

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5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	520,859,709.41	10.98	36.69	-	31.53
合計	381,056,090.52	520,859,709.41	10.98	36.69		

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5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	307,608,430.73	16.70	16.93	-	12.17
合計	263,076,477.07	307,608,430.73	16.70	16.93		

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5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	538,369,192.39	10.94	18.49	-	16.65
合計	454,341,586.67	538,369,192.39	10.94	18.49		

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5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	338,181,177.87	12.47	69.09	3	70.54
景順德國資產管理	200,000,000	365,668,833.37	11.23	82.83	2	
安聯環球投資	250,000,000	451,073,773.83	8.99	93.21	1	
國際股票型小計	650,000,000	1,154,923,785.07	10.70	81.87		
瑞萬通博資產管理	200,000,000	254,907,979.81	20.32	27.45	-	9.64
新興股票型小計	200,000,000	254,907,979.81	20.32	27.45		
合計	850,000,000	1,409,831,764.88	12.32	68.31		

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5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	244,921,512.34	4.45	19.88	1	17.81
貝萊德投資管理	120,000,000	138,316,618.09	4.73	15.26	2	
合計	340,000,000	383,238,130.43	4.55	17.65		

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5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	206,438,230.80	5.33	3.22	1	8.88
BlueBay	200,000,000	198,363,058.98	4.68	-0.82	3	
Stone Harbor	200,000,000	203,977,469.85	6.55	1.99	2	
合計	600,000,000	608,778,759.63	5.52	1.46		

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5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	308,036,549.42	10.52	21.17	1	10.84
貝萊德法人信託	250,000,000	303,037,563.77	12.20	15.01	2	
合計	500,000,000	611,074,113.19	11.35	18.11		

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5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	146,108,746.67	9.98	16.89	2	16.00
瑞銀資產管理	125,000,000	146,400,034.35	10.03	17.12	1	
合計	250,000,000	292,508,781.02	10.01	17.00		

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5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	82,354,967.36	12.67	9.81	1	11.46
Cohen & Steers	75,000,000	80,349,466.53	12.46	7.13	2	
合計	150,000,000	162,704,433.89	12.57	8.47		

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5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	77,091,480.37	4.55	2.79	2	6.52
Cohen & Steers	75,000,000	82,833,718.19	7.18	10.44	1	
合計	150,000,000	159,925,198.56	5.90	6.62		

註：本會指定指標為富時歐洲/北美不動產協會全球指數。