

# metlab怎么算200个股票的夏普比率、如何计算时变夏普比率-股识吧

## 一、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： $= [E(R_p) - R_f] / \sigma_p$  其中  $E(R_p)$ ：投资组合预期报酬率  $R_f$ ：无风险利率  $\sigma_p$ ：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。

## 二、财务杠杆比率和资本收益率的计算

杠杆比率=总资产 ÷ 总资本=100 ÷ 10=10 资产收益率=净利润 ÷ 总资产 × 100%=1.5%  
净利润=100 × 1.5%=1.5 资本收益率= (净利润 ÷ 资本总额) × 100%= (1.5 ÷ 10) × 100%=15%

## 三、如何计算时变夏普比率

你的迷惑主要来自于收益率怎么算吧。

如果按投资期两端相减再年化，结果是-1。

如果日收益年化，那就是  $(-1+1+0.5)/3$  的年化，这样是正的。

依我看应该按后者来，前者的计算方法平滑掉了波动率偏差。

和Ito积分里面的情况有点像。

要看什么类型的策略，假如买期权，一天亏完是有可能的，但是一天赚翻倍也是有的。

要是你的信号亏完第一次，赚翻倍10次，还是好信号。

(当然亏完是资金分配和止损不对，不过信号是好信号)

## 四、股票中筹码比例是怎么算出来的

公式说明编辑当浮筹比例很小，小到百分只几，甚至零点几的时候，怎么看呢？浮筹比例是当前股价上下10%的空间的筹码数量( $asr:(winner(c*1.1)-winner(c*0.9))/winner(hhv(h,0))*100$ );。

也就是说（以收盘价\*1.1计算的获利盘比例-以收盘价\*0.9计算的获利盘比例）/以0日内最高价的最高值计算的获利盘比例\*100），当股价经过一轮暴跌后，上面堆积了大面积的套牢盘。

下跌过程中，只要浮筹比例还有不小比例的值出现，通常是15-30%左右，就说明下跌动能没有释放殆尽，就还有下行空间，因为不断有人忍受不住割肉，被抢反弹的人承接，成为新的套牢者。

但随着股价的加速下跌，这时获利比例几乎为0，也就是满盘皆套！如果这时所有的人不再抛售，产生惜售心理，股价下跌就开始缩量了，做空动能已经充分释放，表现出浮筹比例很小！如果维持几天的话，就说明终于跌无可跌了。

成交极度萎缩！浮筹比例极小。

扩展资料：指标筹码分布指标（CYQ）是将市场交易的筹码画成一条条横线，其数量共100条，该横线在价格空间内所处的位置代表指数或股价的高低，其长短代表该价位筹码数量的多少。

该指标由陈浩于1997年发明，并被投资者所知。

一、适用范围1、长期牛市中。

2、用于中线行情第一主升浪最好。

3、中线、短线，高位、低位均可使用。

二、主要作用1、判断大盘及个股的底部及顶部区域。

2、监测庄家进货及出货。

3、判断个股主力是强庄还是弱庄。

4、判断主力炒作中各阶段的持仓量。

5、预测个股涨升的目标位。

6、预测股价上升或下跌过程中的阻力或支撑位。

参考资料来源：股票百科-浮筹比例

## 五、用友：对轿车进行资产评估，评估结果为原值“200 000”，累计折旧“45 000”。是算作资产变动还是资产评估

资产评估

## 六、金融学的题 求股票基金夏普比率。。。

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

## 七、股票质押业务计算

一般通行做法公允价为  $\text{MIN}\{\text{收盘价}, 20\text{日均价}\}$  ---> 15元 费用分为：经手费、质押登记费  
经手费：100元/笔 质押登记费：500万股以下（含）部分按该部分面值的1‰收取，超500万股的部分按该部分面值的0.1‰收取，起点100元  
 $500\text{万} \times 0.001 + 1500\text{万} \times 0.0001 = 6500\text{元}$   
初始成交金额 =  $2000\text{万} \times 15\text{元} \times 0.4 = 1.2\text{亿}$   
实际到账 =  $1.2\text{亿元} - 6500 - 100$   
购回金额 = 初始成交金额 + 利息 难点我都讲了，剩下自己算吧

## 参考文档

[下载：metlab怎么算200个股票的夏普比率.pdf](#)

[《股票持有多久合适》](#)

[《只要钱多久能让股票不下跌吗》](#)

[《新的股票账户多久可以交易》](#)

[下载：metlab怎么算200个股票的夏普比率.doc](#)

[更多关于《metlab怎么算200个股票的夏普比率》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/author/12046385.html>