

## 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1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	481,736,238.60	2.64	26.42	-	21.77
<b>合計</b>	<b>381,056,090.52</b>	<b>481,736,238.60</b>	<b>2.64</b>	<b>26.42</b>		

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1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	280,201,647.33	6.30	6.51	-	0.89
<b>合計</b>	<b>263,076,477.07</b>	<b>280,201,647.33</b>	<b>6.30</b>	<b>6.51</b>		

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1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	497,992,106.29	2.62	9.61	-	7.99
<b>合計</b>	<b>454,341,586.67</b>	<b>497,992,106.29</b>	<b>2.62</b>	<b>9.61</b>		

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1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	311,452,227.12	3.58	55.73	3	57.87
景順德國資產管理	200,000,000	337,467,761.84	2.65	68.73	2	
安聯環球投資	250,000,000	421,767,840.66	1.91	80.66	1	
<b>國際股票型小計</b>	<b>650,000,000</b>	<b>1,070,687,829.62</b>	<b>2.62</b>	<b>68.61</b>		
瑞萬通博資產管理	200,000,000	221,575,344.60	4.59	10.79	-	-1.18
<b>新興股票型小計</b>	<b>200,000,000</b>	<b>221,575,344.60</b>	<b>4.59</b>	<b>10.79</b>		
<b>合計</b>	<b>850,000,000</b>	<b>1,292,263,174.22</b>	<b>2.96</b>	<b>54.27</b>		

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1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	235,782,261.07	0.55	15.40	1	13.47
貝萊德投資管理	120,000,000	133,164,881.44	0.83	10.97	2	
<b>合計</b>	<b>340,000,000</b>	<b>368,947,142.51</b>	<b>0.65</b>	<b>13.27</b>		

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1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	198,875,648.35	1.47	-0.56	1	3.69
BlueBay	200,000,000	192,170,648.60	1.41	-3.91	3	
Stone Harbor	200,000,000	194,736,188.85	1.72	-2.63	2	
<b>合計</b>	<b>600,000,000</b>	<b>585,782,485.80</b>	<b>1.53</b>	<b>-2.37</b>		

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1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	283,431,537.21	1.70	11.49	1	2.96
貝萊德法人信託	250,000,000	275,318,953.07	1.93	4.49	2	
<b>合計</b>	<b>500,000,000</b>	<b>558,750,490.28</b>	<b>1.81</b>	<b>8.00</b>		

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1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	135,090,461.59	1.69	8.07	2	7.34
瑞銀資產管理	125,000,000	135,326,545.38	1.71	8.26	1	
<b>合計</b>	<b>250,000,000</b>	<b>270,417,006.97</b>	<b>1.70</b>	<b>8.17</b>		

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1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	74,283,556.02	1.63	-0.96	1	0.62
Cohen & Steers	75,000,000	72,655,215.43	1.69	-3.13	2	
<b>合計</b>	<b>150,000,000</b>	<b>146,938,771.45</b>	<b>1.66</b>	<b>-2.04</b>		

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1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	73,984,133.63	0.33	-1.35	2	1.72
Cohen & Steers	75,000,000	78,228,031.14	1.22	4.30	1	
<b>合計</b>	<b>150,000,000</b>	<b>152,212,164.77</b>	<b>0.79</b>	<b>1.47</b>		

註：本會指定指標為富時歐洲/北美不動產協會全球指數。