

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4月30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	510,342,154.18	8.74	33.93	-	28.69
合計	381,056,090.52	510,342,154.18	8.74	33.93		

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4月30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	299,591,166.40	13.66	13.88	-	9.23
合計	263,076,477.07	299,591,166.40	13.66	13.88		

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4月30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	527,453,921.82	8.69	16.09	-	14.13
合計	454,341,586.67	527,453,921.82	8.69	16.09		

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4月30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	329,612,090.29	9.62	64.81	3	66.89
景順德國資產管理	200,000,000	359,481,754.86	9.35	79.74	2	
安聯環球投資	250,000,000	443,284,800.64	7.11	89.88	1	
國際股票型小計	650,000,000	1,132,378,645.79	8.54	78.32		
瑞萬通博資產管理	200,000,000	245,758,197.55	16.00	22.88	-	6.73
新興股票型小計	200,000,000	245,758,197.55	16.00	22.88		
合計	850,000,000	1,378,136,843.34	9.80	64.52		

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4月30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	240,738,428.56	2.67	17.83	1	15.87
貝萊德投資管理	120,000,000	135,985,035.89	2.97	13.32	2	
合計	340,000,000	376,723,464.45	2.77	15.65		

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4月30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	205,317,811.50	4.76	2.66	1	7.41
BlueBay	200,000,000	198,853,909.46	4.93	-0.57	3	
Stone Harbor	200,000,000	202,602,835.31	5.83	1.30	2	
合計	600,000,000	606,774,556.27	5.17	1.13		

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4月30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	300,212,199.72	7.72	18.10	1	8.17
貝萊德法人信託	250,000,000	293,612,352.17	8.71	11.43	2	
合計	500,000,000	593,824,551.89	8.20	14.78		

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4月30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	142,012,913.07	6.90	13.61	2	12.76
瑞銀資產管理	125,000,000	142,266,385.28	6.93	13.81	1	
合計	250,000,000	284,279,298.35	6.91	13.71		

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4月30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	79,737,615.02	9.09	6.32	1	8.45
Cohen & Steers	75,000,000	78,584,565.94	9.99	4.78	2	
合計	150,000,000	158,322,180.96	9.53	5.55		

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4月30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	76,382,879.33	3.59	1.84	2	5.13
Cohen & Steers	75,000,000	80,851,448.89	4.62	7.80	1	
合計	150,000,000	157,234,328.22	4.11	4.82		

註：本會指定指標為富時歐洲/北美不動產協會全球指數。