

附表三、預估原私校退撫基金每月報酬率及淨收益

單位：新臺幣元

| 年度 | 月份 | 當月基金淨流入 | 基金本期間可運用資金餘額 | 每月可運用資金平均額 | 預估每月報酬率及淨收益 | | | | | | 月報酬率(C) | 總淨收益(D) |
|------|-----|----------------|---------------|---------------|---------------|----------|-----------|---------------|----------|-----------|---------|-------------|
| | | | | | 穩健型 | | | 保守型 | | | | |
| | | | | | 預估累計投資總額 | 預估報酬率(A) | 參考配置比率(a) | 預估累計投資總額 | 預估報酬率(B) | 參考配置比率(b) | | |
| 104年 | 期初 | | 3,136,751,600 | | | | | | | | | |
| | 1月 | 1,590,551,964 | 4,727,303,564 | 3,932,027,582 | 1,575,610,278 | 0.54% | 33.33% | 3,151,693,286 | 0.31% | 66.67% | 0.39% | 15,334,908 |
| | 2月 | -1,046,481,347 | 3,680,822,217 | 4,204,062,891 | 1,840,411,109 | 0.54% | 50.00% | 1,840,411,109 | 0.31% | 50.00% | 0.43% | 18,077,470 |
| | 3月 | -68,639,595 | 3,612,182,622 | 3,646,502,420 | 1,806,091,311 | 0.54% | 50.00% | 1,806,091,311 | 0.31% | 50.00% | 0.43% | 15,679,960 |
| | 4月 | -35,906,720 | 3,576,275,902 | 3,594,229,262 | 1,788,137,951 | 0.54% | 50.00% | 1,788,137,951 | 0.31% | 50.00% | 0.43% | 15,455,186 |
| | 5月 | 2,479,301,332 | 6,055,577,234 | 4,815,926,568 | 2,523,359,033 | 0.54% | 41.67% | 3,532,218,201 | 0.31% | 58.33% | 0.41% | 19,745,299 |
| | 6月 | -13,758,129 | 6,041,819,105 | 6,048,698,170 | 2,517,626,021 | 0.54% | 41.67% | 3,524,193,084 | 0.31% | 58.33% | 0.41% | 24,799,662 |
| | 7月 | -19,242,390 | 6,022,576,715 | 6,032,197,910 | 1,003,963,538 | 0.54% | 16.67% | 5,018,613,177 | 0.31% | 83.33% | 0.35% | 21,112,693 |
| | 8月 | -2,387,594,709 | 3,634,982,006 | 4,828,779,361 | 908,745,502 | 0.54% | 25.00% | 2,726,236,505 | 0.31% | 75.00% | 0.37% | 17,866,484 |
| | 9月 | -125,691,518 | 3,509,290,488 | 3,572,136,247 | 877,322,622 | 0.54% | 25.00% | 2,631,967,866 | 0.31% | 75.00% | 0.37% | 13,216,904 |
| | 10月 | -100,692,150 | 3,408,598,338 | 3,458,944,413 | 852,149,585 | 0.54% | 25.00% | 2,556,448,754 | 0.31% | 75.00% | 0.37% | 12,798,094 |
| | 11月 | 362,379,798 | 3,770,978,136 | 3,589,788,237 | 942,744,534 | 0.54% | 25.00% | 2,828,233,602 | 0.31% | 75.00% | 0.37% | 13,282,216 |
| | 12月 | -37,132,056 | 3,733,846,080 | 3,752,412,108 | 933,461,520 | 0.54% | 25.00% | 2,800,384,560 | 0.31% | 75.00% | 0.37% | 13,883,925 |
| | 全年 | 597,094,480 | | 4,289,642,097 | | | | | | | 4.6916% | 201,252,802 |

備註：1. 基金本期間可運用資金餘額=104年度初可運用資金規模+【1月至Z月當月基金淨流入(出)，Z≤12】。

2. 每月可運用資金平均額：每月基金本期間可運用資金餘額+前一月份基金本期間可運用資金餘額之平均值。

3. 預估報酬率(A)：穩健型回溯測試年化收益率6.53%除以12估算；預估報酬率(B)：保守型回溯測試年化收益率3.77除以12估算。

4. 參考配置比率(a)：投資於穩健型之投資總額占基金本期間可運用資金餘額之百分比；參考配置比率(b)：投資於保守型之投資總額占基金本期間可運用資金餘額之百分比。

5. 月報酬率(C)：參考配置比率乘以穩健型及保守型之預估報酬率加權平均計算。

6. 年度目標收益率為4.6916%，係以年度總淨收益除以每月可運用資金平均額之全年平均數。

附表五、104 年度原私校退撫基金運用投資組合規劃表

| 項目區分 | 中心配置比率(%) | 允許變動區間比率(%) | 運用項目 | 中心配置比率(%) | 允許變動區間比率(%) |
|--------|-----------|-------------|------------|-----------|-------------|
| 共同基金 | 73 | 47 ~ 90 | 資本利得型 | 30 | 15~40 |
| | | | 債券型 | 43 | 32~50 |
| 存款及類存款 | 27 | 10 ~ 53 | 存款及貨幣市場型基金 | 27 | 10~53 |

備註：1. 各類型資產配置之中心配置比率，係以原私校退撫基金預計每月各項資產配置比重表所推估每月各項資產配置比重中最高及最低配置比率之平均值估算。

2. 資本利得型基金及債券型基金之資產配置允許變動區間上限係以最高配置比重酌加 5%，而允許變動區間下限係以最低配置比重酌減 10%。