

附件 8

中 華 民 國 年 月 日

○○公司受託辦理公務人員退休撫卹基金 105 年度國外資產移轉管理
業務經營計畫建議書大綱

目 錄	頁 次
壹、 受託機構概況-----	(請註明頁次)
一、 受託機構組織概況-----	(請註明頁次)
二、 移轉管理業務規模及與競爭者之差異-----	(請註明頁次)
三、 移轉管理業務部門人力配置及資歷-----	(請註明頁次)
貳、 移轉管理業務作業流程與風險管理-----	(請註明頁次)
一、 移轉管理業務作業流程概況-----	(請註明頁次)
二、 保密義務-----	(請註明頁次)
三、 風險管理-----	(請註明頁次)
參、 報告服務與應變能力-----	(請註明頁次)
一、 預定提供各類報告之內容與期間-----	(請註明頁次)
二、 客戶服務-----	(請註明頁次)
三、 特殊事件的緊急應變能力-----	(請註明頁次)
四、 違約行為之處理-----	(請註明頁次)
肆、 移轉管理業務執行計畫-----	(請註明頁次)
一、 交易策略與執行-----	(請註明頁次)
二、 投資決策程序與運作方式-----	(請註明頁次)
三、 交易成本與執行差異-----	(請註明頁次)
伍、 計費方式-----	(請註明頁次)
一、 收費結構-----	(請註明頁次)
二、 執行交易能力-----	(請註明頁次)
陸、 其他-----	(請註明頁次)
柒、 附註-----	(請註明頁次)

壹、受託機構概況

一、受託機構組織概況

(本計畫建議書所稱「受託機構」係指申請業者，亦即簽約業者。)

- (一) 受託機構所屬集團或控股公司概况及組織架構圖【請特別標明集團內目前已承作本會業務之法人主體及項目，並請標示集團內各主要功能別關係企業之相互持股比率（達百分之五十以上者）】
- (二) 受託機構概況及組織架構圖。
- (三) 請說明受託機構最近 3 年內（以民國 104 年 12 月 31 日為基準日）之購併或被購併事實，併購或被併購前後對移轉管理（Transition Management）業務之政策為何？
- (四) 請提供貴機構或所屬集團（控股公司）最近 3 年之長期債務信用評等資料。

截止日期 \ 信用評等	標準普爾 (S&P)	穆迪 (Moody's)	惠譽國際 (Fitch)
民國 102 年 12 月 31 日			
民國 103 年 12 月 31 日			
民國 104 年 12 月 31 日			
最新資料（如有，請提供）			

二、移轉管理業務規模及與競爭者之差異

(一) 請提供貴機構最近 3 年受託移轉管理資產淨值及移轉管理個案總數。(以每年年底為基準日)

年度	受託移轉管理資產淨值	移轉管理個案總數
民國 102 年 12 月 31 日	百萬美元	
民國 103 年 12 月 31 日	百萬美元	
民國 104 年 12 月 31 日	百萬美元	

(二) 請說明貴機構最近 3 年在台灣曾有之服務客戶有那些？受託移轉管理資產市值有多少？(以民國 104 年 12 月 31 日為基準日，個別客戶之名稱、受託資產淨值若不方便提供，亦可僅提供合計數。)

(三) 請提供貴機構最近 3 年移轉管理業務收入佔總收入之比重。

年度	移轉管理業務收入	總收入	比率
民國 102 年 12 月 31 日	百萬美元	百萬美元	%
民國 103 年 12 月 31 日	百萬美元	百萬美元	%
民國 104 年 12 月 31 日	百萬美元	百萬美元	%

(四) 請說明貴機構移轉管理業務的特色及與競爭者的差異處。

三、移轉管理業務部門人力配置及資歷

(一) 請提供貴機構移轉管理業務部門的人力狀況及佔整體用人比率。

地區別	人員數量	佔整體用人比率
美洲		%
歐洲		%
亞洲		%
合計		%

(二) 請說明貴機構移轉管理業務部門的重要工作經驗及案例。

(三) 請說明貴機構負責公務人員退休撫卹基金之移轉管理團隊，包括移轉管理人【若有團隊領導人 (team leader) 請一併填寫】、研究人員等之說明資料 (包含姓名、專長、經驗、任職年資、從業年資、個人學經簡歷、獎懲事蹟、權限等資料)。

(四) 請說明貴機構負責公務人員退休撫卹基金之移轉管理團隊如何整合利用集團之資源?移轉管理團隊之移轉管理業務決策是否部分或全部受到集團有關投資指導或規範之限制?

貳、移轉管理業務作業流程與風險管理

一、移轉管理業務作業流程概況

- (一) 請分別詳細說明貴機構以現金建構投資組合、將投資組合轉換為現金、新舊投資組合資產交接、更換投資經理人、變更投資策略、代管性質之移轉管理業務（代管期間在一年以內）等移轉管理業務之運作情形，以及貴機構交易系統之功能與特色。（請附作業流程圖）
- (二) 請說明貴機構如何與本會保管機構及投資經理人配合協調。
- (三) 請提供貴機構執行股票、債券及外匯交易時常用之交易對手名單。

二、保密義務

- (一) 請說明貴機構如何管理有關移轉管理業務的潛在利益衝突。
- (二) 請說明貴機構參與並取得移轉管理業務訊息之人員及該人員所負責之工作項目?如何確保客戶資料的隱密性並與其他業務區隔。

三、風險管理

- (一) 請說明貴機構稽核移轉管理業務部門之組織人力配置狀況、配置比率及工作經驗。
- (二) 請說明貴機構對移轉管理業務之稽核程序。
- (三) 請說明貴機構在移轉管理之過程中，如何管理有關風險？（例如：市場風險、貨幣風險、作業風險、指標風險…等）

(四) 請說明貴機構在什麼情況下，會考慮於移轉管理過程中使用衍生性金融商品進行避險。

參、報告服務與應變能力

一、預定提供各類報告之內容與期間

(一) 請說明貴機構預定提供各類報告之內容與期間，以及可在多少時間內提供報告（請提供報告樣本）。

(二) 請說明貴機構得否配合本會增加報告內容或提供本會要求之制式報告。

二、客戶服務

(一) 請說明貴機構在台灣客戶服務團隊之陣容及其服務內容。

(二) 請說明貴機構除移轉管理業務外，尚能提供之其他服務（例如投資資訊、研究報告、研討會、訓練機會之提供等）。

三、特殊事件的緊急應變能力

請說明貴機構特殊事件的緊急應變能力。

四、違約行為之處理

請說明貴機構對交易、交割等違約行為之處理流程與規範。

肆、移轉管理業務執行計畫

一、交易策略與執行

- (一) 請說明貴機構之交易策略訂定方式，及考量之重要因素。
- (二) 請說明貴機構之交易資金安排、交易流程控管及創新解決方案之能力。

二、投資決策程序與運作方式

請說明貴機構受託辦理移轉管理業務（管理期間在一年以內），其投資分析、規劃、執行之過程、及如何控管可運用投資工具及投資限制等項目。

三、交易成本與執行差異

- (一) 請說明貴機構衡量交易成本及成本節省之方法。
- (二) 請說明貴機構認定交易前後執行成果之方法。
- (三) 請說明貴機構如何認定執行結果不佳及其原因。
- (四) 請貴機構提供 104 年以來承辦移轉管理業務之期間、規模、原預估成本【請分別列示外顯成本（explicit costs）及隱含成本（implicit costs）】、實際成本及差異數。

移轉管理期間	移轉管理規模	原預估成本	實際成本	差異數	備註
	百萬美元	千美元	千美元	千美元	
	百萬美元	千美元	千美元	千美元	
	百萬美元	千美元	千美元	千美元	

伍、計費方式

一、收費結構

- (一) 請說明貴機構一般辦理移轉管理業務之費用計費方式及成本結構【較長期間（例如：超過一個月）之移轉管理業務之計費方式如有不同，請分別列示說明】。
- (二) 請說明貴機構辦理本案移轉管理業務之證券經紀費率報價，以及所填報價之成本結構（請注意本段之報價及成本結構分析數字，需與「移轉管理業務證券經紀費率報價單」之數字一致）。
- (三) 請說明貴機構計費方式之競爭優勢。

二、執行交易能力

- (一) 請說明貴機構於不同市場（例如：美國、歐洲、新興市場等）及資產類別（如：股票、固定收益證券等）之交易執行能力及交易政策。是否使用外部證券經紀商而將成本轉嫁予本會？
- (二) 請說明貴機構執行交叉交易（crossing）之種類及能力，及其對公務人員退休撫卹基金之影響。

- (三) 請說明倘有價證券及未收取證券經紀費用之相關金融商品在店頭市場交易，其成交價格之決定方式，以及如何為公務人員退休撫卹基金爭取最合理之價格。

陸、其他

【包括貴機構最近 3 年（以民國 104 年 12 月 31 日為基準）違反相關法令受各國主管機關之懲處事件、訴訟事件、調查事件或求償事件等及其原因，其餘貴機構可自行填寫】

柒、附註

製作移轉管理業務經營計畫建議書應注意事項：

- 一、請申請業者依本大綱內容、格式製作移轉管理業務經營計畫建議書（但實際頁數不必與本大綱頁數相同），中文正本 1 份，副本 19 份，合計 20 份，每一份包含正文及附件，以不超過 200 頁為限（另可隨中文正本同時提送以英文表達之計畫建議書，亦以不超過 200 頁為限，中文本與英文本應分開裝訂）。請於封面左上角標示正本或副本字樣，內頁毋須再標示正本或副本字樣。
- 二、所有表格內容得以數字表達者請以阿拉伯數字加千分位符號表達，小數點請計算至小數點後第 2 位，小數點後第 3 位四捨五入。
- 三、經營計畫建議書請以 A4 紙張、雙面印刷、橫式橫書並加裝封面橫式裝訂於上方成冊，同時並附上該經營計畫建議書之光碟片電子檔案。（檔案請以可編輯式格式儲存，例如：Word 或 Adobe 之可編輯式檔案。）

四、 收件截止日後，本經營計畫建議書提具人不得要求增、修訂。

五、 經營計畫建議書內容中之專有名詞得加註英文。