

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)		
105年	期初		3,935,098,882									
	1月	-13,276,796	3,921,822,086	3,928,460,484	1,307,143,301	0.54%	33.33%	2,614,678,785	0.31%	66.67%	0.39%	15,320,996
	2月	-1,046,481,347	2,875,340,739	3,398,581,413	1,437,670,370	0.54%	50.00%	1,437,670,370	0.31%	50.00%	0.43%	14,613,900
	3月	-68,639,595	2,806,701,144	2,841,020,942	1,403,350,572	0.54%	50.00%	1,403,350,572	0.31%	50.00%	0.43%	12,216,390
	4月	-35,906,720	2,770,794,424	2,788,747,784	1,385,397,212	0.54%	50.00%	1,385,397,212	0.31%	50.00%	0.43%	11,991,615
	5月	2,137,906,407	4,908,700,831	3,839,747,628	2,045,455,636	0.54%	41.67%	2,863,245,195	0.31%	58.33%	0.41%	15,742,965
	6月	-13,758,129	4,894,942,702	4,901,821,767	2,039,722,624	0.54%	41.67%	2,855,220,078	0.31%	58.33%	0.41%	20,097,469
	7月	-19,242,390	4,875,700,312	4,885,321,507	812,779,242	0.54%	16.67%	4,062,921,070	0.31%	83.33%	0.35%	17,098,625
	8月	-2,387,594,709	2,488,105,603	3,681,902,958	622,026,401	0.54%	25.00%	1,866,079,202	0.31%	75.00%	0.37%	13,623,041
	9月	-125,691,518	2,362,414,085	2,425,259,844	590,603,521	0.54%	25.00%	1,771,810,564	0.31%	75.00%	0.37%	8,973,461
	10月	-100,692,150	2,261,721,935	2,312,068,010	565,430,484	0.54%	25.00%	1,696,291,451	0.31%	75.00%	0.37%	8,554,652
	11月	362,379,798	2,624,101,733	2,442,911,834	656,025,433	0.54%	25.00%	1,968,076,300	0.31%	75.00%	0.37%	9,038,774
	12月	-37,132,056	2,586,969,677	2,605,535,705	646,742,419	0.54%	25.00%	1,940,227,258	0.31%	75.00%	0.37%	9,640,482
全年	-1,348,129,205			3,337,614,989							4.7013%	156,912,371

備註：

1. 基金本期間可運用資金餘額=105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4.7013%，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、105 年度原私校退撫基金運用投資組合規劃表

(自中華民國 105 年 1 月 1 日至中華民國 105 年 12 月 31 日止)

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	93	65 ~ 100	資本利得型	30	15~40
			固定收益型	63	50~72
存款	7	0 ~ 35	存款	7	0~35

備註：

1. 各類型資產配置之中心配置比率，係以附表四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. 資本利得型基金及固定收益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%。
3. 因本年度運用計畫之固定收益型包括債券型及貨幣市場型，故分類上與 104 年度投資運用計畫不同，各中心配置比率及允許變動區間比率亦因而有所變動。