

股票夏普率在哪里看，夏普条件下最优套期保值比率如何计算?-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、金融学的题 求股票基金夏普比率。。。

夏普比率= (18%-7%) ÷ 25%=0.44特雷诺比率= (18%-7%) ÷ 1.25=0.088

三、如何用夏普比率选择投资组合

夏普比率（SharpeRatio），又被称为夏普指数---基金绩效评价标准化指标。

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。

例如，假设有两个基金A和B，A基金的年平均净值增长率为20%，标准差为10%，B基金的年平均净值增长率为15%，标准差为5%，年平均无风险利率为5%，那么，基金A和基金B的夏普比率分别为1.5和2，依据夏普比率基金B的风险调整收益要好于基金A。

为了更清楚地对此加以解释，可以以无风险利率的水平，融入等量的资金（融资比例为1：1），投资于B，那么，B的标准差将会扩大1倍，达到与A相同的水平，但

这时B的净值增长率则等于25%（即 $2 \times 15\% - 5\%$ ）则要大于A基金。

使用月夏普比率及年夏普比率的情况较为常见。

投资者通过夏普比率可以意识到基金也有性价比，此比率可以帮助投资者选出同等波动情况下，收益较高的基金，达到兼顾考虑风险和收益的效果。

四、多支股票的夏普比率能一样吗

完全可能，这是技术版的方法，关键是国家财政政策货币政策的方向，社会上的钱是多了，好融资。

经济好大盘都会涨。

多数好股都是赢利从负到大赚大伏赢利。

股价涨几倍。

五、简述如何使用夏普比率对股票型基金进行评价

夏普比率计算公式： $= [E(R_p) - R_f] / \rho$ 其中 $E(R_p)$ ：投资组合预期报酬率 R_f ：无风险利率 ρ ：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。

六、请问你有具体计算基金或者股票的夏普比率的公式吗？

夏普计算公式是基金等的预期收益率减去无风险利率除以所有基金组合的市场风险系数，我不知道你算来做什么，但这几个有可信度的数字比较难得到，夏普指数主要还是基金公司为了衡量收益和承担风险的比率大小的，大多用来评价基金的业绩。

七、夏普条件下最优套期保值比率如何计算？

套期保值比率的计算方法：国外：一、

Johnson提出运用最小二乘法(OLS)将期货与现货价格的差分进。

行线性回归以达到最小方差拟合。

二、Ederington在此基础上对小麦、玉米、债券等期货合约运用OLS。

法估计套期保值比率，得出套期保值比率和套期保值绩效随套期保值期限的延长而增加的结论。

三、Ghosh在对利用标准普尔500指数期货为几种股票组合进行套。

期保值的实证研究中发现，由于忽略了期货和现货价格之间可能存在的协整关系，从传统的OLS模型中获得的套期保值比率将被低估，提出运用误差修正模型(ECM)估计最优套期保值比率。

四、Cecchetti利用ARCH模型对美国国债期货合约的效用最大动态

套期保值比率进行估计，发现套期保值比率随着合约持有时间的变长而变得更高。

五、Baillie和Myers通过考察商品期货市场，发现与传统的常数静态套期保值策略相比，基于GARCH模型的动态套期保值策略能够改善套期保值的效果。

《基于中国市场的最优套期保值比率模型绩效实证检验》在过去四十多年的时间里，随着金融市场和理论研究的不断发展，传统OLS最优套期保值比率确定模型越来越不符合金融市场的实际情况，随着金融市场的复杂化和波动加剧，其套期保值绩效日趋下降。

因此，后续的研究者不断地对其进行改进，并且不断提出新的模型用于最优套期保值比率的研究。

这一问题的研究发展过程有两条主线：(1)在传统OLS模型的框架内继续研究并提出改进，主要有B—VAR模型、OLS—CI模型、ECM模型等，这类模型可以通过估计模型参数直接得到最优套期保值比；

(2)由单变量GARCH模型发展到各种复杂的多元GARCH模型，主要有VECH模型、BEKK模型、CCC常相关多元GARCH模型、DCC动态相关多元GARCH模型、Copula—GARCH模型等，这类模型主要是通过模型估计出方差—协方差矩阵或条件相关系数，然后再计算求出最优套期保值比率。

八、开放式基金里面最大回撤，夏普比率，波动率是指什么？

最大回撤，就是最高点到最低点的相差数据，回撤大说明风险也大。

夏普比率，每承担一份风险，要有超额收益做为补偿，夏普比率越大越好波动率，基金所买的股票上上下下，会有浮动，波动率越大风险也越大。

参考文档

[下载：股票夏普率在哪里看.pdf](#)

[《快手股票为什么走低点》](#)

[《什么叫新旧股票区别》](#)

[下载：股票夏普率在哪里看.doc](#)

[更多关于《股票夏普率在哪里看》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/21038907.html>