**中華民國 114年**○**月**

* ○公司受託元智大學辦理全權委託投資(混合委託報酬類型)計畫建議書

目錄

Ａ、申請業者規模與實績經驗 （請註明頁次） A-1-1申請業者規模 （請註明頁次）

A-1-2職掌與分工 （請註明頁次）

A-2與本案類似之實績經驗 （請註明頁次）

A-3投資分析決策流程 （請註明頁次）

Ｂ、投資規劃建議(請以積極型至穩健型類型作規劃) （請註明頁次）

B-1資產配置與投資策略邏輯 （請註明頁次）

B-2預期績效模擬 （請註明頁次）

B-3投資建議調整機制 （請註明頁次）

Ｃ、風險控管 （請註明頁次）

C-1投資檢討週期 （請註明頁次）

C-2法律風險管理 （請註明頁次）

C-3投資停損、停利設計邏輯 （請註明頁次）

Ｄ、簡報及現場詢答 （請註明頁次）

D-1計劃對大學投資策略的作為 （請註明頁次）

D-2瞭解教育部的相關投資法規 （請註明頁次）

D-3預計對本案投入的資源 （請註明頁次）

Ｅ、價格之完整性及合理性 （請註明頁次）

E-1基本管理費 （請註明頁次）

E-2績效獎金 （請註明頁次）

1. 申請業者規模與實績經驗(資料提供以本委託案第一次公告日為基準日)
   1. **-1申請業者規模：**
      1. 經營全權委託投資規模

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 委託類型  （按產業類型分類） | 委託金額 | 委託類型占比（各項目類型之委託金額÷合計） | 家數 | 操作標的限制 | 委託全權委託投資期間 |
| 學校法人 |  |  |  |  |  |
| 一般法人 |  |  |  |  |  |
| 自然人 |  |  |  |  |  |
| 其他（可自行列舉） |  |  |  |  |  |
| 合計 |  |  |  |  |  |

* + 1. 公司淨值或實收資本額：請敘述
    2. 經營全權委託投資成立年資：請敘述
    3. 金融監督管理委員會處分記錄及受處分後之改善說明：請敘述

* 1. **-2職掌與分工**
     1. 公司現有及本案投資經理人員介紹

|  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 姓名 | 到職日 | 學經歷 | 擔任投資經理人年資 | 從事研究人員年資 | 受主管機關獎懲事項 | 受主管機關處分之改善說明 | 備註 |
|  |  |  |  |  |  |  | 本案投資經理人 |
|  |  |  |  |  |  |  |  |
| 總人數： |  |  | 平均年資： | 平均年資： |  |  |  |

* + 1. 公司現有及本案專任研究人員介紹

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 姓名 | 到職日 | 學經歷 | 在本公司擔任研究人員年資 | 從事研究人員年資 | 研究專長類型 | 受主管機關獎懲事項 | 受主管機關處分之改善說明 | 備註 |
|  |  |  |  |  | 例：電子類股 |  |  | 本案研究人員 |
|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| 總人數： |  |  | 平均年資： | 平均年資： |  |  |  |  |

* + 1. 公司最近 2 年投資研究團隊及全權委託部門人員異動情形、異動原因及人事穩定度分析

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 離職時間 | 部門 | 姓名 | 職稱 | 任職年資 | 離職原因 |
|  |  |  |  |  |  |
| 到職時間 | 部門 | 姓名 | 職稱 | 任職年資 | 前任服務機構名稱 |
|  |  |  |  |  |  |
| **人事穩定度分析：** | | | | | |

註：上述相關資料均以本委託案公告日為基準日，年資請計算至小數點第一位，小數點後第二位四捨五入；到職、離職請依部門及年度排序填寫。

### 與本案類似之實績經驗：

### 經營全權委託投資業務部分：請敘述與本案類似之實績經驗。請勿超過2頁。

### 經營全權委託投資績效

|  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 受託類型  **（按資產配置類型分類）** | 交付日 | 原始委託  金額 | 114 年4月  委託淨值 | 113年底  委託淨值 | 112 年底  委託淨值 | 111年底  委託淨值 | 委託淨值  變動率 |
| 例：Ａ公司，40：40 |  |  |  |  |  |  | ％ |
| 例：Ｂ公司，50：50 |  |  |  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  | ％ |
| 合計 |  |  |  |  |  |  |  |

### 投資分析決策流程

### 請敘述以往投資決策流程，包括所使用的技術平台與工具、數據分析與市場趨勢預測方法（請勿超過2頁）

1. 投資規劃建議(請以積極型至穩健型為主)

### 專案實施方式

### 請敘述規劃本委託案專案實施方式，其建議資產配置方式(需填寫下表)、投資策略邏輯（例如：量化分析、產業、區域、ESG等方式選股邏輯）與建議方式說明(請勿超過2頁)：

建議資產配置區間

| 資產類別 | 配置範圍（上下限） |
| --- | --- |
| 權益型資產 | % ～ % |
| 固定收益型資產 | % ～ % |
| 現金及定存部位 | % ～ % |

註：實際執行時加總須為100%，配置範圍（上下限）允許±5%彈性範圍。

### 預期績效模擬

### 預期投資環境與投資報酬率模擬，請以模擬±1σ、±2σ情境分析方式展現報酬分布及最大虧損預估（請勿超過2頁)：

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **情境類型** | **模擬年報酬率** | **說明** |
| +2σ 樂觀極限 | % | 平均 + %（2σ）極端風險情境 |
| +1σ 樂觀情境 | % | 平均 + %（1σ）正常波動情境 |
| σ 平均情境 | % | 預期平均值 基本績效能力 |
| –1σ 保守情境 | % | 平均– %（1σ） 正常波動情境 |
| –2σ 壓力測試 | % | 平均– %（2σ） 極端風險情境 |

### 年報酬率標準差(σ)：\_\_\_\_ %

### 投資建議調整機制

### 請具體敘述當市場變動或投資標的表現異常時，如何調整投資策略。(請勿超過2頁)

1. 風險控管

### 投資檢討週期

請敘述執行本基金操作，擬定投資決策報告、投資成效報告、資產配置報告、檢討、溝通週期及頻率。

(請勿超過2頁)

### 法律風險管理

* + 1. 請敘述如何管理本案公開徵求受託機構申請說明書第壹條法規範圍所列的投資比率限制、第伍條第6款投資限制。(請勿超過2頁)
    2. 金融監督管理委員會處分記錄及受處分後之改善說明：請說明。

### 請敘述執行本案的投資停損、停利設計邏輯(請勿超過2頁)

1. 簡報及現場回答

請申請業者依計畫建議書內容製成20分鐘以內之簡報以利說明報告，簡報完成後會有20分鐘的詢答。

1. 價格之完整性及合理性:

### 基本管理費:請提出基本管理費計算公式。此項收費為固定費率，但若未優於比較指標報酬率將減少費率成數，惟不扣減至零。

**依照委託淨資產價值，每月依固定年百分之---之費率按日計算，於每月初給付上月委託報酬。**

**基本管理費採按月預付方式計算並支付；年度期滿評核後，應依實際應計金額進行年度結算，如預付金額超出應計數，則超額部分應優先退還予委託人**

* + 1. 基本管理費收費公式：
    2. 未優於比較指標報酬率：基本管理費率－　　％
* 評核指標：(權益資產占比× 同期間臺灣50報酬指數之區間報酬率)+(固定收益型占比×同期間債券市場指數之區間報酬率)

### 績效獎金：請提出績效獎金計算公式，此項獎金為相對報酬收費類型，所提出的績效報酬率需優於比較指標報酬率，且為正報酬，達成時方有績效獎金。

### 依照委託淨資產價值，依年利率百分之---之費率計算。

請列示績效獎金計算公式：

* 評核指標: (權益資產占比× 同期間臺灣50報酬指數之區間報酬率)+(固定收益型占比×同期間債券市場指數之區間報酬率)

「臺灣50報酬指數」係由臺灣證券交易所與富時國際有限公司共同合作編製，並於臺灣證券交易所指數資訊網頁公告。

「債券市場指數報酬率」以證券櫃檯買賣中心編製之台灣公債總報酬指數（OTC Bond Total Return Index債券總報酬指數），或其他雙方約定指數為代表。

評核指標所稱占比，係按計畫建議書B-1資產配置方式約定區間之平均數為占比，若有另行約定比率依其比率計算。

資產配置比例應向本校核備，本校保留資產配置異常偏離約定範圍進行調查與績效獎金調整之權利。

實際報酬之認定，係指委託帳戶於考核期間之總投資報酬率，包含已實現與未實現損益，並扣除相關費用後之淨報酬。

所稱「指標評核同期間之區間報酬率」，係自首次撥款日起算，並以「每一年」為區間單位進行計算。

績效獎金發放條件：評核期間之實際報酬率優於比較指標報酬率且為正報酬

元智大學辦理全權委託投資(混合委託報酬類型)計畫建議書

提 具 人： 公司(請加蓋公司印鑑)

代 表 人： (簽章)

地 址：

聯絡電話：

附註：

經營計畫建議書製作應注意事項

(一)請申請業者依本計畫建議書內容、格式製作經營計畫建議書，正本 1 份，副本 12 份(正本不裝訂)，合計 13 份，本文及附件不得超過50頁，每一份包含正文及附件。請於封面左上角標示正本及副本字樣，內頁毋須再標示正本或副本字樣。

(二)以 A4 紙張、橫式橫書繕打、雙面印刷並加裝封面橫式裝訂於上方成冊。

(三)本計畫建議書於收件截止日後，計畫建議書提具人不得要求增、修。