

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6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	525,504,970.39	11.97	37.91	-	32.13
合計	381,056,090.52	525,504,970.39	11.97	37.91		

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6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	311,878,258.40	18.32	18.55	-	13.93
合計	263,076,477.07	311,878,258.40	18.32	18.55		

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6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	543,137,532.95	11.93	19.54	-	17.18
合計	454,341,586.67	543,137,532.95	11.93	19.54		

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6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	339,853,592.46	13.03	69.93	3	71.23
景順德國資產管理	200,000,000	368,874,126.72	12.20	84.44	2	
安聯環球投資	250,000,000	456,071,652.62	10.20	95.36	1	
國際股票型小計	650,000,000	1,164,799,371.80	11.65	83.43		
瑞萬通博資產管理	200,000,000	258,589,968.00	22.06	29.29	-	10.26
新興股票型小計	200,000,000	258,589,968.00	22.06	29.29		
合計	850,000,000	1,423,389,339.80	13.40	69.93		

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106年6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	246,864,379.79	5.28	20.83	1	18.31
貝萊德投資管理	120,000,000	139,151,032.98	5.36	15.96	2	
合計	340,000,000	386,015,412.77	5.31	18.51		

註：本會指定指標為巴克萊資本全球綜合公司債券指數。

第9次-高股利股票型(自103年10月1日至106年6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	308,553,328.80	10.71	21.38	1	10.59
貝萊德法人信託	250,000,000	303,050,636.96	12.20	15.01	2	
合計	500,000,000	611,603,965.76	11.44	18.21		

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6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	145,400,281.68	9.45	16.32	2	15.35
瑞銀資產管理	125,000,000	145,680,447.28	9.49	16.54	1	
合計	250,000,000	291,080,728.96	9.47	16.43		

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6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	81,725,628.62	11.81	8.97	1	10.84
Cohen & Steers	75,000,000	79,491,594.68	11.26	5.99	2	
合計	150,000,000	161,217,223.30	11.54	7.48		

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6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	77,758,460.95	5.45	3.68	2	7.43
Cohen & Steers	75,000,000	83,388,582.17	7.90	11.18	1	
合計	150,000,000	161,147,043.12	6.70	7.43		

註：本會指定指標為富時歐洲/北美不動產協會全球指數。

第11次-多元資產型(自106年6月5日至106年6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	100,000,000	99,229,228.76	-0.77	-0.77	3	0.09
摩根資產管理	100,000,000	99,655,672.73	-0.34	-0.34	1	
聯博	100,000,000	99,595,640.92	-0.40	-0.40	2	
合計	300,000,000	298,480,542.41	-0.51	-0.51		

註：本會指定指標為USD 3-Month LIBOR。