

股票风险的衡量指标有哪些—衡量股市风险大小的指标有哪些?如何看?-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。

三、什么风险需要股票的贝塔系数来衡量

系统性风险 系数也称为贝他系数（Beta coefficient），是一种风险指数，用来衡量个别股票或股票基金相对于整个股市的价格波动情况。

系数是一种评估证券系统性风险的工具，用以度量一种证券或一个投资证券组合相对总体市场的波动性，在股票、基金等投资术语中常见。

实际上就是个股根大盘的连动性，如果这种连动性很强的话，那么一旦出现系统性风险，个股难逃厄运，庄股这种风险就小，可以反向考虑大盘蓝筹一般都同步

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、如何衡量个股的风险和收益

衡量风险和收益比收益 = 利润 - 亏损 = 盈亏比X胜算率。
高盈亏比必然在长期交易中，降低胜算率，
反之高胜率必定要用大的亏损和小盈利换得。

七、衡量股市风险大小的指标有哪些?如何看?

技术指标obv和k线线形态

八、衡量风险的常用指标是？

标准差 方差 变化系数 协方差 值

九、风险衡量指标都有哪些,它们的计算公式是什么,各自的适用范围是什么？

系数常常用在投资组合的各种模型中，比如马柯维茨均值-

方差模型、夏普单因素模型 (Shape Single-Index Model) 和多因素模型。具体来说， β 系数是评估一种证券系统性风险的工具，用以量度一种证券或一个投资证券组合相对于总体市场的波动性， β 系数利用一元线性回归的方法计算。

(一) 基本理论及计算的意义经典的投资组合理论是在马柯维茨的均值——方差理论和夏普的资本资产定价模型的基础之上发展起来的。

在马柯维茨的均值——方差理论当中是用资产收益的概率加权平均值来度量预期收益，用方差来度量预期收益风险的： $E(r) = \sum p(r_i) r_i$ $\sigma^2 = \sum P(r_i)[r_i - E(r)]^2$

(2) 上述公式中 $p(r_i)$ 表示收益 r_i 的概率， $E(r)$ 表示预期收益， σ^2 表示收益的风险。

夏普在此基础上通过一些假设和数学推导得出了资本资产定价模型(CAPM)： $E(r_i) = r_f + \beta_i [E(r_M) - r_f]$ (3) 公式中系数 β_i 表示资产 i 的所承担的市场风险。

$\beta_i = \text{cov}(r_i, r_M) / \text{var}(r_M)$ (4) CAPM 认为在市场预期收益 r_M 和无风险收益 r_f 一定的情况下，资产组合的收益与其所分担的市场风险 β_i 成正比。

CAPM 是基于以下假设基础之上的：(1) 资本市场是完全有效的(The Perfect Market)；

(2) 所有投资者的投资期限是单周期的；

(3) 所有投资者都是根据均值——方差理论来选择有效率的投资组合；

(4) 投资者对资产的报酬率分布具有一致的期望。

2007年2月28日，中国银监会发布了《中国银行业实施新资本协议指导意见》，标志着我国正式启动了实施《巴塞尔新资本协议》的工程。

按照我国商业银行的发展水平和外部环境，短期内我国银行业尚不具备全面实施《巴塞尔新资本协议》的条件。

因此，中国银监会确立了分类实施、分层推进、分步达标的基本原则。

(1) 分类实施的原则。

国内商业银行在资产规模、业务复杂性、风险管理水平、国际化程度等方面差异很大，因此，对不同银行应区别对待，不要求所有银行都实施《巴塞尔新资本协议》。

...(2) 分层推进的原则。

我国大型商业银行在内部评级体系、风险计量模型、风险管理的组织框架流程开发建设等方面进展不一。

.....(3) 分步达标的原则。

《巴塞尔新资本协议》对商业银行使用敏感性高的资本计量方法规定了许多条件，涉及资产分类、风险计量、风险管理组织框架和政策流程等许多方面，全面达标是一个渐进和长期的过程。

.....供参考。

参考文档

[下载：股票风险的衡量指标有哪些.pdf](#)

[《混合性股票提现要多久到账》](#)

[《股票亏钱多久能结束》](#)

[《股票停牌重组要多久》](#)

[下载：股票风险的衡量指标有哪些.doc](#)

[更多关于《股票风险的衡量指标有哪些》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/subject/52983386.html>