

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11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	456,310,116.82	3.56	19.75	-	16.02
合計	381,056,090.52	456,310,116.82	3.56	19.75		

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11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	266,763,319.03	5.18	1.40	-	-3.68
合計	263,076,477.07	266,763,319.03	5.18	1.40		

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11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	471,791,879.69	3.55	3.84	-	2.89
合計	454,341,586.67	471,791,879.69	3.55	3.84		

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11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	296,568,309.54	2.37	48.28	3	50.33
景順德國資產管理	200,000,000	323,987,292.84	3.19	61.99	2	
安聯環球投資	250,000,000	402,100,321.63	6.21	72.24	1	
國際股票型小計	650,000,000	1,022,655,924.01	4.11	61.04		
瑞萬通博資產管理	200,000,000	212,649,162.61	2.41	6.32	-	-6.58
新興股票型小計	200,000,000	212,649,162.61	2.41	6.32		
合計	850,000,000	1,235,305,086.62	3.82	47.47		

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11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	220,000,000	233,357,173.22	3.50	14.22	1	11.97
貝萊德投資管理	120,000,000	131,517,021.68	2.26	9.60	2	
合計	340,000,000	364,874,194.90	2.99	12.02		

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105年11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	194,577,026.02	6.26	-2.71	1	1.39
BlueBay	200,000,000	188,430,651.35	3.93	-5.78	3	
Stone Harbor	200,000,000	189,959,429.17	4.65	-5.02	2	
合計	600,000,000	572,967,106.54	4.95	-4.51		

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11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	270,127,855.29	5.04	6.26	1	-1.37
貝萊德法人信託	250,000,000	263,000,186.46	6.09	-0.19	2	
合計	500,000,000	533,128,041.75	5.56	3.04		

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11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	130,219,276.38	5.36	4.18	2	3.54
瑞銀資產管理	125,000,000	130,432,851.96	5.46	4.35	1	
合計	250,000,000	260,652,128.34	5.41	4.26		

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11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	71,727,080.39	8.46	-4.36	1	-2.86
Cohen & Steers	75,000,000	69,714,774.80	7.35	-7.05	2	
合計	150,000,000	141,441,855.19	7.91	-5.71		

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11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 (%)
Barings	75,000,000	71,843,904.62	-3.14	-4.21	2	-1.85
Cohen & Steers	75,000,000	75,136,451.40	0.21	0.18	1	
合計	150,000,000	146,980,356.02	-1.46	-2.01		

註：本會指定指標為富時歐洲/北美不動產協會全球指數。