

公務人員退休撫卹基金簡訊

(106年6月刊登)

資訊報導

參加退撫基金人數

截至 106 年 4 月底止，參加基金之機關學校總數為 7,214 個，參加之總人數為 632,767 人，各身分別人數及比例：

身 分 別	人 數	比 例
公 務 人 員	289,126	45.69%
教 育 人 員	184,172	29.11%
軍 職 人 員	159,469	25.20%
合 計	632,767	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 4 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	4,771.3610	47.69%
教 育 人 員	3,697.9220	36.96%
軍 職 人 員	1,536.0549	15.35%
合 計	10,005.3379	100.00%

2、基金撥付

基金成立以來累計至 106 年 4 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	2,478.8356	51.95%
教 育 人 員	2,374.0452	64.20%
軍 職 人 員	1,477.5398	96.19%
合 計	6,330.4206	63.27%

106 年 4 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	38	330	0	0	21	389
教育人員	1	9	0	0	3	13
軍職人員	423	135	0	0	301	859
合計	462	474	0	0	325	1,261

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 4 月 30 日止)

單位：新臺幣萬元；%

項目別	金額	比例
一、臺幣存款	5,781,129	10.23
二、外幣存款	3,288,820	5.82
三、國內外上市(上櫃)公司股票	7,691,370	13.62
四、國內外短期票券及庫券	7,930,513	14.04
五、國內外債券	9,606,918	17.01
六、國內外開放型受益憑證	1,133,239	2.01
七、國內外委託經營	20,911,249	37.02
八、其他短期投資	-	-
九、應收款項	130,790	0.23
十、預付款項	10,166	0.02
十一、催收款項	160	-
合計	56,484,354	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 國內委託經營	第 13 次 國內委託經營	第 14 次 國內委託經營
	101 年 6 月 5 日~ 106 年 4 月 30 日	103 年 9 月 26 日~ 106 年 4 月 30 日	104 年 3 月 3 日~ 106 年 4 月 30 日
基金委託金額	8,000,000,000	25,000,000,000	17,500,000,000
委託資產淨值	12,800,236,704	28,728,523,512	18,333,029,279
總損益金額	4,800,236,704	3,728,523,512	833,029,279
總損益比率	68.25	16.21	4.53
同 期 間 大 盤 報 酬 率	70.59	18.62	2.82
1 0 6 年 度 報 酬 率	5.72	5.78	4.18

附註：

1. 上表係以「市價法」評價。
2. 第 12 次及第 13 次委託經營係相對報酬股票型，以臺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。
3. 第 14 次委託經營係絕對報酬股票型，以臺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

(1) 第 4 次國外委託經營續約（國際股票型）

	第 4 次國外委託經營續約	
	102 年 9 月 14 日~ 106 年 4 月 30 日	
	以美元計算(元)	以新臺幣計算(元)
基金委託金額	381,056,090.52	(註 1) 11,371,475,853
委託資產淨值	510,342,154.18	(註 2) 15,386,815,948
總損益金額	129,286,063.66	4,015,340,095
投資報酬率	33.93%	35.31%
同 期 間 指 定 指 標 報 酬 率	28.69%	—
106 年度報酬率	8.74%	—

附註：

1. 依 102 年 9 月 13 日央行收盤匯率 29.842 換算。
2. 以新臺幣計算之委託資產淨值係依 106 年 4 月底臺灣銀行外幣結帳價格表之新臺幣對美元匯率 30.150 換算。
3. 國際股票型之目標報酬率，為指定指標 MSCI 全球指數之投資報酬率加 100 個基本點 (1.00%) 之淨年投資報酬率。

(2)第5次國外委託經營續約(亞太股票型)

	第5次國外委託經營續約	
	103年4月28日~ 106年4月30日	
	以美元計算(元)	以新臺幣計算(元)
基金委託金額	263,076,477.07	(註1) 7,976,478,785
委託資產淨值	299,591,166.40	(註2) 9,032,673,667
總損益金額	36,514,689.33	1,056,194,882
投資報酬率	13.88%	13.24%
同期間指定 指標報酬率	9.23%	—
106年度報酬率	13.66%	—

附註：

1. 依103年4月25日央行收盤匯率30.32換算。
2. 以新臺幣計算之委託資產淨值係依106年4月底臺灣銀行外幣結帳價格表之新臺幣對美元匯率30.150換算。
3. 亞太股票型之目標報酬率，為指定指標MSCI亞太(日本、臺灣除外)指數之投資報酬率加75個基本點(0.75%)之淨年投資報酬率。

第5次國外委託經營續約(國際股票型)

	第5次國外委託經營續約	
	103年6月4日~ 106年4月30日	
	以美元計算(元)	以新臺幣計算(元)
基金委託金額	454,341,586.67	(註1) 13,659,325,462
委託資產淨值	527,453,921.82	(註2) 15,902,735,743
總損益金額	73,112,335.15	2,243,410,281
投資報酬率	16.09%	16.42%
同期間指定 指標報酬率	14.13%	—
106年度報酬率	8.69%	—

附註：

1. 依103年6月3日央行收盤匯率30.064換算。
2. 以新臺幣計算之委託資產淨值係依106年4月底臺灣銀行外幣結帳價格表之新臺幣對美元匯率30.150換算。
3. 國際股票型之目標報酬率，為指定指標MSCI全球指數之投資報酬率加50個基本點(0.50%)之淨年投資報酬率。

(3)第 6 次國外委託經營（國際股票型）

	第 6 次國外委託經營	
	100 年 8 月 16 日~ 106 年 4 月 30 日	
	以美元計算(元)	以新臺幣計算(元)
基金委託金額	650,000,000.00	(註 1) 18,891,500,000
委託資產淨值	1,132,378,645.79	(註 2) 34,141,216,171
總損益金額	482,378,645.79	15,249,716,171
投資報酬率	78.32%	85.70%
同 期 間 指 定 指 標 報 酬 率	66.89%	—
106 年度報酬率	8.54%	—

附註：

1. 依 100 年 8 月 15 日央行收盤匯率 28.952 換算(103 年 2 月 12 日增加 5,000 萬美元之入帳成本匯率為 30.406)。
2. 以新臺幣計算之委託資產淨值係依 106 年 4 月底臺灣銀行外幣結帳價格表之新臺幣對美元匯率 30.150 換算。
3. 國際股票型之目標報酬率，為指定指標富時全球指數之投資報酬率加 75 個基本點(0.75%)之淨年投資報酬率。

第 6 次國外委託經營（全球新興股票型）

	第 6 次國外委託經營	
	100 年 8 月 16 日~ 106 年 4 月 30 日	
	以美元計算(元)	以新臺幣計算(元)
基金委託金額	200,000,000.00	(註 1) 5,790,400,000
委託資產淨值	245,758,197.55	(註 2) 7,409,609,656
總損益金額	45,758,197.55	1,619,209,656
投資報酬率	22.88%	27.96%
同 期 間 指 定 指 標 報 酬 率	6.73%	—
106 年度報酬率	16.00%	—

附註：

1. 依 100 年 8 月 15 日央行收盤匯率 28.952 換算。
2. 以新臺幣計算之委託資產淨值係依 106 年 4 月底臺灣銀行外幣結帳價格表之新臺幣對美元匯率 30.150 換算。
3. 全球新興股票型之目標報酬率，為指定指標 MSCI 新興市場(臺灣除外)指數之投資報酬率加 100 個基本點(1.0%)之淨年投資報酬率。

(4)第7次國外委託經營(全球公司債券型)

	第7次國外委託經營	
	101年6月7日~ 106年4月30日	
	以美元計算(元)	以新臺幣計算(元)
基金委託金額	340,000,000.00	(註1) 10,391,700,000
委託資產淨值	376,723,464.45	(註2) 11,358,212,453
總損益金額	36,723,464.45	966,512,453
投資報酬率	15.65%	15.89%
同期間指定 指標報酬率	15.87%	—
106年度報酬率	2.77%	—

附註：

1. 依101年6月6日央行收盤匯率29.935換算。(105年7月15日增加1億美元之入帳成本匯率為32.073)。
2. 以新臺幣計算之委託資產淨值係依106年4月底臺灣銀行外幣結帳價格表之新臺幣對美元匯率30.150換算。
3. 全球公司債券型之目標報酬率，為指定指標巴克萊資本全球綜合公司債券指數之投資報酬率加50個基本點(0.5%)之淨年投資報酬率。

(5)第8次國外委託經營(全球新興市場債券型)

	第8次國外委託經營	
	102年6月4日~ 106年4月30日	
	以美元計算(元)	以新臺幣計算(元)
基金委託金額	600,000,000.00	(註1) 18,042,000,000
委託資產淨值	606,774,556.27	(註2) 18,294,252,872
總損益金額	6,774,556.27	252,252,872
投資報酬率	1.13%	1.40
同期間指定 指標報酬率	7.41%	—
106年度報酬率	5.17%	—

附註：

1. 依102年6月3日央行收盤匯率30.070換算。
2. 以新臺幣計算之委託資產淨值係依106年4月底臺灣銀行外幣結帳價格表之新臺幣對美元匯率30.150換算。
3. 全球新興市場債券型之目標報酬率，為指定指標70%JPMorgan新興市場美元外債指數及30%JPMorgan新興市場當地貨幣債券指數之投資報酬率加75個基本點(0.75%)之淨年投資報酬率。

(6)第 9 次國外委託經營（全球高股利股票型）

	第 9 次國外委託經營	
	103 年 10 月 1 日~ 106 年 4 月 30 日	
	以美元計算(元)	以新臺幣計算(元)
基金委託金額	500,000,000.00	(註 1) 15,924,000,000
委託資產淨值	593,824,551.89	(註 2) 17,903,810,239
總損益金額	93,824,551.89	1,979,810,239
投資報酬率	14.78%	13.70%
同期間指定 指標報酬率	8.17%	—
106 年度報酬率	8.20%	—

附註：

1. 依 103 年 9 月 30 日央行收盤匯率 30.436 換算(104 年 9 月 25 日增加 2.5 億美元之入帳成本匯率為 33.260)。
2. 以新臺幣計算之委託資產淨值係依 106 年 4 月底臺灣銀行外幣結帳價格表之新臺幣對美元匯率 30.150 換算。
3. 全球高股利股票型之目標報酬率，為指定指標 MSCI 全球高股利指數(臺灣除外)之投資報酬率加 50 個基本點(0.50%)之淨年投資報酬率。

第 9 次國外委託經營（全球低波動股票型）

	第 9 次國外委託經營	
	104 年 6 月 1 日~ 106 年 4 月 30 日	
	以美元計算(元)	以新臺幣計算(元)
基金委託金額	250,000,000.00	(註 1) 7,717,750,000
委託資產淨值	284,279,298.35	(註 2) 8,571,020,845
總損益金額	34,279,298.35	853,270,845
投資報酬率	13.71%	11.06
同期間指定 指標報酬率	12.76%	—
106 年度報酬率	6.91%	—

附註：

1. 依 104 年 5 月 29 日央行收盤匯率 30.871 換算。
2. 以新臺幣計算之委託資產淨值係依 106 年 4 月底臺灣銀行外幣結帳價格表之新臺幣對美元匯率 30.150 換算。
3. 全球低波動股票型之目標報酬率，為指定指標 MSCI 全球低波動指數(臺灣除外)之淨年投資報酬率。

(7)第 10 次國外委託經營（全球基礎建設股票型）

	第 10 次國外委託經營	
	104 年 3 月 18 日~ 106 年 4 月 30 日	
	以美元計算(元)	以新臺幣計算(元)
基金委託金額	150,000,000.00	(註 1) 4,750,050,000
委託資產淨值	158,322,180.96	(註 2) 4,773,413,756
總損益金額	8,322,180.96	23,363,756
投資報酬率	5.55%	0.49%
同期間指定 指標報酬率	8.45%	—
106 年度報酬率	9.53%	—

附註：

1. 依 104 年 3 月 17 日央行收盤匯率 31.667 換算。
2. 以新臺幣計算之委託資產淨值係依 106 年 4 月底臺灣銀行外幣結帳價格表之新臺幣對美元匯率 30.150 換算。
3. 全球基礎建設股票型之目標報酬率，為指定指標道瓊 Brookfield 全球基礎建設指數之投資報酬率加 100 個基本點(1%)之淨年投資報酬率。

第 10 次國外委託經營（全球不動產股票型）

	第 10 次國外委託經營	
	104 年 6 月 1 日~ 106 年 4 月 30 日	
	以美元計算(元)	以新臺幣計算(元)
基金委託金額	150,000,000.00	(註 1) 4,630,650,000
委託資產淨值	157,234,328.22	(註 2) 4,740,614,996
總損益金額	7,234,328.22	109,964,996
投資報酬率	4.82%	2.37%
同期間指定 指標報酬率	5.13%	—
106 年度報酬率	4.11%	—

附註：

1. 依 104 年 5 月 29 日央行收盤匯率 30.871 換算。
2. 以新臺幣計算之委託資產淨值係依 106 年 4 月底臺灣銀行外幣結帳價格表之新臺幣對美元匯率 30.150 換算。
3. 全球不動產股票型之目標報酬率，為指定指標富時歐洲/北美不動產協會全球指數之投資報酬率加 100 個基本點(1%)之淨年投資報酬率。

退撫基金歷年收益情形

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(4月)(註2)	52.21	0.95	55.80	1.01	1.04

註1：89年度係一年半之會計期間。

註2：106(4月)之收益率係為106年度截至4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)。