

公務人員退休撫卹基金簡訊

(106年11月刊登)

資訊報導

參加退撫基金人數

截至 106 年 9 月底止，參加基金之機關學校總數為 7,209 個，參加之總人數為 637,852 人，各身分別人數及比例：

身 分 別	人 數	比 例
公 務 人 員	293,992	46.09%
教 育 人 員	183,710	28.80%
軍 職 人 員	160,150	25.11%
合 計	637,852	100.00%

退撫基金收支情形

1、基金收繳

基金成立以來累計至 106 年 9 月底止，各類人員其本人及政府撥繳之基金費用（不含括營運管理收入）及其比例：

身 分 別	累 計 金 額 (億 元)	比 例
公 務 人 員	4,888.9261	47.69%
教 育 人 員	3,787.7493	36.95%
軍 職 人 員	1,575.1021	15.36%
合 計	10,251.7775	100.00%

2、基金撥付

基金成立以來累計至 106 年 9 月底止，各類人員退撫給與之支付金額及其比率：

身 分 別	累 計 金 額 (億 元)	占 累 計 收 入 比 率
公 務 人 員	2,674.9992	54.72%
教 育 人 員	2,534.9303	66.92%
軍 職 人 員	1,563.8087	99.28%
合 計	6,773.7382	66.07%

106年9月份各類退撫給與人數統計表

單位：人

退撫類別 身分別	一次退休 (伍)金	月退休金 (俸)	資遣	撫卹	離職退費	合計
公務人員	36	326	1	30	34	427
教育人員	1	9	0	8	6	24
軍職人員	751	202	0	11	296	1,260
合計	788	537	1	49	336	1,711

附註：1.軍職人員無資遣給與規定。兼領月退休金列入月退休金人數統計。

2.上列統計人數，不含統計後再追辦退休、資遣案之人數。

退撫基金資產明細(截至106年9月30日止)

單位：新臺幣萬元；%

項目別	金額	比例
一、臺幣存款	5,325,720	9.29
二、外幣存款	4,357,753	7.60
三、國內外上市(上櫃)公司股票	7,818,230	13.63
四、國內外短期票券及庫券	7,480,715	13.04
五、國內外債券	9,605,077	16.75
六、國內外開放型受益憑證	1,160,551	2.02
七、國內外委託經營	21,475,783	37.45
八、其他短期投資	-	-
九、應收款項	110,419	0.19
十、預付款項	12,607	0.02
十一、催收款項	493	-
合計	57,347,348	100.00

備註：

- 1.資料部分數值受尾數四捨五入進位影響合計數或有微差，惟仍無損報表表達應有之允適性。
- 2.本基金自105年度開始採用國際財務報導準則。

退撫基金委託經營績效統計表

1. 國內委託經營

單位：新臺幣元，%

第 12 次委託經營 (自 101 年 6 月 5 日至 106 年 9 月 30 日止)						
受託機構名稱	委託金額	資產淨值	106 年度 報酬率(%)	委託迄今		
				報酬率(%)	委託經營 排名	大盤/指標 報酬率(%)
安聯投信	4,000,000,000	7,510,418,642	20.38	100.34	1	86.45
統一投信	4,000,000,000	6,740,248,195	14.85	74.50	2	
合計	8,000,000,000	14,250,666,837	17.70	87.32		

註：本批次委託經營係追蹤指數(相對報酬型)，以台灣證券交易所編製之發行量加權股價報酬指數之投資報酬率加 100 個基本點為年投資報酬目標。

第 13 次委託經營 (自 103 年 9 月 26 日至 106 年 9 月 30 日止)						
受託機構名稱	委託金額	資產淨值	106 年度 報酬率(%)	委託迄今		
				報酬率(%)	委託經營 排名	大盤/指標 報酬率(%)
安聯投信	5,000,000,000	6,505,582,971	20.50	34.06	1	29.65
匯豐中華投信	5,000,000,000	6,479,246,710	17.25	28.57	2	
施羅德投信	5,000,000,000	6,162,801,783	16.77	26.85	3	
保德信投信	5,000,000,000	6,286,730,411	14.98	26.61	4	
統一投信	5,000,000,000	6,283,626,537	14.51	25.33	5	
合計	25,000,000,000	31,717,988,412	16.79	28.30		

註：本批次委託經營係追蹤指數(相對報酬型)，以台灣證券交易所編製之發行量加權股價報酬指數之投資報酬率加 100 個基本點為年投資報酬目標。

第 14 次委託經營 (自 104 年 3 月 3 日至 106 年 9 月 30 日止)						
受託機構名稱	委託金額	資產淨值	106 年度 報酬率(%)	委託迄今		
				報酬率(%)	委託經營 排名	大盤/指標 報酬率(%)
施羅德投信	3,500,000,000	3,966,788,481	14.04	13.52	1	8.15
國泰投信	3,500,000,000	3,964,959,865	12.11	12.66	2	
匯豐中華投信	3,500,000,000	3,937,587,224	10.32	12.05	3	
保德信投信	3,500,000,000	3,839,922,475	7.63	9.46	4	
合計	14,000,000,000	15,709,258,045	11.00	11.93		

註：本批次委託經營係非追蹤指數(絕對報酬型)，以台灣證券交易所公告之股票集中市場近 4 年年底殖利率之簡單平均數加 2% 為年投資報酬目標。

2. 國外委託經營

單位：美元，%

第 4 次續約-國際股票型(自 102 年 9 月 14 日至 106 年 9 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	557,537,935.59	18.79	46.31	-	38.98
合計	381,056,090.52	557,537,935.59	18.79	46.31		

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 9 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	331,744,245.60	25.86	26.10	-	21.43
合計	263,076,477.07	331,744,245.60	25.86	26.10		

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 9 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	576,200,946.94	18.74	26.82	-	23.25
合計	454,341,586.67	576,200,946.94	18.74	26.82		

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 9 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	362,351,885.89	20.51	81.18	3	80.02
景順德國資產管理	200,000,000	387,750,308.52	17.94	93.88	2	
安聯環球投資	250,000,000	486,311,630.56	17.51	108.31	1	
國際股票型小計	650,000,000	1,236,413,824.97	18.51	94.71		
瑞萬通博資產管理	200,000,000	269,230,222.13	27.08	34.62	-	19.56
新興股票型小計	200,000,000	269,230,222.13	27.08	34.62	-	
合計	850,000,000	1,505,644,047.10	19.96	79.75		

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 9 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	253,084,096.35	7.93	23.87	1	20.96
貝萊德投資管理	120,000,000	142,512,446.59	7.91	18.76	2	
合計	340,000,000	395,596,542.94	7.92	21.45		

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 9 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	324,642,955.68	16.48	27.71	1	15.75
貝萊德法人信託	250,000,000	320,356,761.27	18.61	21.58	2	
合計	500,000,000	644,999,716.95	17.53	24.67		

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 9 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	149,952,777.13	12.88	19.96	2	18.86
瑞銀資產管理	125,000,000	150,223,566.53	12.91	20.18	1	
合計	250,000,000	300,176,343.66	12.89	20.07		

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 9 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	83,731,925.58	14.56	11.64	1	14.50
Cohen & Steers	75,000,000	81,895,111.85	14.62	9.19	2	
合計	150,000,000	165,627,037.43	14.59	10.42		

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 9 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	79,327,811.19	7.58	5.77	2	10.81
Cohen & Steers	75,000,000	85,442,753.40	10.56	13.92	1	
合計	150,000,000	164,770,564.59	9.10	9.85		

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 9 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	101,646,756.21	1.65	1.65	3	0.42
摩根資產管理	100,000,000	102,464,125.56	2.46	2.46	1	
聯博	100,000,000	101,841,666.85	1.84	1.84	2	
合計	300,000,000	305,952,548.62	1.98	1.98		

註：本會指定指標為 USD 3-Month LIBOR。

退撫基金歷年績效表

單位：新臺幣億元，%

年度	已實現 收益數 (億元)	已實現 收益率 (%)	整體收益數 ^{註3} (億元)	整體收益率 ^{註3} (%)	臺銀2年 定期存 款利率(%)
85	4.83	7.78	4.83	7.78	6.93
86	34.66	12.42	34.19	12.25	6.29
87	52.86	9.12	15.51	2.68	6.31
88	73.97	8.18	110.40	12.21	5.85
89(註1)	196.92	9.97	-171.83	-8.70	5.14
90	67.13	4.72	54.71	3.85	4.02
91	45.43	2.59	-44.26	-2.53	2.25
92	39.50	1.95	164.98	8.13	1.57
93	63.32	2.63	53.14	2.21	1.50
94	99.14	3.66	128.30	4.74	1.81
95	140.96	4.45	346.63	10.93	2.18
96	210.88	5.62	184.28	4.91	2.47
97	-94.97	-2.46	-860.87	-22.33	2.69
98	63.59	1.63	762.63	19.49	0.94
99	134.89	3.05	159.47	3.60	1.07
100	68.73	1.44	-284.51	-5.98	1.32
101	106.63	2.21	298.11	6.17	1.40
102	205.92	4.00	427.68	8.30	1.40
103	252.11	4.60	356.46	6.50	1.40
104	131.29	2.34	-108.77	-1.94	1.38
105	110.75	2.01	236.93	4.29	1.12
106(9月)(註2)	167.08	3.02	323.12	5.84	1.04

註1：89年度係一年半之會計期間。

註2：106(9月)之收益率係為106年度截至9月底之期間收益率。

註3：整體收益數(率)係為加計未實現損益及備供出售金融資產投資評價損益後之收益數(率)。