.29	2	-1.73
瑞銀資產管理	125,000,000	123,522,263.37	-0.13	-1.18	1	
合計	250,000,000	246,915,908.08	-0.14	-1.23		

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2月29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	67,982,852.99	2.79	-9.36	1	-11.35
Cohen & Steers	75,000,000	64,617,223.78	-0.50	-13.84	2	
合計	150,000,000	132,600,076.77	1.16	-11.60		

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2月29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	70,259,229.75	-5.28	-6.32	2	-7.28
Cohen & Steers	75,000,000	70,549,411.78	-5.90	-5.93	1	
合計	150,000,000	140,808,641.53	-5.59	-6.13		

註：本會指定指標為富時歐洲/北美不動產協會全球指數。