

# 股票的方差如何看到：股票预期收益怎么看-股识吧

## 一、股票预期收益怎么看

拿模型套的，个人投资者我觉得用不到这些，股票的预期收益率 $E(R_i) = R_f + [E(R_m) - R_f] \beta_i$   $R_f$ ：无风险收益率-----一般用国债收益率来衡量  
 $E(R_m)$ ：市场投资组合的预期收益率  $\beta_i$ ：投资的 值-----市场投资组合的 值永远等于1，风险大于平均资产的投资 值大于1，反之小于1，无风险投资 值等于0

## 二、某一个股票与股票市场组合的方差是什么意思

任何投资者都希望投资获得最大的回报，但是较大的回报伴随着较大的风险。为了分散风险或减少风险，投资者投资资产组合。资产组合是使用不同的证券和其他资产构成的资产集合，目的是在适当的风险水平下通过多样化获得最大的预期回报，或者获得一定的预期回报使用风险最小。作为风险测度的方差是回报相对于它的预期回报的离散程度。资产组合的方差不仅和其组成证券的方差有关，同时还有组成证券之间的相关程度有关。为了说明这一点，必须假定投资收益服从联合正态分布（即资产组合内的所有资产都服从独立正态分布，它们间的协方差服从正态概率定律），投资者可以通过选择最佳的均值和方差组合实现期望效用最大化。如果投资收益服从正态分布，则均值和方差与收益和风险一一对应。如本题所示，两个资产的预期收益率和风险根据前面所述均值和方差的公式可以计算如下：1。  
股票基金 预期收益率= $1/3 * (-7\%) + 1/3 * 12\% + 1/3 * 28\% = 11\%$   
方差= $1/3 [(-7\% - 11\%)^2 + (12\% - 11\%)^2 + (28\% - 11\%)^2] = 2.05\%$   
标准差= $14.3\%$ (标准差为方差的开根，标准差的平方是方差)2。  
债券基金 预期收益率= $1/3 * (17\%) + 1/3 * 7\% + 1/3 * (-3\%) = 7\%$   
方差= $1/3 [(17\% - 7\%)^2 + (7\% - 7\%)^2 + (-3\% - 7\%)^2] = 0.67\%$   
标准差= $8.2\%$ 注意到，股票基金的预期收益率和风险均高于债券基金。  
然后我们来看股票基金和债券基金各占百分之五十的投资组合如何平衡风险和收益。  
投资组合的预期收益率和方差也可根据以上方法算出，先算出投资组合在三种经济状态下的预期收益率，如下：萧条： $50\% * (-7\%) + 50\% * 17\% = 5\%$

正常： $50\% \times (12\%) + 50\% \times 7\% = 9.5\%$  繁荣： $50\% \times (28\%) + 50\% \times (-3\%) = 12.5\%$  则该投资组合的预期收益率为： $1/3 \times 5\% + 1/3 \times 9.5\% + 1/3 \times 12.5\% = 9\%$  该投资组合的方差为： $1/3[(5\% - 9\%)^2 + (9.5\% - 9\%)^2 + (12.5\% - 9\%)^2] = 0.001\%$  该投资组合的标准差为： $3.08\%$

注意到，其中由于分散投资带来的风险的降低。

一个权重平均的组合（股票和债券各占百分之五十）的风险比单独的股票或债券的风险都要低。

投资组合的风险主要是由资产之间的相互关系的协方差决定的，这是投资组合能够降低风险的主要原因。

相关系数决定了两种资产的关系。

相关性越低，越有可能降低风险。

### 三、如何看股指期货和现货之间的期现差

期货对比现货升水：投资者看好后市 期货对比现货贴水：投资者看空后市

### 四、您好请问股票 值怎样统计。还有听说国泰君安软件可以查到，您知道吗，谢谢。

值源于资本资产定价模型(CAPM)，它代表着特定资本市场上任意资产的风险与收益的均衡关系，其在数值上等于投资组合收益率相对于市场收益率的协方差与市场收益率方差的比值。

国君软件不知道，不过你可以在下面网站找到 值\*：[//share.jrj\\*.cn/cominfo/AllStock.asp](http://share.jrj*.cn/cominfo/AllStock.asp)这个网址.有所有的股票信息.包括BETA系数，只要点击你要查询的股票即可。

### 五、股票中的均线怎么看？

均线八大法则 1、均线从下降逐渐走平且略向上方抬头，而价格从均线下方向上方突破，为买进信号。

2、价格位于均线之上运行，回档时未跌破均线后又再度上升时为买进时机。

3、价格位于均线之上运行，回档时跌破均线，但短期均线继续呈上升趋势，此时为买进时机。

4、价格位于均线以下运行，突然暴跌，距离均线太远，极有可能向均线靠近(物极

必反，下跌反弹)，此时为买进时机。

5、价格位于均线之上运行，连续数日大涨，离均线愈来愈远，说明近期内购买者获利丰厚，随时都会产生获利回吐的卖压，应暂时卖出。

6、均线从上升逐渐走平，而价格从均线上方向下跌破均线时说明卖压渐重，应卖出所持。

7、价格位于均线下方运行，反弹时未突破均线，且均线跌势减缓，趋于水平后又出现下跌趋势，此时为卖出时机。

## 六、在股票市场在哪里看一只股票的量 怎么看

你一进去看到的是股指或股票的当前走势下面是成交量F5切换可以看到日K线下面就是每天的成交量了

### 参考文档

[下载：股票的方差如何看到.pdf](#)

[《总股本和目前流通相等有什么利弊》](#)

[《有什么关于基金股票的书》](#)

[《大陆如何炒港股》](#)

[《买港股条件》](#)

[下载：股票的方差如何看到.doc](#)

[更多关于《股票的方差如何看到》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/35693199.html>