

# 股票的夏普率怎么计算器、夏普计算器怎么算出一元二次解析式-股识吧

## 一、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。

## 二、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 =  $(18\% - 7\%) \div 1.25 = 0.088$

### 三、例5-12，那个用年收益率得到的夏普比率0.36，怎么得来的，我怎么算都不对

用年收益率算夏普比率时，无风险收益率也应该变成年收益率，应该是  $0.5\% \times 12 = 6\%$  夏普比率 =  $(12\% - 6\%) / 16.6\% = 0.36$

### 四、夏普比率和最大回撤到底怎么计算

夏普比率的计算非常简单，用基金净值增长率的平均值减无风险利率再除以基金净值增长率的标准差就可以得到基金的夏普比率。

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  $\rho$ ：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。

### 五、• 股票的市盈率是如何算出来的？

市盈率即市价盈利率，它是上市公司的股票在最新年度每股的盈利与该公司最新股价的比率

### 六、夏普计算器怎么算出一元二次解析式

按mode键，接着按键1，进入单变量统计状态；

输入一个数，再按M+键（实际上是Data键，在本人所用的计算器上对应M+键），屏幕显示输入数据的个数：1；

再输入第二个数据，按Data键，屏幕显示输入数据的个数：2；

以此方法依次输入所有数据；

若想求均值，则按RCL键、再按 $\bar{x}$ 键（即变量 $x$ 上面有一横杆）（在本人所用的计算器上对应的是数字键：4键）；

若想求样本标准差，则按RCL键、再按 $s_x$ 键；

若想求总体标准差，则按RCL键、再按 $\sigma_x$ 键。

输入数据时，若有相同的数据，也可先输入数据，再按“，”键，再输入相同数据的个数；

再按Data键。

其它相同。

若是双变量统计，按mode键，接着按键2；

对于一个数据对 $(x, y)$ ，先输入数据 $x$ ，再按 $(x, y)$ 键（STO键）、再输入数据 $y$ ，最后再按Data键；

其它数据对的输入，以此相似。

最后，统计结果的显示如同单变量统计的方法。

## 七、夏普计算器怎么算出一元二次解析式

以W531H为例：求4, 5, 6的方差，1、[mode]+[1]+[0]2、[2ndF]+[CA]3、[4]+[data]4、[5]+[data]6、[6]+[data]7、[RCL]+[x]方差8、[RCL]+[x上横线]平均数

## 参考文档

[下载：股票的夏普率怎么计算器.pdf](#)

[《中泰齐富股票卖了多久可以提现》](#)

[《股票停牌多久下市》](#)

[下载：股票的夏普率怎么计算器.doc](#)

[更多关于《股票的夏普率怎么计算器》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/44521370.html>