

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3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	440,295,439.00	-0.08	15.55	-	10.15
合計	381,056,090.52	440,295,439.00	-0.08	15.55		

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3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	255,457,645.79	0.72	-2.90	-	-8.50
合計	263,076,477.07	255,457,645.79	0.72	-2.90		

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3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	455,233,706.82	-0.09	0.20	-	-2.32
合計	454,341,586.67	455,233,706.82	-0.09	0.20		

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3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	285,333,389.59	-1.51	42.67	3	42.70
景順德國資產管理	200,000,000	311,206,749.63	-0.88	55.60	2	
安聯環球投資	250,000,000	385,489,775.80	1.82	65.12	1	
國際股票型小計	650,000,000	982,029,915.02	-0.02	54.65		
瑞萬通博資產管理	200,000,000	215,232,018.90	3.65	7.62	-	-9.89
新興股票型小計	200,000,000	215,232,018.90	3.65	7.62		
合計	850,000,000	1,197,261,933.92	0.62%	42.93%		

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3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	138,312,296.73	4.44	15.26	1	12.81
施羅德投資管理	120,000,000	133,638,126.93	3.92	11.37	3	
貝萊德投資管理	120,000,000	134,116,671.05	4.28	11.76	2	
合計	360,000,000	406,067,094.71	4.22	12.80		

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3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	195,310,662.07	6.66	-2.34	1	2.28
BlueBay	200,000,000	192,646,830.34	6.25	-3.68	3	
Stone Harbor	200,000,000	194,832,273.59	7.33	-2.58	2	
合計	600,000,000	582,789,766.00	6.75	-2.87		

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3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	264,804,582.16	2.97	4.17	1	-3.67
貝萊德法人信託	250,000,000	256,455,167.55	3.45	-2.67	2	
合計	500,000,000	521,259,749.71	3.21	0.75		

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3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	130,731,678.23	5.78	4.59	2	4.08
瑞銀資產管理	125,000,000	130,861,878.50	5.80	4.69	1	
合計	250,000,000	261,593,556.73	5.79	4.64		

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3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	72,965,790.94	10.33	-2.71	1	-4.48
Cohen & Steers	75,000,000	69,330,810.32	6.76	-7.56	2	
合計	150,000,000	142,296,601.26	8.56	-5.14		

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3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	76,744,733.13	3.46	2.33	2	1.77
Cohen & Steers	75,000,000	77,172,095.42	2.93	2.90	1	
合計	150,000,000	153,916,828.55	3.19	2.61		

註：本會指定指標為富時歐洲/北美不動產協會全球指數。