

股票夏普比率在哪里看出来.多支股票的夏普比率能一样吗-股识吧

一、多支股票的夏普比率能一样吗

完全可能，这是技术版的方法，关键是国家财政政策货币政策的方向，社会上的钱是多了，好融资。

经济好大盘都会涨。

多数好股都是赢利从负到大赚大伏赢利。

股价涨几倍。

二、国泰金鹰怎么样

基金名称 国泰金鹰增长股票 基金代码 020001 基金类型 股票型 投资风格 成长型
基金风格 偏股型基金 基金经理 张玮 申购费率 1.50% 赎回费率 0.50% 总份额
20.33亿份 资产净值 21.79亿元 管理费率 1.50% 成立日期 2002-05-08 基金管理人
国泰基金管理有限公司 基金托管人 中国交通银行 投资范围 本基金的投资范围限于
具有良好流动性的金融工具，包括国内依法公开发行上市 的股票、债券及中国证监
会允许基金投资的其他金融工具。

其中投资重点是利润或收入具有良好增长潜力的增长型上市公司，这部分投资比例
将不低于本基金股票资产的80%。

晨星评级 回报率(%) 最近三年风险评价 夏普比率 三年 一月 半年 一年 二年
今年以来 波动幅度(%) 评价 晨星风险系数 评价 最近两年 评价 -3.61 19.75

5.80 40.47 6.00 31.82 偏低 0.92 偏低 0.22 高晨星给的评级为4星

;

;

呵呵可以见利后赎回 不建议你长期持有~~~~~

三、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 对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。

四、开放式基金里面最大回撤，夏普比率，波动率是指什么？

基金名称 国泰金鹰增长股票 基金代码 020001 基金类型 股票型 投资风格 成长型
基金风格 偏股型基金 基金经理 张玮 申购费率 1.50% 赎回费率 0.50% 总份额
20.33亿份 资产净值 21.79亿元 管理费率 1.50% 成立日期 2002-05-08 基金管理人
国泰基金管理有限公司 基金托管人 中国交通银行 投资范围 本基金的投资范围限于
具有良好流动性的金融工具，包括国内依法公开发行上市的股票、债券及中国证监会
允许基金投资的其他金融工具。

其中投资重点是利润或收入具有良好增长潜力的增长型上市公司，这部分投资比例
将不低于本基金股票资产的80%。

晨星评级 回报率(%) 最近三年风险评价 夏普比率 三年 一月 半年 一年 二年
今年以来 波动幅度(%) 评价 晨星风险系数 评价 最近两年 评价 -3.61 19.75
5.80 40.47 6.00 31.82 偏低 0.92 偏低 0.22 高晨星给的评级为4星

；

；

呵呵可以见利后赎回 不建议你长期持有~~~~~

五、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，就是最高点到最低点的相差数据，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。

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

七、请问你有具体计算基金或者股票的夏普比率的公式吗？

夏普计算公式是基金等的预期收益率减去无风险利率除以所有基金组合的市场风险系数，我不知道你算来做什么，但这几个有可信度的数字比较难得到，夏普指数主要还是基金公司为了衡量收益和承担风险的比率大小的，大多用来评价基金的业绩。

参考文档

[下载：股票夏普比率在哪里看出来.pdf](#)

[《飞龙在天股票在两高点时间是多久》](#)

[《股票功能复位多久恢复》](#)

[《股票带帽处理要多久》](#)

[《大冶特钢股票停牌一般多久》](#)

[《股票实盘一般持多久》](#)

[下载：股票夏普比率在哪里看出来.doc](#)

[更多关于《股票夏普比率在哪里看出来》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/store/50438099.html>