

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4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	441,632,108.23	0.23	15.90	-	11.77
合計	381,056,090.52	441,632,108.23	0.23	15.90		

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4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	257,628,086.98	1.58	-2.07	-	-7.95
合計	263,076,477.07	257,628,086.98	1.58	-2.07		

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4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	456,656,858.60	0.22	0.51	-	-0.88
合計	454,341,586.67	456,656,858.60	0.22	0.51		

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4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	290,139,808.19	0.15	45.07	3	44.81
景順德國資產管理	200,000,000	310,927,713.78	-0.97	55.46	2	
安聯環球投資	250,000,000	385,581,959.49	1.85	65.16	1	
國際股票型小計	650,000,000	986,649,481.46	0.45	55.37		
瑞萬通博資產管理	200,000,000	218,703,699.96	5.32	9.35	-	-8.51
新興股票型小計	200,000,000	218,703,699.96	5.32	9.35		
合計	850,000,000	1,205,353,181.42	1.30	43.90		

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4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	120,000,000	140,516,803.35	6.11	17.10	1	14.41
施羅德投資管理	120,000,000	135,720,166.64	5.54	13.10	2	
貝萊德投資管理	120,000,000	135,622,309.17	5.45	13.02	3	
合計	360,000,000	411,859,279.16	5.70	14.41		

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4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	198,496,442.55	8.40	-0.75	1	3.72
BlueBay	200,000,000	195,109,927.14	7.61	-2.45	3	
Stone Harbor	200,000,000	197,745,501.39	8.94	-1.13	2	
合計	600,000,000	591,351,871.08	8.32	-1.44		

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4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	267,475,099.17	4.01	5.22	1	-1.46
貝萊德法人信託	250,000,000	261,501,581.43	5.49	-0.75	2	
合計	500,000,000	528,976,680.60	4.74	2.24		

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4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	131,781,443.48	6.63	5.43	2	4.93
瑞銀資產管理	125,000,000	131,980,808.97	6.71	5.58	1	
合計	250,000,000	263,762,252.45	6.67	5.50		

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4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	73,799,395.70	11.59	-1.60	1	-2.44
Cohen & Steers	75,000,000	70,180,164.93	8.07	-6.43	2	
合計	150,000,000	143,979,560.63	9.84	-4.01		

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4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 (%)
Cornerstone	75,000,000	76,106,318.01	2.60	1.48	2	1.86
Cohen & Steers	75,000,000	77,328,436.87	3.14	3.10	1	
合計	150,000,000	153,434,754.88	2.87	2.29		

註：本會指定指標為富時歐洲/北美不動產協會全球指數。