



نسبت شارپ

نسبت شارپ یکی از معیارهای سنجش موفقیت و عملکرد یک صندوق سرمایه‌گذاری است.





نسبت شارپ یکی از معیارهای سنجش موفقیت و عملکرد یک صندوق سرمایه‌گذاری بوده که به سرمایه‌گذاران کمک می‌کند که سود بدست آمده نسبت به ریسک آن را بسنجند. نسبت شارپ به میانگین بازده بدست آمده مازاد بر نرخ سود بدون ریسک به ازای هر واحد از نوسان‌پذیری یا ریسک کل است.

صفحه بعد ►►

۳

فرمول محاسبه نسبت شارپ برابر است با:

$$S = \frac{\text{نرخ بازده (سود) بدون ریسک} - \text{میانگین نرخ بازده سرمایه‌گذاری}}{\text{انحراف معیار استاندارد بازده سرمایه‌گذاری}}$$

نسبت شارپ

نرخ بازده بدون ریسک همان نرخ بازده سپرده‌های بانکی و اوراق قرضه دولتی است. نسبت شارپ بیشتر از 1 برای سرمایه‌گذاران قابل قبول است که عدد بالاتر از 2 بسیار خوب ارزیابی می‌شود و نسبت شارپ کمتر از 1 نیز ضعیف در نظر گرفته می‌شود.