

## 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 (102.1.1~102.8.31)  | 1,732,578,046  | 1.20   | 0.22  | 156,134,051,339 |
| 合計收益數(97 年迄今)              | 7,940,034,157  |        |       |                 |

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。