

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12月31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	469,330,412.45	6.51	23.17	-	18.53
合計	381,056,090.52	469,330,412.45	6.51	23.17		

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12月31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	263,588,255.83	3.93	0.19	-	-4.74
合計	263,076,477.07	263,588,255.83	3.93	0.19		

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12月31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	485,265,605.44	6.50	6.81	-	5.11
合計	454,341,586.67	485,265,605.44	6.50	6.81		

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12月31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	300,685,082.36	3.79	50.34	3	53.72
景順德國資產管理	200,000,000	328,758,627.24	4.71	64.38	2	
安聯環球投資	250,000,000	413,858,030.18	9.32	77.27	1	
國際股票型小計	650,000,000	1,043,301,739.78	6.22	64.30		
瑞萬通博資產管理	200,000,000	211,854,893.10	2.02	5.93	-	-6.24
新興股票型小計	200,000,000	211,854,893.10	2.02	5.93		
合計	850,000,000	1,255,156,632.88	5.48	49.84		

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12月31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	234,485,804.52	4.00	14.77	1	12.48
貝萊德投資管理	120,000,000	132,067,254.72	2.69	10.06	2	
合計	340,000,000	366,553,059.24	3.46	12.53		

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12月31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	195,993,242.53	7.03	-2.00	1	2.06
BlueBay	200,000,000	189,503,749.74	4.52	-5.25	3	
Stone Harbor	200,000,000	191,434,753.42	5.46	-4.28	2	
合計	600,000,000	576,931,745.69	5.68	-3.84		

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12月31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	278,705,231.54	8.38	9.64	1	1.52
貝萊德法人信託	250,000,000	270,094,544.37	8.96	2.51	2	
合計	500,000,000	548,799,775.91	8.66	6.07		

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12月31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	132,846,105.95	7.49	6.28	2	5.55
瑞銀資產管理	125,000,000	133,049,899.75	7.57	6.44	1	
合計	250,000,000	265,896,005.70	7.53	6.36		

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12月31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	73,091,112.85	10.52	-2.55	1	-0.61
Cohen & Steers	75,000,000	71,449,837.69	10.02	-4.73	2	
合計	150,000,000	144,540,950.54	10.27	-3.64		

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12月31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	73,737,566.48	-0.59	-1.68	2	0.66
Cohen & Steers	75,000,000	77,284,615.96	3.08	3.05	1	
合計	150,000,000	151,022,182.44	1.25	0.68		

註：本會指定指標為富時歐洲/北美不動產協會全球指數。