

基金夏普比率什么意思- 基金的夏普比率是什么意思，大好还是小好-股识吧

一、在一项投资中夏普比率越高则代表什么？反之夏普比率越低有代表什么？另外夏普比率只能用在基金里解释？

夏普指数代表投资人每多承担一分风险，可以拿到几分报酬；

若为正值，代表基金报酬率高过波动风险；

若为负值，代表基金操作风险大过于报酬率。

这样一来，每个投资组合都可以计算得出，即投资回报与多冒风险的比例，这个比例越高，投资组合越佳。

夏普比率（又被称为夏普指数 是基金绩效评价标准化指标

二、投资选基金时，为什么夏普比率越高越好

夏普比率核心思想是，理性的投资者会选择在一定的风险水平下，期望回报率最大的投资组合；

或者在一定期望回报率的水平上，风险最小的投资组合，我们要尽可能以最小的风险代价来换取尽可能大的回报。

一句话说完，同等收益下，风险越小越好，这种情况下的夏普比率也就越高

三、基金的夏普比率是什么意思，大好还是小好

夏普比率（sharpe ratio）是基金绩效评价标准化指标，是一个可以同时收益与风险加以综合考虑的三大经典指标之一。

夏普比率计算公式： $= [e(rp) - rf] / \sigma$ 其中 $e(rp)$ ：投资组合预期报酬率

rf ：无风险利率 σ ：投资组合的标准差它反映了单位风险基金净值增长率超过无风险收益率的程度。

如果夏普比率为正值，说明在衡量期内基金的平均净值增长率超过了无风险利率，在以同期银行存款利率作为无风险利率的情况下，说明投资基金比银行存款要好。

夏普比率越大，说明基金单位风险所获得的风险回报越高。

四、基金的夏普指数等是什么意思

夏普指数是以标准差为基金风险的衡量，给出了基金份额标准差的超额收益率。

夏普指数=（基金的平均收益率—基金的平均无风险利率）/基金的标准差

五、基金的夏普比率指的是什么

夏普比率又称夏普指数，其最本质的要点是衡量基金不能只考虑收益，还要考虑到同时需要承受的风险。

因为基金获得较高的回报率可能是在承受更高风险的情况下取得的，夏普比率就是可以同时收益与风险加以综合考虑的指标。

夏普比率的计算及其含义：夏普比率的计算非常简单，用基金净值增长率的平均值减无风险利率再除以基金净值增长率的标准差就可以得到基金的夏普比率。

它反映了单位风险基金净值增长率超过无风险收益率的程度。

夏普比率越大，说明基金单位风险所获得的风险回报越高，这样的基金越值得投资。

计算公式夏普比率=（基金净值增长率的平均值-无风险利率）/基金净值增长率的标准差。

六、开放式基金里面最大回撤，夏普比率，波动率是指什么？

夏普指数代表投资人每多承担一分风险，可以拿到几分报酬；

若为正值，代表基金报酬率高过波动风险；

若为负值，代表基金操作风险大过于报酬率。

这样一来，每个投资组合都可以计算得出，即投资回报与多冒风险的比例，这个比例越高，投资组合越佳。

夏普比率（又被称为夏普指数）是基金绩效评价标准化指标

参考文档

[下载：基金夏普比率什么意思.pdf](#)

[《股票委托多久才买成功》](#)

[《购买新发行股票多久可以卖》](#)

[《股票停牌多久能恢复》](#)

[下载：基金夏普比率什么意思.doc](#)

[更多关于《基金夏普比率什么意思》的文档...](#)

声明：

本文来自网络，不代表

【股识吧】立场，转载请注明出处：

<https://www.gupiaozhishiba.com/author/75887097.html>