

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106年3月31日止)						
受託機構名稱	委託金額 (美元)	資產淨值 (美元)	106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	501,529,598.40	6.86	31.62	-	26.71
合計	381,056,090.52	501,529,598.40	6.86	31.62		

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106年3月31日止)						
受託機構名稱	委託金額 (美元)	資產淨值 (美元)	106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	294,120,415.80	11.58	11.80	-	7.60
合計	263,076,477.07	294,120,415.80	11.58	11.80		

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106年3月31日止)						
受託機構名稱	委託金額 (美元)	資產淨值 (美元)	106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	518,315,251.40	6.81	14.08	-	12.37
合計	454,341,586.67	518,315,251.40	6.81	14.08		

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106年3月31日止)						
受託機構名稱	委託金額 (美元)	資產淨值 (美元)	106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	321,861,805.89	7.04	60.93	3	64.34
景順德國資產管理	200,000,000	352,229,545.16	7.14	76.11	2	
安聯環球投資	250,000,000	436,357,117.07	5.44	86.91	1	
國際股票型小計	650,000,000	1,110,448,468.12	6.44	74.87		
瑞萬通博資產管理	200,000,000	238,787,193.02	12.71	19.39	-	4.52
新興股票型小計	200,000,000	238,787,193.02	12.71	19.39		
合計	850,000,000	1,349,235,661.14	7.50	61.07		

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106年3月31日止)						
受託機構名稱	委託金額 (美元)	資產淨值 (美元)	106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	237,284,542.46	1.19	16.14	1	14.27
貝萊德投資管理	120,000,000	134,121,739.52	1.56	11.77	2	
合計	340,000,000	371,406,281.98	1.32	14.02		

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106年3月31日止)						
受託機構名稱	委託金額 (美元)	資產淨值 (美元)	106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	203,712,774.28	3.94	1.86	1	6.42
BlueBay	200,000,000	197,032,413.05	3.97	-1.48	3	
Stone Harbor	200,000,000	200,614,500.19	4.80	0.31	2	
合計	600,000,000	601,359,687.52	4.23	0.23		

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106年3月31日止)						
受託機構名稱	委託金額 (美元)	資產淨值 (美元)	106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	295,747,952.93	6.11	16.34	1	7.45
貝萊德法人信託	250,000,000	288,826,669.25	6.94	9.62	2	
合計	500,000,000	584,574,622.18	6.52	12.99		

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106年3月31日止)						
受託機構名稱	委託金額 (美元)	資產淨值 (美元)	106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	140,400,782.01	5.69	12.32	2	11.47
瑞銀資產管理	125,000,000	140,608,225.12	5.68	12.49	1	
合計	250,000,000	281,009,007.13	5.68	12.40		

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106年3月31日止)						
受託機構名稱	委託金額 (美元)	資產淨值 (美元)	106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	78,551,983.32	7.47	4.74	1	6.86
Cohen & Steers	75,000,000	77,126,291.95	7.94	2.84	2	
合計	150,000,000	155,678,275.27	7.71	3.79		

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106年3月31日止)						
受託機構名稱	委託金額 (美元)	資產淨值 (美元)	106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	75,384,610.99	2.23	0.51	2	3.87
Cohen & Steers	75,000,000	79,202,330.22	2.48	5.60	1	
合計	150,000,000	154,586,941.21	2.36	3.06		

註：本會指定指標為富時歐洲/北美不動產協會全球指數。