

國保基金自 97 年迄今整體績效

單位：新台幣元

項目	收益數	收益率(%)	夏普指標	期末基金規模
97 年度 (97.1.1~97.12.31)	214,353,514	2.39		39,361,156,171
98 年度 (98.1.1~98.12.31)	811,228,960	1.52	4.59	64,792,484,861
99 年度 (99.1.1~99.12.31)	2,835,799,227	3.74	0.39	87,934,082,094
100 年度 (100.1.1~100.12.31)	-3,609,393,286	-3.66	-0.22	102,424,360,342
101 年度 (101.1.1~101.12.31)	5,955,467,696	5.06	0.36	136,398,445,671
算術平均收益率		1.81		
幾何平均收益率		1.77		
102 年度 (102.1.1~102.6.30)	596,600,437	0.42	0.31	152,461,283,188
合計收益數(97 年迄今)	6,804,056,548			

註：1. 夏普指標(SHARPE ratio)自 98 年度開始，不滿 1 年者，即往前取 12 個月資料計算。
 2. 夏普指標(SHARPE ratio)用以衡量每單位總風險（以月化標準差衡量）所得之超額報酬，無風險月利率採用台銀每月 15 日公佈之一年期定存大額固定利率/12。