

股票中夏普比率高低代表什么|如何用夏普比率选择投资组合-股识吧

一、：市盈率高是什么意思？买股票是不是买市盈率低的比较好？

这个市盈率也不是越低越好，是合适的才是好的，我现在也是刚炒股的新手，用了弈道盯盘手，这个软件是决策性的软件，和适合我用，有专业的老师进行指导，所以我一般不懂的专业性的问题都可以直接的和专业的分析师进行交流。

二、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 σ_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。

三、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 to 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。

四、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。

五、股票市盈率的高低都说明什么问题

市盈率表示的是投资者为了获得公司每一单位的收益或盈利而愿意支付多少倍的价格。

比如，某只股票有2元的业绩，投资者愿意以市价20元购买该股票，该股票相应的市盈率就为10倍。

一般来说，市盈率的高低可以用来衡量投资者承担的投资风险，市盈率越高说明投资者承担的风险相对越高。

当然仅用市盈率来作为投资决策的标准是远远不够的，投资者还应该参考其他因素。

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 = $(18\% - 7\%) \div 1.25 = 0.088$

参考文档

[下载：股票中夏普比率高低代表什么.pdf](#)

[《华天科技解禁的股票价格是多少呢》](#)

[《彩虹新能源概念股票有哪些》](#)

[《股票分红什么时候买人才有》](#)

[《股票一般什么时间可以赎回》](#)

[下载：股票中夏普比率高低代表什么.doc](#)

[更多关于《股票中夏普比率高低代表什么》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/chapter/57105670.html>