

壹、業務報導：

退撫基金 106 年度決算，業已公告於退撫基金管理委員會網站

「公務人員退休撫卹基金 106 年度決算」業經公務人員退休撫卹基金管理委員會 107 年 4 月 13 日第 229 次委員會議及公務人員退休撫卹基金監理委員會同年 5 月 21 日第 103 次委員會議審議通過在案，欲瞭解相關訊息者可上退撫基金網站點選「政府公開資訊」、「基金管理委員會預算決算書」查詢，網址：<http://www.fund.gov.tw>。

貳、資訊報導

參加退撫基金人數

截至 107 年 6 月底止，參加基金之機關學校總數為 7,163 個，參加之總人數為 640,365 人，各身分別人數及比例：

身 分 別	人 數	比 例
公 務 人 員	294,878	46.05%
教 育 人 員	181,332	28.32%
軍 職 人 員	164,155	25.63%
合 計	640,365	100.00%

退撫基金收支情形

1、基金收繳

基金成立以來累計至 107 年 6 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	5,105.6805	47.65%
教 育 人 員	3,956.3865	36.92%
軍 職 人 員	1,652.9104	15.43%
合 計	10,714.9774	100.00%

2、基金撥付

基金成立以來累計至 107 年 6 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	2,888.8734	56.58%
教 育 人 員	2,703.0521	68.32%
軍 職 人 員	1,660.5643	100.46%
合 計	7,252.4898	67.69%

107 年 6 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	237	1,757	0	2	77	2,073
教 育 人 員	8	603	1	6	14	632
軍 職 人 員	497	89	0	8	206	800
合 計	742	2,449	1	16	297	3,505

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 107 年 6 月 30 日止)

單位：新臺幣萬元；%

項目別	金額	比例
一、臺幣存款	4,650,190	7.79
二、外幣存款	2,231,664	3.74
三、國內外上市(上櫃)公司股票	7,911,089	13.26
四、國內外短期票券及庫券	6,573,377	11.02
五、國內外債券	10,288,654	17.24
六、國內外開放型受益憑證	1,116,987	1.87
七、國內外委託經營	25,987,498	43.55
八、其他短期投資	-	-
九、應收款項	169,702	0.28
十、預付款項	739,223	1.24
十一、催收款項	409	-
合計	59,668,793	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 107 年 6 月 30 日止)						
受託機構名稱	委託金額	資產淨值	107 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	6,000,000,000	9,994,819,773	3.92	112.54	1	96.46
統一投信	4,000,000,000	7,331,162,531	7.67	89.80	2	
合計	10,000,000,000	17,325,982,304	5.47	100.43		

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 107 年 6 月 30 日止)						
受託機構名稱	委託金額	資產淨值	107 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	6,903,036,126	3.98	42.25	1	36.62
統一投信	5,000,000,000	6,867,135,248	8.41	36.97	2	
施羅德投信	5,000,000,000	6,624,775,587	5.19	36.36	3	
匯豐中華投信	5,000,000,000	6,819,280,153	3.67	35.32	4	
保德信投信	5,000,000,000	6,693,880,862	3.62	34.81	5	
合計	25,000,000,000	33,908,107,976	4.95	37.16		

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 107 年 6 月 30 日止)						
受託機構名稱	委託金額	資產淨值	107 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	5,000,000,000	5,749,659,181	2.95	19.54	1	12.87
國泰投信	5,000,000,000	5,732,720,839	4.56	17.97	2	
匯豐中華投信	5,000,000,000	5,572,673,104	1.48	14.73	3	
保德信投信	3,500,000,000	3,899,325,022	-0.89	11.15	4	
合計	18,500,000,000	20,954,378,146	2.03	15.84		

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 107 年 6 月 30 日止)						
受託機構名稱	委託金額 (美元)	資產淨值 (美元)	107 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	575,974,994.24	-2.21	51.15	-	46.30
合計	381,056,090.52	575,974,994.24	-2.21	51.15		

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 107 年 6 月 30 日止)						
受託機構名稱	委託金額 (美元)	資產淨值 (美元)	107 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	353,747,753.84	-1.14	34.47	-	25.67
合計	263,076,477.07	353,747,753.84	-1.14	34.47		

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 107 年 6 月 30 日止)						
受託機構名稱	委託金額 (美元)	資產淨值 (美元)	107 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	594,981,415.32	-2.24	30.95	-	29.75
合計	454,341,586.67	594,981,415.32	-2.24	30.95		

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 107 年 6 月 30 日止)						
受託機構名稱	委託金額 (美元)	資產淨值 (美元)	107 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	386,854,636.04	1.18	93.43	3	89.40
景順德國資產管理	200,000,000	404,511,061.74	-1.58	102.26	2	
安聯環球投資	250,000,000	507,470,617.18	-1.60	117.37	1	
國際股票型小計	650,000,000	1,298,836,314.96	-0.78	104.54		
瑞萬通博資產管理	200,000,000	262,365,216.12	-7.52	31.18	-	19.27
新興股票型小計	200,000,000	262,365,216.12	-7.52	31.18	-	
合計	850,000,000	1,561,201,531.08	-1.98	86.38		

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 107 年 6 月 30 日止)						
受託機構名稱	委託金額 (美元)	資產淨值 (美元)	107 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	248,023,850.53	-3.86	21.39	1	18.81
貝萊德投資管理	120,000,000	139,573,503.73	-3.54	16.31	2	
合計	340,000,000	387,597,354.26	-3.74	18.99		

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 107 年 6 月 30 日止)						
受託機構名稱	委託金額 (美元)	資產淨值 (美元)	107 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	328,969,754.66	-2.84	29.41	1	15.79
貝萊德法人信託	250,000,000	333,099,006.85	-1.32	26.42	2	
合計	500,000,000	662,068,761.51	-2.08	27.97		

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 107 年 6 月 30 日止)						
受託機構名稱	委託金額 (美元)	資產淨值 (美元)	107 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	157,132,152.08	-0.15	25.71	2	24.30
瑞銀資產管理	125,000,000	157,339,746.29	-0.13	25.87	1	
合計	250,000,000	314,471,898.37	-0.14	25.79		

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 107 年 6 月 30 日止)						
受託機構名稱	委託金額 (美元)	資產淨值 (美元)	107 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	83,415,482.78	-2.02	11.22	1	13.63
Cohen & Steers	75,000,000	82,584,012.80	-1.59	10.11	2	
合計	150,000,000	165,999,495.58	-1.81	10.67		

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 107 年 6 月 30 日止)

受託機構名稱	委託金額 (美元)	資產淨值 (美元)	107 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	83,586,954.65	0.44	11.45	2	14.16
Cohen & Steers	75,000,000	88,928,931.78	0.38	18.57	1	
合計	150,000,000	172,515,886.43	0.41	15.01		

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 107 年 6 月 30 日止)

受託機構名稱	委託金額 (美元)	資產淨值 (美元)	107 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	203,008,281.74	-1.39	3.83	2	1.85
摩根資產管理	200,000,000	206,527,776.69	-1.00	5.70	1	
聯博	200,000,000	204,155,863.48	-1.07	3.78	3	
合計	600,000,000	613,691,921.91	-1.15	4.44		

註：本會指定指標為 USD 3-Month LIBOR。

第 12 次-總報酬固定收益型(自 107 年 6 月 5 日至 107 年 6 月 30 日止)

受託機構名稱	委託金額 (美元)	資產淨值 (美元)	107 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	100,000,000	99,937,286.02	-0.06%	-0.06%	2	0.13
德意志資產管理	100,000,000	100,105,083.27	0.11%	0.11%	1	
TCW	100,000,000	99,466,457.59	-0.53%	-0.53%	4	
American Century	100,000,000	99,893,283.73	-0.11%	-0.11%	3	
合計	400,000,000	399,402,110.61	-0.15%	-0.15%		

註：本會指定指標為 US 3-Month T-Bill Yield Index。

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	212.02	3.82	397.08	7.15	1.04
107(6月)(註2)	78.51	1.35	103.34	1.78	1.04

註1：89年度係一年半之會計期間。

註2：107(6月)之收益率係為107年度截至6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)。