

## 委託研究案公告資料

機關資料	單位	國防部資源規劃司
	地址	台北市中山區北安路 409 號
	聯絡人	郭明泉財務員
	電話	(02)85099053
	傳真	(02)85099091
研究案資料	研究說明	<p>一、軍人保險準備金(以下簡稱準備金)投資運用績效良窳，具穩定國軍官兵士氣與安定眷屬心理作用，為有效提升本準備金運用效益，確保軍人保險財務永續健全，強化軍人保險監理會(以下簡稱監理會)對準備金審議與監督等相關運作機制。</p> <p>二、準備金委由臺銀人壽保險股份有限公司(以下簡稱臺銀人壽)負責投資運用，臺銀人壽依規定必須提供相關投資報告及資料，由監理會針對其投資決策及成果進行分析、驗證等相關審理與監督作為，以期運用績效目標之達成。</p> <p>三、投資實務上，相關決策形成，涉及基本面、技術面、籌碼面、消息面等多元因素，應考慮多方因子，思考程序繁瑣、內涵複雜，需具豐富實務經驗，進行分析研判，以創造亮眼的投資績效。</p> <p>四、在實務界，多數投資者係藉由資訊系統自動整合各項訊息，並結合專家邏輯分析程式，快速分析投資市場資訊，滿足即時、迅速支援決策的需求。</p> <p>五、參考實務界經驗，擬建構一套投資分析支援資訊系統，整合市場多元資訊及專家分析邏輯，提供便捷盤後解析、基本分析、籌碼分析以及技術分析等內容，即時、適切分析，可有效協助監理會瞭解投資市場狀況，據以分析、驗證臺銀</p>

		<p>人壽投資決策品質，輔助監理承保機構有關準備金的管理與運用，確保達成年度績效目標，提升監理效能與效率。</p> <p>六、擬透過研究建立投資資訊分析支援系統，提高分析品質與監理效能、效率，系統建置目標重點包含：</p> <p>(一)使用者友善介面，方便順利操作。</p> <p>(二)連結相關財金資料庫，提供即時資訊進行分析。</p> <p>(三)整合多元投資指標，並協助過濾干擾雜訊，提升投資資訊品質。</p> <p>(四)整合專家分析邏輯與經驗法則，協助快速、全面進行投資資訊分析。</p> <p>(五)模組化管理介面，便於後續系統擴充、維護。</p> <p>(六)有效分析及驗證臺銀人壽投資報告，並快速產製相關說明資料。</p>
預告資料	委託研究契約書	如「財團法人國防工業發展基金會委託研究實施計畫」所列。
	研究計畫書	請各有意願承攬研究之廠商，依國防工業發展基金會委託研究實施計畫研擬「研究計畫書」，其內容包含計畫項目、研究人員、預期研究內容、各期預期研究成果、研究時程、計畫進度表、費用需求表、預算科目等，以書面資料(乙式6份)密封後於109年2月16日前寄達國防部資源規劃司。
	計畫主持人及共同主持人之資格	<p>一、具備財務、金融、經濟、會計、經營管理等專業領域博士學位資格之一。</p> <p>二、研究團隊成員專長領域至少包括「專案管理」、「基金管理」、「財務金融」等專業或實務經驗，並瞭解軍保準備金投資運用流程。</p> <p>三、如「財團法人國防工業發展基金會委託</p>

## 軍保監理會投資資訊分析支援系統建置研究

案名	研究項目	研究內容
軍保監理會 投資資訊分 析支援系統 建置研究	個股評價分析	針對國內上市櫃公司之各項基本面、技術面、籌碼面建置評估指標，以使軍保監理會可針對實際或潛在投資個股進行評估，以有效分析及驗證臺銀人壽投資報告，並快速產製相關說明資料
	總體經濟分析	針對國內外總體經濟數據(包含利率、匯率、貨幣供給額、採購經理人指數、勞動力數據等)與大宗商品原物料的價格數據，建置短中長期分析指標，以使軍保監理會了解當前國內外總體情勢與未來趨勢
	基金評價分析	針對國內基金與境外基金，建置相關績效與風險指標，提供短中長期之歷史績效與風險數據，以提供軍保監理會可針對實際或潛在投資基金進行評估，以有效分析及驗證臺銀人壽投資報告
	投資組合資訊管理	結合市場各項商品、交易等相關資訊，以及臺銀人壽投資作業流程之控管機制，使軍保監理會能即時掌握投資投資組合狀況、預估投資收益與投資風險。
	債券評價分析	針對債券利率、發行人評級和市場流動性進行評估，以有效分析及驗證臺銀人壽債券投資的報酬。
	風險管理分析	針對金融市場風險識別、風險衡量、及風險管理對策等各個方面進行評估，並可藉由報表分析展示評估結果及各項衡量指標。
預算	柒佰貳拾伍萬	

		研究實施計畫」所列。
	其他	國防部資源規劃司將依各廠商之研究計畫書辦理評選，並於評選完成後7日內通知(書面或電話)執行單位辦理簽約作業。