|  |
| --- |
| 附件八 |

**中華民國112年8月**

|  |
| --- |
| ○○公司受託經營新制勞工退休基金及國民年金保險基金112年度第1次  國內投資（相對報酬類型）委託經營業務經營計畫建議書（大綱） |

○○公司受託經營新制勞工退休基金及國民年金保險基金112年度第1次

國內投資（相對報酬類型）委託經營業務經營計畫建議書（大綱）目錄

1. 受託機構概況（佔審查評分10％）

一、組織概況及人員資料　　　　　　　　　　　　　二、最近3年公司高階主管異動情形

三、財務概況與基金管理規模　　　　　　　　　　　四、資訊系統能力 五、最近5年受主管機關糾正以上之懲處事項 六、公司治理

1. 受託機構以往營運績效（佔審查評分10％）

一、操作國內股票型基金經營績效 二、受託經營國內法人機構委託經營績效

1. 擬任投資經理人陣容及投資研究團隊（佔審查評分30％）

一、投資經理人學、經歷 　　　　　　　　　　二、投資經理人以往操作績效

三、投資研究人員及經理人薪酬架構與獎金依據 四、投資研究團隊介紹　　　　　　　　　　　　　　五、公司提供之投資研究資源 六、投資研究團隊成員異動情形

肆、 經營理念與投資策略（佔審查評分35％）

一、投資理念、政策與投資原則　　　　　　　　　　二、ESG投資落實情形

三、投資決策流程、運作方式及研究平台分享 四、投組建構模型介紹及操作流程

五、期貨操作策略及其他投資避險策略 六、預期報酬及累計追蹤誤差值之分析說明

七、交易運作及績效評估檢討 八、閒置資金(固定收益)之管理

伍、 風險管理機制（佔審查評分15％）

一、風險之衡量及風險管理指標 二、內部風險控管制度

三、內部稽核制度　　　　　　　　　　　　　　　　四、績效分析檢討制度

五、下檔風險及績效波動度之控管機制 六、風險管理單位配置人員情形　　　　　　　　　　七、過去重大事件發生時，經理人及公司因應措施及結果

陸、 補充說明事項（所涉各項目併同前述相關項目評審）

1. 受託機構概況：
2. 組織概況及人員資料

(一)組織架構圖

(二)部門職掌

(三)各部門主管資料

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 職稱 | 姓名 | 就任日期 | 到職日期 | 主要學、經歷 | 目前兼任其他職務情形 | 備註 |
|  |  |  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |

(四)各部門員工資料

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 部門別 | 員工  人數 | 學 歷 | | | | 服 務 年 資 | | | | 平均年資 |
| 高中 | 大學 | 碩士 | 博士 | 未滿1年 | 滿1年  未滿3年 | 滿3年  未滿5年 | 5年以上 |
|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| 總計 |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |

二、最近3年公司高階主管(董事長、總經理、投資長及全權委託部門主管)異動情形

三、財務概況與基金管理規模：

(一)民國109年、110年及111年之會計師查核報告、資產負債報告書、損益表及股東權益變動表等。

(二)民國109年、110年及111年之全權委託資產管理業務收入及其佔受託機構總收入的比例、全權委託資產管理業務利潤及其佔受託機構總利潤的比例。

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| 年度 | 109年 | 110年 | 111年 |
| 全權委託資產管理業務之收入 |  |  |  |
| 受託機構之年度總收入 |  |  |  |
| 全委業務收入佔受託機構總收入之比例（%） |  |  |  |
| 全權委託資產管理業務之利潤 |  |  |  |
| 受託機構之年度總利潤 |  |  |  |
| 受託機構之稅後每股盈餘(稅後EPS) |  |  |  |
| 全委業務利潤佔受託機構總利潤之比例（%） |  |  |  |

(三)國內股票型基金及政府基金委託經營規模資料：

1. 最近3年平均國內股票型基金管理規模 億元，其中指數型、指數股票型或計量類型之股票型基金管理規模 億元。
2. 最近3年平均政府基金委託經營規模 億元，其中相對報酬類型/計量類型之委託經營規模

億元。

註：最近3年平均規模係以民國112年8月31日為基準，往前推算3年期間，按每個月底的基金規模加總平均計算。

1. 管理規模明細表

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 金額　　　　 　　　　日期 | | 109.12.31 | 110.6.30 | 110.12.31 | 111.6.30 | 111.12.31 | 112.6.30 | 112.8.31 |
| 國內股票型基金規模 | 指數型、指數股票型或計量類型 |  |  |  |  |  |  |  |
| 其他非計量類型之股票型基金 |  |  |  |  |  |  |  |
| 合計 |  |  |  |  |  |  |  |
| 政府基金委託經營規模 | 相對報酬類型/計量類型 |  |  |  |  |  |  |  |
| 絕對報酬類型 |  |  |  |  |  |  |  |
| 合計 |  |  |  |  |  |  |  |

1. 目前國內股票型基金管理規模:

（1）10億元以上未滿20億元，共 檔。

（2）20億元以上未滿30億元，共 檔。

（3）30億元以上共\_\_\_\_\_\_檔。

1. 最近2年內於契約期間代操政府基金被收回全部或部分委託投資帳戶，共＿＿ 個。

|  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 標案名稱 | 原始委託  規模 | 契約起訖  日期 | 全部或部分收回 | 收回日期 | 經理人姓名 | 累積投資報酬率 | 同期間大盤報酬率 |
|  |  |  |  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |  |

四、資訊系統能力

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 資訊系統類型 | 系統名稱  **(請註明外購或自行開發)** | 使用年限  （自 / / ~ / / ） | 負責人員  數目 | 系統簡介 | 具體成效（請列舉過去實際發生實例） |
| 會計帳務 |  |  |  |  |  |
| 投資輔助 |  |  |  |  |  |
| 風險控管 |  |  |  |  |  |
| 績效分析 |  |  |  |  |  |

五、最近5年受主管機關糾正以上之懲處事項（含擬任主協管投資經理人）

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 處分日期 | 主管機關處分項目 | 處分內容 | 原因說明 | 後續改善情形說明 |
|  |  |  |  |  |

註：最近5年係以民國112年8月31日為基準，往前推算5年期間。自112年9月1日起至本次計畫審查期間內，如有發生受主管機關糾正以上處分，應一併揭露（如於投遞前發生，請於此欄位揭露；如於投遞後計畫審查前發生，請於計畫審查時揭露）。

六、公司治理

1. 關係人揭露：經營機構之董事、監察人(包括法人董事、監察人之代表)、經理人(包括副總經理及相當等級以上者、投資部門主管)、持股比例百分之5以上股東、其他決定基金運用之人員，擔任股票上市(上櫃)公司及證券商之董事、監察人(包括法人董事、監察人之代表人)、經理人或持股比例百分之5以上股東者，應揭露該經營機構之董事、監察人、經理人、股東或其他人員之名稱及職稱及擔任股票上市(上櫃)公司及證券商之職務。
2. 董事會組成及股東結構。
3. 董事會與總經理及基金經理人間指揮監督權之運作(防火牆運作)、如何確保受益憑證受益人及代客操作客戶之權益。
4. 「機構投資人盡職治理守則」簽署情形。
5. 董監事責任險投保情形。
6. 企業社會責任執行情形(非投資面)。
7. 受託機構以往營運績效：

一、操作國內股票型基金經營績效

(一)操作國內指數型、指數股票型或計量類型之股票型基金經營績效

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 國內指數型、指數股票型或  計量類型之股票型基金 | | | | | 最近6個月及1、2、3  及5年基金報酬率 | | | 最近1、2、3及5年風險量化 | | | | 最近1年買進  及賣出週轉率 |
| 基金  名稱 | 基金  類型 | 成立  日期 | 原始募集金額  (新台幣  億元) | 目前  規模  (新台幣  億元) | 累計  投資  報酬率 | 同期間  大盤及指標報酬率  (大盤/指標) | 排名比  (國內排名及類型排名) | 年化  標準差 | β係數 | 資訊比率(Information Ratio) | 年化追蹤誤差(Tracking Error) |
|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |

(二)操作國內其他非計量類型之股票型基金經營績效

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 國內其他非計量類型  之股票型基金 | | | | | 最近6個月及1、2、3  及5年基金報酬率 | | | 最近1、2、3及5年風險量化 | | | | 最近1年買進  及賣出週轉率 |
| 基金  名稱 | 基金  類型 | 成立  日期 | 原始募集金額  (新台幣  億元) | 目前  規模  (新台幣  億元) | 累計  投資  報酬率 | 同期間  大盤報酬率 | 排名比  (國內排名及類型排名) | 年化  標準差 | β係數 | 資訊比率(Information Ratio) | 年化追蹤誤差(Tracking Error) |
|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |

二、受託經營國內法人機構委託經營績效

(一)受託經營國內法人機構相對報酬類型/計量類型委託經營績效

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 受託經營國內法人機構相對報酬類型/計量類型委託經營業務 | | | | | | | | | 最近1年買進及賣出週轉率 | 最近1、2年風險量化 | |
| 委託人名稱 | 委託規模  (新台幣  億元) | 目前淨值  (新台幣  億元) | 契約起訖日期 | 操作性質及投資限制 | 經理人姓名 | 累計投資報酬率 | 排名比 | 同期間大盤及指標報酬率  (大盤/指標) | 年化  追蹤誤差(Tracking Error) | β係數 |
|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |

(二)受託經營國內法人機構絕對報酬類型委託經營績效

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 受託經營國內法人機構絕對報酬類型委託經營業務 | | | | | | | | | 最近  1年  買進及賣出週轉率 | 最近1、2年風險量化 | |
| 委託人名稱 | 委託規模  (新台幣  億元) | 目前淨值  (新台幣  億元) | 契約起訖日期 | 操作性質及投資限制 | 經理人姓名 | 累計投資報酬率 | 排名比 | 同期間大盤報酬率 | 年化  標準差 | β係數 |
|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |

註：1.委託經營業務應包括經委任人提前終止契約者，政府基金以外之法人機構委託人得以英文代號表示。

2.累計投資報酬率係以民國112年8月31日為基準，往前推算一定期間之報酬率。排名比應列出所有排名之總數及該基金之排名數（列示為：排名/評比基金總支數）。共同基金報酬率及排名比依中華民國證券投資信託暨顧問商業同業公會委託邱顯比、李存修教授之「基金績效評比表」為準，排名比區分為投資國內排名比及類型排名比（如科技類、中小型等）。委託經營之排名比以同一委託人於同期間委託各代操機構之各期間累計報酬排名為基準，已到期帳戶列示到期前最後一個月底排名比。

3.風險量化之計算期間，以民國112年8月31日為基準，往前推算一定期間；年化標準差、β係數、資訊比率之計算方法以上開「基金績效評比表」所列計算公式為準，其中資訊比率依評比表之大分類列示；追蹤誤差(Tracking Error)之定義及公式如下：

(1)追蹤差距(Tracking Differenc，TD)為衡量基金相對於參考指數表現之差異。其中，為第t期之基金報酬率()與參考指數報酬率()之差距，n為投資期數：

(2)追蹤誤差(Tracking Error，TE)為每日追蹤差距之年化標準差。

\*

以上風險量化指標，受託經營期間未滿一年者得免填。

4.基金類型依上開「基金績效評比表」之分類，區分投資國內股票之類型（如科技類、中小型、指數股票型等）。

5.同期間大盤報酬率係指依據臺灣證券集中交易市場股價加權指數計算之投資報酬率，同期間指標報酬率係指該指數型、指數股票型或計量類型基金所追蹤指標之報酬率；代操法人機構相對/計量委託之指標報酬率則依約定之指標。

1. 擬任投資經理人陣容及投資研究團隊（公司自有之投資業務部門研究團隊）：

\*說明：

1.請說明擬任投資經理人與投資研究團隊之合作模式。

2.本 (新制勞工退休基金及國民年金保險基金112年度第1次國內投資）委託經營業務採團隊經理人制，擬任投資經理人(主協管投資經理人應至少指派一人)及投資研究團隊，限整合為相同投研團隊。

一、投資經理人學、經歷

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 職稱 | 照片 | 姓名 | 到職日期 | 學歷、經歷、專業證照 | 個人投資優勢 | 本委託案擬負責之權責項目或產業 | 專長研究  產業 | 獎懲記錄 | 委託契約遭中止、加碼、續約事項 | 近5年辦理投資業務遭主管機關警告以上處分 |
| 擬任主管投資經理人 |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| 擬任協管投資經理人A |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| 擬任協管投資經理人B |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| .  .  . |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| 儲備投資經理人甲 |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| 儲備投資經理人乙 |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| .  .  . |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |

註：1.學歷請載明科系所名稱，年資計算請以年為單位，經歷請載明起訖期間(格式:109/05~112/08)，並由近至遠分列。

　　　　　2.投資經理人於本委託案擬負責之權責項目，係指如：TE控管、計量模型操作、總經研判、資產配置、主動式選股等；並就所負責之權責項目或產業，負有委託資產之投資決定、檢討及其他相關義務。

3.上表列示之「本委託案擬負責之權責項目或產業」欄位，如填載負責之項目為主動式選股，或填載負責之產業，則請再依臺灣證券交易所之33分類類股為主分類，如有細項負責產業可就前述33類再列示為細分類（如光電業再區分為面板、LED等）。

4.擬任主協管投資經理人(含儲備經理人)如為共同基金經理人兼任者，請說明兼任情形，並另列示說明所經理基金是否符合證券投資信託事業證券投資顧問事業經營全權委託投資業務管理辦法第8條第5項規定；RFP團隊經理人如屬共同基金部門者，應於附註說明「如蒙獲選，但尚未獲得金管會核准兼任者，將會改為專任全權委託部門業務」。

5.最近5年係以民國112年8月31日為基準，往前推算5年期間。

二、投資經理人以往操作績效（含擬任主協管投資經理人及儲備投資經理人之績效）

（一）「經理人」所操作之全部股票型共同基金之績效：**(不同經理人請分別以不同表格列示)**

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 投資類型(相對/絕對) | 基金  類型 | 基金  名稱 | 實際操作起訖日期 | 基金規模 | 最近6個月及1、2、3、5年基金報酬率 | | | 最近1、2、3及5年風險量化 | | | | | | 最近  1年  買進及賣出週轉率 |
| 累計投資報酬率 | 排名比  (國內排名及類型排名) | 同期間大盤及指標報酬率  (大盤/指標) | β係數 | 年化  標準差 | Sharpe | Jensen | Treynor | 資訊比率(Informa-tion Ratio) |
|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |

註：1.投資報酬率及排名比之計算及列示與第貳點註2相同。風險量化之計算與第貳點註3相同。基金類型之列示與第貳點註4相同。同期間大盤報酬率之計算與第貳點註5相同。

2.評估期間係以民國112年8月31日為基準往前推算。基金經理人所管理之共同基金，1年以上未滿2年以採計其最後一年之1年績效計算，其餘期間類推計算。

3.基金經理人投資績效，應檢附相關計算、證明文件；擬任投資經理人應對所操作的基金投資績效、操作策略及理念做簡要說明。

4.基金規模係指經理人實際操作期間每月底平均基金規模。

(二)「經理人」管理國內法人機構委託經營帳戶之績效：**(不同經理人請分別以不同表格列示)**

| 委託人名稱 | 投資類型(相對/  絕對) | 原始  委託  規模 | 契約起訖日期 | 操作性質及投資限制 | 實際操作起訖日期 | 累計投資報酬率 | 排名比 | 同期間大盤及指標報酬率(大盤/指標) | 風險量化 | | 最近  1年  買進及賣出週轉率 |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 標準差 | β係數 |
|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |

合計目前管理國內法人機構資產總規模 ，帳戶數 。

註：1.政府基金以外之法人機構委託人名稱得以英文代號表示。

2.排名比請以政府基金於同期間委託各代操機構之各期間累計報酬排名為基準，已到期帳戶列示到期前最近一個月底排名，其他法人機構之委託經營得免填。

3.同期間大盤及指標報酬率之計算，絕對報酬依大盤計算、相對報酬則列示依大盤及約定之指標所計算之報酬率。

4.風險量化之計算與第貳點註3相同。

（三）「經理人」管理私募基金之績效：**(不同經理人請分別以不同表格列示)**

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 基金  名稱 | 投資類型(相對/  絕對) | 資產  規模 | 實際操作起訖日期 | 操作  性質 | 累計投資  報酬率 | 同期間大盤及指標報酬率  (大盤/指標) | 風險量化 | | 最近1年買進及賣出週轉率 |
| 標準差 | β係數 |
|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |

合計目前管理私募基金資產總規模 ，帳戶數 。

註：資產規模係指實際操作期間每月底平均資產規模。

三、公司投資研究人員及經理人之薪酬架構與獎金依據

**(投資研究人員、共同基金經理人及全權委託經理人等3類人員，請分別以不同表格列示，如共同基金經理人兼任全權委託經理人而另有不同分類方式，請另行說明)**

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| 薪資架構 | 基本薪資 | 獎金 | 其他（例如:紅利等） |
| 發放依據 |  |  |  |
| 計算方式 |  |  |  |
| 佔總薪酬百分比 |  |  |  |

註：1.佔總薪酬百分比，請以111年度薪酬資料計算。

2.百分比計算方式：

例：共同基金經理人基本薪資百分比＝公司所屬所有共同基金經理人年度所領薪資中屬基本薪資部分/公司所屬所有共同基金經理人年度所領薪資總額，餘類推。

四、投資研究團隊介紹

（一）公司現任投資長 (Chief Investment Officer)介紹（無CIO者免填）

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 姓名 | 到職日 | 學歷 | 在本公司  年資 | 擔任CIO  年資 | 擔任經理人年資 | 從事研究人員年資 | 專長、負責研究項目 | 經歷  （含最近3年得獎紀錄） | 受主管機關懲處事項 |
|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |

註：學歷欄請載明科系所名稱，年資計算請以年為單位，經歷欄請載明起訖年資(格式:109/01~112/08)。

（二）公司所有現任基金經理人員介紹(不包括四、(一)現任投資長)

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 姓名 | 到職日 | 學歷 | 在本公司年資 | 擔任經理人年資 | 從事研究人員年資 | 專長、負責研究項目 | 經歷  （含最近3年得獎紀錄） | 受主管機關懲處事項 |
|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| 總人數： |  |  | 平均年資： | 平均年資： | 平均年資： |  |  |  |

註：學歷欄請載明科系所名稱，年資計算請以年為單位，經歷欄請載明起訖年資(格式:109/01~112/08)。

（三）公司現有專任研究人員介紹(不包括四、(一)現任投資長及四、(二)現任基金經理人)

|  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 姓名 | 到職日 | 學　 歷 | 在公司擔任研究人員年資 | 從事研究人員年資 | 專長、負責研究項目 | 經歷  （含最近3年得獎紀錄） | 受主管機關懲處事項 |
|  |  |  |  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |  |
| 總人數： |  | 具碩士以上學歷之百分比： | 平均年資： | 平均年資： |  |  |  |

註：學歷欄請載明科系所名稱，年資計算請以年為單位，經歷欄請載明起訖年資(格式:109/01~112/08)。

1. 公司提供之投資研究資源

六、投資研究團隊成員異動情形

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 年度 | 部門 | 離職人數 | 到職人數 | 部門總人數 |
| 108年 | 投資研究 |  |  |  |
| 稽核 |  |  |  |
| 109年 | 投資研究 |  |  |  |
| 稽核 |  |  |  |
| 110年 | 投資研究 |  |  |  |
| 稽核 |  |  |  |
| 111年 | 投資研究 |  |  |  |
| 稽核 |  |  |  |
| 截至112年8月 | 投資研究 |  |  |  |
| 稽核 |  |  |  |

1. 經營理念與投資策略：

**※請說明公司是否對於得投資標的，先經由團隊會議對整體經濟情勢判斷、產業分析、資產配置、可投資標的篩選等作成決策，並訂定相關投資限制及投資政策後，基金經理人再依各基金之投資策略及方針進行基金投資管理與選股操作。**

1. 投資理念、政策與投資原則(請就公司整體方向簡單說明，勿與以下內容重複)
2. ESG投資落實情形

說明：

1.ESG分析團隊：請說明貴公司有無設置ESG投資團隊，若有，請說明該團隊成員及工作項目。

2.將社會投資理念(SRI)納入選股考量(不限於本委託經營業務)：請說明貴公司目前經管基金(帳戶)如何評估個股之環境、社會及公司治理(ESG)，有無消極負面或積極正面篩選之選股機制?另在109~112年間，有關ESG投資分析過程有何強化機制或改善措施？

1. 投資決策流程、運作方式（包括投資分析、決定、執行及檢討之流程圖說明）及研究平台分享（含實際說明並呈現系統畫面搭配敘述）

說明：

1.請說明如何控管投資標的，以確認投資標的於前一年度至當年度前月底止，曾在公開資訊觀測站公告永續報告書。

2.研究平台係指可供查詢個股彙整資訊之系統平台，請說明該平台所彙整的資訊來源項目，如：公司內部研究報告、外部券商報告等。

1. 投組建構模型介紹及操作流程

說明：

1.是否曾有指數型或指數增值型投資操作經驗(含全權委託、指數股票型基金及共同基金)；若有，請說明歷史績效、該投資團隊組成時間、該團隊關鍵人物及其參與團隊時間。

2.介紹投資組合建構模型之選股邏輯及風險控管(若有模擬回測資料，請一併提供) 。

3.說明複製指數之調配機制如何運用及調整頻率。若非採完全複製法，請說明主動選股操作流程，以及如何將社會投資理念(SRI)納入選股考量。

4.若委託金額持續增加，投資操作可能面臨那些問題？將如何因應？

5.撥款或調倉時，如何控管個股流動性問題，以避免市場衝擊？

1. 期貨操作原則、其他投資避險策略、過去一年操作績效實例（請舉出代操國內四大基金過去一年操作實例之策略及績效，若無代操國內四大基金，則舉共同基金為例）
2. 預期報酬及累計追蹤誤差值(tracking error)之分析說明

說明：

1.說明如何控制及監督累計追蹤誤差值？

2.需提出短、中、長期報酬率與累計追蹤誤差值來源推估之預期及動態分析。

1. 交易運作及績效評估檢討（含各經理人與核心持股相關連結之績效評核，以及包括對研究人員、交易人員之績效考核、往來券商之遴選及交易控管方式）
2. 閒置資金(固定收益)之管理
3. 風險管理機制：
4. 風險之衡量及風險管理指標（包括但不限投信投顧公會所列之項目）
5. 內部風險控管制度（請具體載明貴公司控管之執行方式，包括列印控管畫面）

（一）市場風險（價格風險）

1.非以避險為目的之衍生性金融商品之損失檢討機制。

2.分析市場風險應包括總經相關指標，如利率及油價等因素。

（二）信用風險

（三）流動風險

（四）作業風險(含買賣交易、交割作業程序及反向交易控管機制)

（五）法律風險

1. 內部稽核制度(擬任經理人中如為共同基金經理人兼任者，請說明內部控制制度中防範利益衝突之作業原則；如有獨立董事或監察人等其他監督制度，請另行說明）
2. 績效分析檢討制度（含定期評估績效時間及經理人績效不佳之處理方式）
3. 下檔風險及績效波動度之控管機制（含個股損失檢討機制）
4. 風險管理單位配置人員情形(含員額、學歷、經歷、具備相關專業證照情形)
5. 過去重大事件發生時，經理人及公司因應措施及結果（請列舉實際案例）
6. 補充說明事項：
7. 請說明貴公司如何落實投信從業人員行為紀律之管理並強化公司內部控制機制？
8. 請具體說明貴公司如何降低相關從業人員之道德風險？
9. 請具體說明貴公司如何落實四大投資流程(投資分析、決定、執行及檢討機制)？
10. 請具體說明貴公司相較於其他投信之競爭優勢為何？
11. 請指出貴公司如何能夠吸收新業務，並同時確保現有客戶的利益不受影響。
12. 請說明貴公司針對建置優良工作環境，進而達到人才培育，避免流動率過高，建立優良投信文化，有何具體作法；另，有無(不)定期為員工加薪、有無依照[身心障礙者權益保障法](http://law.moj.gov.tw/LawClass/LawContent.aspx?PCODE=D0050046)第38條規定足額進用身心障礙者員工，以及對於保留勞退舊制年資之員工，按月提撥勞工退休準備金情形。

註：以上每一點說明限150字以內

1. 請具體說明貴公司撰擬本委託經營業務經營計畫建議書之分工？

本經營計畫建議書內容如有虛偽不實，而因此取得新制勞工退休基金及國民年金保險基金經營之委託時，勞動基金運用局得終止委託契約或為其他必要之處置。

經營計畫建議書提具人： 證券投資信託股份有限公司(請加蓋公司印鑑)

負 責 人： 　　 (簽章)

地 址：

聯絡電話：

附註：

一、提具經營計畫建議書參選者，應檢附相關機構或同業公會所出具合於申請須知規定參選資格條件之證明文件。

二、經營計畫建議書製作應注意事項：

（一）本文以不超過80頁為限，附件以不超過50頁為限，並加註頁碼。

（二）以A4紙張橫向橫式繕打，加裝封面（平裝）橫式裝訂於上方（敬請使用再生紙，並以雙面印刷）。

（三）正本1份，副本19份，並附1份電子光碟片，請於封面左上角標示正本或副本字樣，並於書背標明○○投信新制勞退基金及國保基金112-1國內委託經營計畫建議書，裝入適當之紙箱並以書面密封。

（四）本計畫建議書於交付後，計畫建議書提具人不得要求增修訂。