

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(97.10.1~97.12.31)	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
102年度(102.1.1~102.12.31)	6,113,988,344	4.06	0.48	169,828,272,127
97年成立迄今 合計收益數	12,321,444,455			
算術平均收益率		2.19		
幾何平均收益率		2.15		
98~102年 合計收益數	12,107,090,941			
算數平均收益率		2.15		
幾何平均收益率		2.10		

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。
3. 依據國保投資政策書之績效公布方式，每年公開基金5年移動平均投資報酬率。