

衡量股票的风险指标有哪些|反映股票收益与风险的重要指标是什么？-股识吧

一、衡量风险三个指标及含义是什么？大神们帮帮忙

贝塔系数、波动值(Volatility)、夏普指数(Sharpe)

前两种数值越大，代表风险越高；

夏普指数越大，则代表风险承担得越值得。

贝塔系数是用来衡量单一股票或者基金与参考指标间的相对变化关系.贝塔系数越大，代表基金净值变动相对于大盘越大

波动值是一个投资工具回报的可能的变动程度。

波动值越大，这种投资工具未来价格变动的程度越大。

夏普指数，则是一个经过风险调整后的绩效指标。

若为正值，则代表基金报酬率高过波动风险；

若为负值，则代表基金操作风险大过报酬率

二、反映股票收益与风险的重要指标是什么？

利润率，坏帐，成品成本率，库存率，现金周转率，市场占有率

三、股票风险的度量主要有哪些

在用于度量证券组合投资风险的协方差矩阵为非正定时，研究允许卖空且存在无风险证券的证券组合投资决策模型，给出了最优投资比例系数的计算方法及有效边界。

在投资活动中，收益和风险是投资者关心的两个基本问题。

现代投资理论创始人 Markowitz假定投资风险可视为投资收益的不确定性

，这种不确定性可用统计学中的方差或标准差来度量

，而投资收益可用统计学中的均值或期望来度量。

理性的投资者在进行投资决策时追求的是收益

四、衡量风险的指标有；

衡量风险的指标有以下5个标准差方差变化系数协方差 值 你自己对比一下吧。

五、如何衡量某一支股票的风险大小？

上市后几年的平均市盈率、平均市净率、平均股价公司有没有财务问题，经营是否正常，有没有吃官司，被反倾销等等

六、反映股票基金风险大小的指标有有哪些？

常用来反映股票基金风险大小的指标有标准差、贝塔值、持股集中度、行业投资集中度、持股数量等指标。

低周转率的基金倾向于对股票的长期持有，高周转率的基金则倾向于对股票的频繁买入与卖出。

七、度量风险的指标有哪些

度量风险的指标种类：1.

敏感性指标，用于衡量资产价值对某一风险因子的敏感性。

如 值，衡量单一股票或股票组合对市场指数(标普500、沪深300)的敏感性，敏感性指标的一个缺点是，无法知道对整体的绝对影响；

2. 波动性指标，用以衡量资产收益率相对于资产期望收益率的偏离程度，常用标准差()度量，标准差表示各观测值偏离于均值距离的平均数。

与标准差相关联的一个概念是相关系数()，用以衡量两个变量(a和b)线性相关的密切程度，其值介于-1至1之间， =1表示变量a和b完全同方向变动， =-1表示变量a和b完全反方向变动， =0表示变量a和b无相关性，无法从a的变动推知b的变动；

3. 概率类指标，用以衡量某一结果发生可能性大小的度量。

风险与损失虽然存在密切的关系，但概率在其中扮演着重要的角色，某一损失虽然很大，但发生的概率却非常低，则该损失的期望损失将很低，从而该损失的实际风

险可能并没有表象上那么大；

4. 综合类指标，将概率、损失、对整体的绝对影响统一考量的指标，这类指标的典型代表是VAR，它表示在一定概率下的最大可能损失是多少，克服了上述三类指标单独考量风险某一维度的缺陷。

同时，由于VAR表示的损失值的大小，相对敏感性指标而言，VAR提供了一个对不同资产风险的统一考量，具有可加总的优越性。

扩展资料：标准差来表示风险不太符合实务需求，大部分波动的观念植基于风险为对称的假设，但这种假设不仅在学术界仍有争议，而且不符合实务上重视负面损失的表达。

例如由2楼坠地和20楼坠地的可能结果，就波动而言，前者通常大于后者(2楼坠地可能无事、轻伤、重伤或死亡，20楼坠地基本不死也重伤)，但就对风险的认知来看，后者的风险是较大的。

风险衡量指衡量外汇风险带来潜在损失的概率和损失程度。

风险的数学表达：对于风险，理论上还没有统一的定义。

风险都是源自未来事件的不确定性，从数学角度看，它表明的是各种结果发生的可能性。

在公司金融学中，研究风险是为了研究投资的风险补偿，对风险的数学度量，是以投资（资产）的实际收益率与期望收益率的离散程度来表示的。

最常见的度量指标是方差和标准差。

参考资料：风险衡量 百度百科

八、衡量风险三个指标及含义是什么？

衡量风险三个指标：贝塔系数、波动值(Volatility)、夏普指数(Sharpe)前两种数值越大,代表风险越高；

夏普指数越大,则代表风险承担得越值得。

贝塔系数：是用来衡量单一股票或者基金与参考指标间的相对变化关系.贝塔系数越大,代表基金净值变动相对于大盘越大波动值是一个投资工具回报的可能的变动程度。

波动值越大,这种投资工具未来价格变动的程度越大。

夏普指数：则是一个经过风险调整后的绩效指标。

若为正值,则代表基金报酬率高过波动风险；

若为负值,则代表基金操作风险大过报酬率

九、反映股票收益与风险的重要指标是什么？

利润率,坏帐,成品成本率,库存率,现金周转率,市场占有率

参考文档

[下载：衡量股票的风险指标有哪些.pdf](#)

[《联科科技股票中签后多久不能卖》](#)

[《股票抽签多久确定中签》](#)

[《股票放多久才能过期》](#)

[下载：衡量股票的风险指标有哪些.doc](#)

[更多关于《衡量股票的风险指标有哪些》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/6504780.html>