

怎样找股票基金的夏普比率--股识吧

一、基金的夏普比率是怎么回事?

夏普比率又被称为夏普指数，目前已成为国际上用以衡量基金绩效表现的最为常用的一个标准化指标。

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。

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。

二、乔的基金与标准普尔500的夏普比率分别是多少

道琼斯股票指数是世界上历史最悠久的股票指数，它被称为股票价格平均数。

除了道琼斯股票价格指数，标准·普尔股票价格指数也非常有影响力的美国，它是全国最大的证券研究机构即本公司编制的标准·普尔股票价格指数。

英语纳斯达克股票市场的所谓全国证券交易商自动报价系统协会（NASDAQ），证券交易商自动报价系统，即全国协会，是由证券交易商协会（全国证券交易商协会）于1971年建成美国证券公司监管报告的股票买卖电子交易市场的股票交易价格。

三、如何用夏普比率选择投资组合

1、夏普比率，又被称为夏普指数，是基金绩效评价标准化指标。

夏普比率在现代投资理论的研究表明，风险的大小在决定组合的表现上具有基础性的作用。

风险调整后的收益率就是一个可以同时收益与风险加以考虑的综合指标，以期能够排除风险因素对绩效评估的不利影响。

夏普比率就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。

投资中有一个常规的特点，即投资标的的预期报酬越高，投资人所能忍受的波动风

险越高；

反之，预期报酬越低，波动风险也越低。

所以理性的投资人选择投资标的与投资组合的主要目的为：在固定所能承受的风险下，追求最大的报酬；

或在固定的预期报酬下，追求最低的风险。

2、运用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。

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，说明基金的单位风险所获得的风险回报越高。

夏普比率为负时，按大小排序没有意义。

夏普比率以资本市场线作为评价基准，对投资绩效作出评估。

3、夏普比率在运用中应该注意的问题夏普比率在计算上尽管非常简单，但在具体运用中仍需要对夏普比率的适用性加以注意：（1）用标准差对收益进行风险调整，其隐含的假设就是所考察的组合构成了投资者投资的全部。

因此只有在考虑在众多的基金中选择购买某一只基金时，夏普比率才能够作为一项重要的依据；

（2）使用标准差作为风险指标也被人们认为不很合适的。

（3）夏普比率的有效性还依赖于可以以相同的无风险利率借贷的假设；

（4）夏普比率没有基准点，因此其大小本身没有意义，只有在与其他组合的比较中才有价值；

（5）夏普比率是线性的，但在有效前沿上，风险与收益之间的变换并不是线性的。

因此，夏普指数在对标准差较大的基金的绩效衡量上存在偏误；

（6）夏普比率未考虑组合之间的相关性，因此纯粹依据夏普值的大小构建组合存在很大问题；

（7）夏普比率与其他很多指标一样，衡量的是基金的历史表现，因此并不能简单地依据基金的历史表现进行未来操作。

（8）计算上，夏普指数同样存在一个稳定性问题：夏普指数的计算结果与时间跨度和收益计算的时间间隔的选取有关。

四、如何查询基金的换手率？

电脑输入代码后，在每支股票的界面上，都有每天换手率的显示，如要某个期间的换手率可以用区间统计的方法累计而成。

五、如何在网上察看购买基金的股数

你如果是网上购买的可以到基金网站直接查询，如果是在银行购买的就要在你买基金两日后到银行打印交割单就知道了，或者开通网上银行业务能查，比如建行在投资理财---证券卡管理---持仓查询里能查到具体份额

六、

七、如何看待基金的夏普比率(组图)求答案

基金算一算天相投顾 闻群 仪胜男一般来说，投资组合的预期收益越高，其相应的风险就越大，一味地追求高收益可能会导致投资者实际面临的风险超出自身的承受能力，因此，投资者选择基金时最好不要将收益率作为唯一的衡量指标，在评价基金的绩效时，应综合考虑其收益和风险。

下面简单介绍一种常见的基金绩效评价指标夏普比率。

夏普比率（Sharpe ratio）被用来衡量投资组合相对于无风险利率的收益情况，是指在某一时间段内，基金获得的收益高于无风险利率的部分除以基金收益的标准差得到的比值，反应的是每一单位风险所带来的超额收益。

具体的计算公式为：其中， r_A 表示基金A的平均收益率；

r_f 表示平均无风险利率，一般取国债收益率或银行整存整取的利率。

σ_A 表示某一时间段内基金A收益率的标准差，衡量的是基金收益的波动情况，一般来说，标准差越大说明基金的业绩越不稳定。

从公式中可以看出，夏普比率衡量了基金相对于无风险利率的收益情况，反映的是基金承担每单位风险所获得的额外报酬，数值越大，表示基金能够以相对较小的风险换取较大的超过无风险回报的收益，即经过风险调整后的收益越高。

举例而言，两只基金A、B某年的平均收益率分别为10%、8%，收益率的标准差分别为14%、10%，该年的无风险利率为2%，则基金A、B的夏普比率、分别为：
$$S_A = (10\% - 2\%) / 14\% = 0.57 = (8\% - 2\%) / 10\% = 0.6。$$

由于 $0.57 < 0.6$ ；

0.6，B基金比A基金的风险调整后的收益更高。

仅从夏普比率来看，我们可以认为B基金优于A基金。

夏普比率的计算非常简单，它反映了在单位风险下基金收益超过无风险利率的程度。

如果夏普比率为正值，说明在评价期内基金的平均净值增长率超过了无风险利率，假如取同期银行存款利率作为无风险利率的话，说明投资基金比银行存款要好。

另外，夏普比率越大，说明基金承担单位风险获取超额收益的能力越强。

夏普比率是衡量基金的风险调整收益水平的一个重要指标，对我们选择基金有一定的指导意义，但并不是衡量基金绩效的唯一指标，投资者可结合基金的其它因素和自身的风险承受能力来选择基金。

本栏旨在为基民提供一些涉及基金计算方面的知识，以便大家在投资基金时进行分析和参考。

(责任编辑：姜永明)搜狐证券声明：本频道资讯内容系转引自合作媒体及合作机构，不代表搜狐证券自身观点与立场，建议投资者对此资讯谨慎判断，据此入市，风险自担。

八、如何查询指数基金市盈率

正确答案：A 解析：如果股票基金的平均市盈率、平均市净率小于市场指数的市盈率和市净率，则可以认为该股票基金属于价值型基金；

反之，该股票基金则可以归为成长型基金。

参考文档

[下载：怎样找股票基金的夏普比率.pdf](#)

[《股票的转股和分红多久到》](#)

[《只要钱多久能让股票不下跌吗》](#)

[《购买新发行股票多久可以卖》](#)

[《混合性股票提现要多久到账》](#)

[下载：怎样找股票基金的夏普比率.doc](#)

[更多关于《怎样找股票基金的夏普比率》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/read/31364749.html>