

# 公務人員退休撫卹基金管理委員會第 118 次委員會議紀錄

時間：民國 97 年 11 月 14 日(星期五)下午 3 時 30 分

地點：考試院傳賢樓 4 樓會議室

主席：張主任委員哲琛

記錄：吳婷

出席人員：

|                 |               |       |
|-----------------|---------------|-------|
| 蔡副主任委員豐清        | 吳委員壽山         | 周委員麗芳 |
| 陳委員登源           | 王委員興尉（嚴上校華新代） |       |
| 蘇委員樂明（戴專門委員龍輝代） |               | 黃委員耀生 |
| 林委員文燦           | 方委員泰霖         | 郝委員建生 |
| 張顧問紫雲           | 張顧問邦良         | 沈顧問慧雅 |
| 吳顧問雨學           | 林顧問建甫         | 王顧問泰昌 |
| 李顧問志宏           | 廖顧問四郎         | 張顧問光第 |

列席單位及人員：

一、公務人員退休撫卹基金監理委員會：

|          |       |       |
|----------|-------|-------|
| 劉代理執行秘書籐 | 陳組長若蘭 | 于專員建中 |
| 許專員欣欣    |       |       |

二、本會：林主任秘書惠美

|         |               |         |
|---------|---------------|---------|
| 簡組長益謙   | 陳組長樞          | 賴組長東亮   |
| 張主任東隆   | 李主任蘊真         | 簡主任淑娟   |
| 林主任秀祝   | 麥專門委員梅嘉       | 張專門委員淑惠 |
| 張約聘人員維祺 | 余科長崇堯（蔡稽核斌仕代） |         |

|               |       |       |
|---------------|-------|-------|
| 吳科長玉貞（魏稽核淑貞代） |       | 蘇科長威郎 |
| 張科長庭偉         | 林科長建宏 | 陳科長淑君 |
| 林科長秋敏         | 杜科長慧芬 |       |

請假人員：

|       |       |       |
|-------|-------|-------|
| 丁委員克華 | 黃委員營杉 | 吳委員中書 |
| 許委員振明 | 陳委員國輝 | 嚴顧問宗大 |
| 王顧問儷容 | 洪顧問茂蔚 | 陳顧問明賢 |
| 劉顧問啟群 | 黃顧問彥聖 |       |

壹、主席致詞：(略)

貳、宣讀本會第 117 次委員會議紀錄。

決定：紀錄確定。

參、報告事項：

一、有關本會第 117 次委員會議決議（定）事項管制情形一案，報請 鑒察。

決定：洽悉。

二、有關本會提報基金監理會第 63 次委員會議議案審議結果，報請 鑒察。

決定：洽悉，陳委員登源所提加強國內資產配置等意見，請財務組參考。

三、有關本基金國外委託經營受託機構申請使用以增加投資效益為目的衍生性金融商品之本會審核項目及流程，報請 鑒察。

決定：

（一）洽悉。

（二）公務人員退休撫卹基金國外委託經營受託機構申請辦

理「以增加投資效益為目的之衍生性金融商品」審核表之審核內容修改如下：

1. 請參考張顧問光第意見，針對結構型商品部分增列信用增強種類及流動性狀況等審核內容。
2. 請參考周委員麗芳意見，針對衍生性商品成本效益分析部分酌做文字調整；加入衍生性商品之新增風險程度部分，分別陳述風險種類及程度。
3. 請參考廖顧問四郎意見，針對加入衍生性商品之新投資組合與原訂指標間差異及績效之評估分析部分，簡併 2 項審核內容並做文字調整。

四、業務單位工作報告（由業務組、財務組、稽核組、資訊室、會計室依序報告）。

決定：

（一）洽悉。

（二）為使各委員、顧問在會議時參考之資料更為準確，有關財務組工作報告之各項數據與開會時之實際數據，因時間落差而有差異情形，可由二個面向檢討改進：

1. 於會議會場上補充最新基金主要項目之淨值變動資料。
2. 調整開會時間於每月下旬舉行委員會議。

肆、討論事項：

一、謹擬具「公務人員退休撫卹基金管理條例施行細則第 13 條修正草案」，提請 審議。

決議：照案通過並依法制作業程序，報請銓敘部審議。

二、謹依公務人員退休撫卹基金內部稽核作業實施要點第 7 點規定，擬具「公務人員退休撫卹基金管理委員會 98 年度稽核作業計畫草案」，提請 審議。

決議：照案通過並函報本基金監理委員會備查。

三、謹擬具「公務人員退休撫卹基金 98 年度國內委託經營計畫(草案)」，提請 審議。

決議：

- (一) 「公務人員退休撫卹基金 98 年度國內委託經營計畫(草案)」中有關「投資績效」文字修正為「經營績效及風險控管」，使其與所依據之「公務人員退休撫卹基金委託經營辦法」文字一致。
- (二) 資產淨值之中心配置，已有上下限之彈性額度，執行時亦會根據市場狀況等情形於允許變動區間內予以調整，請財務組審慎執行委託額度。
- (三) 有關申請業者須於經營計畫建議書中設定風險忍受度部分，本計畫草案中暫不敘明，請財務組先行研究是否由本會設定風險忍受度或由受託機構設定風險忍受度，並提下次委員會議報告後，再作為未來細部規畫之依據。
- (四) 其餘照案通過，並請財務組修正後依法定程序提報本基金監理會委員會議審議。

四、謹擬具「公務人員退休撫卹基金 98 年度國外委託經營計畫(草案)」，提請 審議。

決議：

- (一) 「公務人員退休撫卹基金 98 年度國外委託經營計畫(草案)」中有關公開徵選之委託類型部分刪除「完全報酬型」。
- (二) 有關申請業者須於經營計畫建議書中設定風險忍受度部分，本計畫草案中暫不敘明，請財務組先行研究是否由本會設定風險忍受度或由受託機構設定風險忍受度，並提下次委員會議報告後，再作為未來細部規畫之依據。

(三) 其餘照案通過，並請財務組修正後依法定程序提報本基金監理會委員會議審議。

散會：下午 5 時 45 分

主 席 張哲琛