

資訊報導

參加退撫基金人數

截至 106 年 5 月底止，參加基金之機關學校總數為 7,212 個，參加之總人數為 634,193 人，各身分別人數及比例：

身 分 別	人 數	比 例
公 務 人 員	289,948	45.72%
教 育 人 員	184,137	29.03%
軍 職 人 員	160,108	25.25%
合 計	634,193	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 5 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	4,794.9162	47.69%
教 育 人 員	3,715.6359	36.96%
軍 職 人 員	1,543.7873	15.35%
合 計	10,054.3394	100.00%

2、基金撥付

基金成立以來累計至 106 年 5 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	2,480.4155	51.73%
教 育 人 員	2,374.3830	63.90%
軍 職 人 員	1,479.2790	95.82%
合 計	6,334.0775	63.00%

106 年 5 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	19	80	0	1	18	118
教育人員	0	4	4	0	0	8
軍職人員	477	97	0	0	280	854
合計	496	181	4	1	298	980

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 5 月 31 日止)

單位：新臺幣萬元；%

項目別	金額	比例
一、臺幣存款	5,910,769	10.28
二、外幣存款	3,265,747	5.68
三、國內外上市(上櫃)公司股票	7,727,790	13.45
四、國內外短期票券及庫券	8,366,924	14.56
五、國內外債券	9,661,695	16.81
六、國內外開放型受益憑證	1,136,422	1.98
七、國內外委託經營	21,274,266	37.01
八、其他短期投資	-	-
九、應收款項	114,141	0.20
十、預付款項	18,494	0.03
十一、催收款項	282	-
合計	57,476,530	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 5 月 31 日	103 年 9 月 26 日~ 106 年 5 月 31 日	104 年 3 月 3 日~ 106 年 5 月 31 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	12,954,419,274	29,088,327,958	18,431,826,303
總損益金額	4,954,419,274	4,088,327,958	931,826,303
總損益比率	70.28	17.66	5.09
同 期 間 大 盤 報 酬 率	73.51	20.66	4.58
1 0 6 年 度 報 酬 率	6.99	7.11	4.74

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 5 月 31 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	520,859,709.41	(註 2) 15,677,877,253
總損益金額	139,803,618.89	4,306,401,400
投資報酬率	36.69%	37.87%
同 期 間 指 定 指 標 報 酬 率	31.53%	—
106 年度報酬率	10.98%	—

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 5 月底臺灣銀行外幣結帳價格表之新臺幣對美元匯率 30.100 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5月31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	307,608,430.73	(註2) 9,259,013,765
總損益金額	44,531,953.66	1,282,534,980
投資報酬率	16.93%	16.08%
同期間指定 指標報酬率	12.17%	—
106年度報酬率	16.70%	—

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5月底臺灣銀行外幣結帳價格表之新臺幣對美元匯率30.100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5月31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	538,369,192.39	(註2) 16,204,912,691
總損益金額	84,027,605.72	2,545,587,229
投資報酬率	18.49%	18.64%
同期間指定 指標報酬率	16.65%	—
106年度報酬率	10.94%	—

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5月底臺灣銀行外幣結帳價格表之新臺幣對美元匯率30.100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 5 月 31 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	1,154,923,785.07	(註 2) 34,763,205,931
總損益金額	504,923,785.07	15,871,705,931
投資報酬率	81.87%	89.09%
同 期 間 指 定 指 標 報 酬 率	70.54%	—
106 年度報酬率	10.70%	—

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 5 月底臺灣銀行外幣結帳價格表之新臺幣對美元匯率 30.100 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 5 月 31 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	254,907,979.81	(註 2) 7,672,730,192
總損益金額	54,907,979.81	1,882,230,192
投資報酬率	27.45%	32.51%
同 期 間 指 定 指 標 報 酬 率	9.64%	—
106 年度報酬率	20.32%	—

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 5 月底臺灣銀行外幣結帳價格表之新臺幣對美元匯率 30.100 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5月31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	383,238,130.43	(註2) 11,535,467,726
總損益金額	43,238,130.43	1,143,767,726
投資報酬率	17.65%	17.69%
同期間指定 指標報酬率	17.81%	—
106年度報酬率	4.55%	—

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5月底臺灣銀行外幣結帳價格表之新臺幣對美元匯率30.100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5月31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	608,778,759.63	(註2) 18,324,240,665
總損益金額	8,778,759.63	282,240,665
投資報酬率	1.46%	1.56
同期間指定 指標報酬率	8.88%	—
106年度報酬率	5.52%	—

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5月底臺灣銀行外幣結帳價格表之新臺幣對美元匯率30.100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 5 月 31 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	611,074,113.19	(註 2) 18,393,330,807
總損益金額	111,074,113.19	2,469,330,807
投資報酬率	18.11%	16.81%
同期間指定 指標報酬率	10.84%	—
106 年度報酬率	11.35%	—

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 5 月底臺灣銀行外幣結帳價格表之新臺幣對美元匯率 30.100 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 5 月 31 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	292,508,781.02	(註 2) 8,804,514,309
總損益金額	42,508,781.02	1,086,764,309
投資報酬率	17.00%	14.08
同期間指定 指標報酬率	16.00%	—
106 年度報酬率	10.01%	—

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 5 月底臺灣銀行外幣結帳價格表之新臺幣對美元匯率 30.100 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 5 月 31 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	162,704,433.89	(註 2) 4,897,403,460
總損益金額	12,704,433.89	147,353,460
投資報酬率	8.47%	3.10%
同期間指定 指標報酬率	11.46%	—
106 年度報酬率	12.57%	—

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 5 月底臺灣銀行外幣結帳價格表之新臺幣對美元匯率 30.100 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 5 月 31 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	159,925,198.56	(註 2) 4,813,748,477
總損益金額	9,925,198.56	183,098,477
投資報酬率	6.62%	3.95%
同期間指定 指標報酬率	6.52%	—
106 年度報酬率	5.90%	—

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 5 月底臺灣銀行外幣結帳價格表之新臺幣對美元匯率 30.100 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(5月)(註2)	67.24	1.22	107.80	1.95	1.04

註1：89年度係一年半之會計期間。

註2：106(5月)之收益率係為106年度截至5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)。