

壹、業務報導：

新制退撫給與專戶自即日起可至退撫基金代付銀行辦理開戶事宜

- 1、為配合公務人員退休資遣撫卹法第 69 條、公立學校教職員退休資遣撫卹條例第 69 條及政務人員退職撫卹條例第 11 條有關退撫給與領受人得於金融機構開立專戶之規定，公務人員退休撫卹基金管理委員會(以下簡稱基金管理會)業規劃新制退撫給與專戶(以下簡稱新制專戶)設立及撥款流程與相關書表，並請基金管理會委託代付之臺灣銀行、合作金庫商業銀行及第一商業銀行協助完成建置新制專戶系統程式，自即日起上開代付銀行所屬各地分行均可受理新制專戶開戶事宜。
- 2、另有關舊制退撫給與部分，必須另行開立專戶，依照銓敘部目前規劃，將由中央及地方主管機關另決定是否選擇上開與新制相同之代付銀行開立舊制退撫給與專戶(以下簡稱舊制專戶)，或另洽其他金融機構委託辦理。由於各代付銀行管控舊制專戶存款來源之系統程式相較新制專戶複雜，目前尚未完成修正系統程式，現階段僅有新制專戶開戶事宜先行施行，俟舊制專戶相關作業完備後，再由主管機關另為通知。

辦理退撫基金 106 年度國外委託經營業務公開徵求受託機構案

106 年度國外委託經營業務公開徵求受託機構案業於本（106）年 10 月 6 日提經基金管理會第 223 次委員會議審議通過。本次委託案之重點如下：

- 一、委託類型：總報酬固定收益型【Total Return Fixed Income】。
- 二、委託額度及家數：至多 8 億美元整，預計委託 4 家業者，每家業者 2 億美元。
- 三、委託期間：自基金管理會首次實際撥存委託投資資本至保管機構之日起 5 年。
- 四、目標報酬率：淨年投資報酬率需超過指定指標 US 3-Month T-Bill Yield Index 加計 2.5% 之年目標報酬率。

貳、資訊報導

參加退撫基金人數

截至 106 年 10 月底止，參加基金之機關學校總數為 7,207 個，參加之總人數為 638,847 人，各身分別人數及比例：

身 分 別	人 數	比 例
公 務 人 員	294,407	46.08%
教 育 人 員	183,632	28.75%
軍 職 人 員	160,808	25.17%
合 計	638,847	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 10 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	4,912.3558	47.69%
教 育 人 員	3,806.0674	36.95%
軍 職 人 員	1,582.8630	15.36%
合 計	10,301.2862	100.00%

2、基金撥付

基金成立以來累計至 106 年 10 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	2,676.9190	54.49%
教 育 人 員	2,535.2060	66.61%
軍 職 人 員	1,566.3967	98.96%
合 計	6,778.5217	65.80%

106 年 10 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	32	195	0	0	27	254
教育人員	1	4	1	0	1	7
軍職人員	759	92	0	0	250	1,101
合計	792	291	1	0	278	1,362

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 10 月 31 日止)

單位：新臺幣萬元；%

項目別	金額	比例
一、臺幣存款	5,346,954	9.14
二、外幣存款	4,384,542	7.49
三、國內外上市(上櫃)公司股票	7,992,948	13.66
四、國內外短期票券及庫券	7,952,658	13.59
五、國內外債券	9,591,755	16.39
六、國內外開放型受益憑證	1,176,055	2.01
七、國內外委託經營	21,926,952	37.46
八、其他短期投資	-	-
九、應收款項	151,067	0.26
十、預付款項	8,501	0.01
十一、催收款項	493	-
合計	58,531,925	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 10 月 31 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	7,923,106,872	26.99	111.35	1	93.82
統一投信	4,000,000,000	6,942,673,547	18.30	79.74	2	
合計	8,000,000,000	14,865,780,419	22.78	95.40		

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 10 月 31 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	6,862,669,390	27.12	41.42	1	34.78
匯豐中華投信	5,000,000,000	6,747,072,471	22.10	33.89	2	
施羅德投信	5,000,000,000	6,495,636,618	23.08	33.70	3	
保德信投信	5,000,000,000	6,550,528,676	19.80	31.92	4	
統一投信	5,000,000,000	6,468,120,379	17.87	29.01	5	
合計	25,000,000,000	33,124,027,534	21.97	33.98		

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 10 月 31 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	4,163,267,112	19.69	19.15	1	12.42
國泰投信	3,500,000,000	4,063,573,505	14.90	15.46	2	
匯豐中華投信	3,500,000,000	4,032,336,476	12.97	14.75	3	
保德信投信	3,500,000,000	4,008,460,927	12.35	14.27	4	
合計	14,000,000,000	16,267,638,020	14.95	15.90		

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 10 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	569,858,312.00	21.42	49.55	-	41.86
合計	381,056,090.52	569,858,312.00	21.42	49.55		

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 10 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	340,734,241.78	29.27	29.52	-	26.02
合計	263,076,477.07	340,734,241.78	29.27	29.52		

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 10 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	588,891,593.63	21.35	29.61	-	25.81
合計	454,341,586.67	588,891,593.63	21.35	29.61		

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 10 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	369,115,521.28	22.76	84.56	3	83.79
景順德國資產管理	200,000,000	396,652,124.30	20.65	98.33	2	
安聯環球投資	250,000,000	496,735,367.85	20.03	112.77	1	
國際股票型小計	650,000,000	1,262,503,013.43	21.01	98.81		
瑞萬通博資產管理	200,000,000	268,867,133.74	26.91	34.43	-	23.33
新興股票型小計	200,000,000	268,867,133.74	26.91	34.43	-	
合計	850,000,000	1,531,370,147.17	22.01	82.82		

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 10 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	253,744,417.32	8.21	24.19	1	21.05
貝萊德投資管理	120,000,000	142,828,749.45	8.15	19.02	2	
合計	340,000,000	396,573,166.77	8.19	21.75		

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 10 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	326,616,908.39	17.19	28.48	1	16.24
貝萊德法人信託	250,000,000	324,265,832.05	20.06	23.07	2	
合計	500,000,000	650,882,740.44	18.60	25.80		

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 10 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	152,276,884.40	14.63	21.82	2	20.77
瑞銀資產管理	125,000,000	152,576,510.35	14.68	22.06	1	
合計	250,000,000	304,853,394.75	14.65	21.94		

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 10 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	83,661,988.55	14.46	11.55	1	14.33
Cohen & Steers	75,000,000	82,165,966.92	15.00	9.55	2	
合計	150,000,000	165,827,955.47	14.73	10.55		

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 10 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	79,859,405.23	8.30	6.48	2	10.31
Cohen & Steers	75,000,000	85,122,485.41	10.14	13.50	1	
合計	150,000,000	164,981,890.64	9.24	9.99		

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 10 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	100,000,000	102,720,823.94	2.72	2.72	3	0.54
摩根資產管理	100,000,000	104,678,711.60	4.68	4.68	1	
聯博	100,000,000	102,840,765.46	2.84	2.84	2	
合計	300,000,000	310,240,301.00	3.41	3.41		

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(10月)(註2)	177.96	3.22	391.45	7.07	1.04

註1：89年度係一年半之會計期間。

註2：106(10月)之收益率係為106年度截至10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)。