

公務人員退休撫卹基金簡訊

(106年3月刊登)

資訊報導

參加退撫基金人數

截至 106 年 1 月底止，參加基金之機關學校總數為 7,243 個，參加之總人數為 634,440 人，各身分別人數及比例：

身 分 別	人 數	比 例
公 務 人 員	289,397	45.61%
教 育 人 員	184,993	29.16%
軍 職 人 員	160,050	25.23%
合 計	634,440	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 1 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	4,702.5554	47.70%
教 育 人 員	3,643.5446	36.96%
軍 職 人 員	1,512.8949	15.34%
合 計	9,858.9949	100.00%

2、基金撥付

基金成立以來累計至 106 年 1 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	2,470.8300	52.54%
教 育 人 員	2,368.2289	65.00%
軍 職 人 員	1,468.1872	97.04%
合 計	6,307.2461	63.97%

106 年 1 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	43	740	0	0	9	792
教育人員	0	14	1	0	3	18
軍職人員	513	163	0	0	270	946
合計	556	917	1	0	282	1,756

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 1 月 31 日止)

單位：新臺幣萬元；%

項目別	金額	比例
一、臺幣存款	5,372,902	9.80
二、外幣存款	3,027,230	5.52
三、國內外上市(上櫃)公司股票	7,949,137	14.51
四、國內外短期票券及庫券	6,729,994	12.28
五、國內外債券	9,816,181	17.91
六、國內外開放型受益憑證	1,256,004	2.29
七、國內外委託經營	20,484,375	37.38
八、其他短期投資	-	-
九、應收款項	107,027	0.20
十、預付款項	55,448	0.10
十一、催收款項	-	-
合計	54,798,298	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 1 月 31 日	103 年 9 月 26 日~ 106 年 1 月 31 日	104 年 3 月 3 日~ 106 年 1 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	12,368,203,434	27,747,047,232	17,891,963,798
總損益金額	4,368,203,434	2,747,047,232	391,963,798
總損益比率	62.57	12.24	2.01
同 期 間 大 盤 報 酬 率	63.26	13.53	-1.60
1 0 6 年 度 報 酬 率	2.15	2.17	1.67

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 1 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	481,736,238.60	(註 2) 15,100,022,399
總損益金額	100,680,148.08	3,728,546,546
投資報酬率	26.42%	32.79%
同 期 間 指 定 指 標 報 酬 率	21.77%	—
106 年度報酬率	2.64%	—

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 1 月底臺灣銀行外幣結帳價格表之新臺幣對美元匯率 31.345 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1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	280,201,647.33	(註2) 8,782,920,636
總損益金額	17,125,170.26	806,441,851
投資報酬率	6.51%	10.11%
同期間指定 指標報酬率	0.89%	—
106年度報酬率	6.30%	—

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1月底臺灣銀行外幣結帳價格表之新臺幣對美元匯率31.345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1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	497,992,106.29	(註2) 15,609,562,572
總損益金額	43,650,519.62	1,950,237,110
投資報酬率	9.61%	14.28%
同期間指定 指標報酬率	7.99%	—
106年度報酬率	2.62%	—

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1月底臺灣銀行外幣結帳價格表之新臺幣對美元匯率31.345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1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	1,070,687,829.62	(註2) 33,560,710,019
總損益金額	420,687,829.62	14,669,210,019
投資報酬率	68.61%	82.54%
同期間指定 指標報酬率	57.87%	—
106年度報酬率	2.62%	—

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1月底臺灣銀行外幣結帳價格表之新臺幣對美元匯率31.345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1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	221,575,344.60	(註2) 6,945,279,176
總損益金額	21,575,344.60	1,154,879,176
投資報酬率	10.79%	19.94%
同期間指定 指標報酬率	-1.18%	—
106年度報酬率	4.59%	—

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1月底臺灣銀行外幣結帳價格表之新臺幣對美元匯率31.345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1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	368,947,142.51	(註2) 11,564,648,182
總損益金額	28,947,142.51	1,172,948,182
投資報酬率	13.27%	17.99%
同期間指定 指標報酬率	13.47%	—
106年度報酬率	0.65%	—

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1月底臺灣銀行外幣結帳價格表之新臺幣對美元匯率31.345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1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	585,782,485.80	(註2) 18,361,352,017
總損益金額	-14,217,514.20	319,352,017
投資報酬率	-2.37%	1.77%
同期間指定 指標報酬率	3.69%	—
106年度報酬率	1.53%	—

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1月底臺灣銀行外幣結帳價格表之新臺幣對美元匯率31.345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 1 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	558,750,490.28	(註 2) 17,514,034,118
總損益金額	58,750,490.28	1,590,034,118
投資報酬率	8.00%	11.22%
同期間指定 指標報酬率	2.96%	—
106 年度報酬率	1.81%	—

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 1 月底臺灣銀行外幣結帳價格表之新臺幣對美元匯率 31.345 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 1 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	270,417,006.97	(註 2) 8,476,221,083
總損益金額	20,417,006.97	758,471,083
投資報酬率	8.17%	9.83
同期間指定 指標報酬率	7.34%	—
106 年度報酬率	1.70%	—

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 1 月底臺灣銀行外幣結帳價格表之新臺幣對美元匯率 31.345 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 1 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	146,938,771.45	(註 2) 4,605,795,791
總損益金額	-3,061,228.55	-144,254,209
投資報酬率	-2.04%	-3.04%
同期間指定 指標報酬率	0.62%	—
106 年度報酬率	1.66%	—

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 1 月底臺灣銀行外幣結帳價格表之新臺幣對美元匯率 31.345 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 1 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	152,212,164.77	(註 2) 4,771,090,305
總損益金額	2,212,164.77	140,440,305
投資報酬率	1.47%	3.03%
同期間指定 指標報酬率	1.72%	—
106 年度報酬率	0.79%	—

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 1 月底臺灣銀行外幣結帳價格表之新臺幣對美元匯率 31.345 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 (%)	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 (億元)	加計未實現損 益及備供出售 金融資產投資 評價損益後之 收益率(%)	臺銀 2 年 期定期存 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(1月)(註 2)	13.23	0.24	12.72	0.23	1.04

註 1：89 年度係一年半之會計期間。

註 2：106(1月)之收益率係為 106 年度截至 1 月底之期間收益率。