

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2月28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	495,459,396.10	5.57	30.02	-	25.18
合計	381,056,090.52	495,459,396.10	5.57	30.02		

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2月28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	284,737,519.63	8.02	8.23	-	4.21
合計	263,076,477.07	284,737,519.63	8.02	8.23		

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2月28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	512,206,293.58	5.55	12.74	-	11.02
合計	454,341,586.67	512,206,293.58	5.55	12.74		

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2月28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	317,469,426.90	5.58	58.73	3	62.36
景順德國資產管理	200,000,000	349,237,926.85	6.23	74.62	2	
安聯環球投資	250,000,000	432,062,640.95	4.40	85.07	1	
國際股票型小計	650,000,000	1,098,769,994.70	5.32	73.03		
瑞萬通博資產管理	200,000,000	229,041,106.63	8.11	14.52	-	1.82
新興股票型小計	200,000,000	229,041,106.63	8.11	14.52		
合計	850,000,000	1,327,811,101.33	5.79	58.52		

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2月28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	237,333,540.49	1.21	16.16	1	14.30
貝萊德投資管理	120,000,000	134,018,426.15	1.48	11.68	2	
合計	340,000,000	371,351,966.64	1.31	14.00		

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2月28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	201,619,674.19	2.87	0.81	1	5.40
BlueBay	200,000,000	194,836,213.93	2.81	-2.58	3	
Stone Harbor	200,000,000	198,072,097.52	3.47	-0.96	2	
合計	600,000,000	594,527,985.64	3.05	-0.91		

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2月28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	291,958,732.29	4.76	14.85	1	6.09
貝萊德法人信託	250,000,000	283,950,469.10	5.13	7.77	2	
合計	500,000,000	575,909,201.39	4.94	11.31		

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2月28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	139,527,121.88	5.03	11.62	2	10.82
瑞銀資產管理	125,000,000	139,736,156.46	5.03	11.79	1	
合計	250,000,000	279,263,278.34	5.03	11.71		

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2月28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	76,712,152.06	4.95	2.28	1	3.80
Cohen & Steers	75,000,000	75,423,395.76	5.56	0.56	2	
合計	150,000,000	152,135,547.82	5.25	1.42		

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2月28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	76,427,514.90	3.65	1.90	2	5.03
Cohen & Steers	75,000,000	80,729,685.08	4.46	7.64	1	
合計	150,000,000	157,157,199.98	4.06	4.77		

註：本會指定指標為富時歐洲/北美不動產協會全球指數。