

股票的标准差是多少-炒股“标准误差”怎么算？-股识吧

一、股票预期收益率及标准差 标准离差计算

$r(B) = 12\% \times 0.4 + 4\% \times 0.4 + (-6\% \times 20\%) = 5.2\%$
方差(B) = $(12\% - 5.2\%)^2 \times 0.4 + (4\% - 5.2\%)^2 \times 0.4 + (-6\% - 5.2\%)^2 \times 0.2$
标准差(B) = 方差(B)的开方
 $r(A) = \text{四数和}/4 = 6.5\%$
A的方差不会，感觉少个相关系数， $\beta = 12\%/20\% = 0.6$ 通过capm可以计算市场组合的收益率，没有相关系数，不能计算a的方差标准离差率是标准离差与期望值之比。

其计算公式为：标准离差率 = 标准离差/期望值
简单说就是一单位收益需要承担的风险，风险越小越好！
市场组合白话说假如市场上有100只股票，我构建一个市场组合包括所有的股票，也就是100只，比例按它们的市值当权数加权！

二、求指教股票的 系数和标准差计算

简单说 系数是一种表示风险量度的参数，一般高风险对应高收益，所以在牛市或者大势看涨的时候可以选择 系数较高的股票进行投资。

贝塔系数[Beta coefficient]是一种评估证券系统性风险的工具，用以度量一种证券或一个投资证券组合相对总体市场的波动性。

在股票、(基金)等投资术语中常见。

用 系数估量风险叫 测量法，它来源于统计上的回归分析。

最早提出 值是在本世纪60年代初，大约过了10年，美国的金融管理者们才认识到它的价值。

在证券投资中，收益与风险并存，高收益意味着要承担高风险。

风险由系统风险和非系统风险构成，其中非系统风险可以通过持有数种证券构成的投资组合加以消除。

系数是测量系统风险大小的一个指标，能确切表达单一股票风险与市场股票风险间的关系。

为帮助投资人分析系统风险大小，树立科学的投资理念，发达国家的证券市场都定期在权威报刊杂志上公布每种股票的 系数，国际上著名的投资咨询公司提供的上市公司研究报告中也要列出股票的 系数。

贝塔系数衡量股票收益相对于{业绩}评价基准收益的总体波动性，是一个相对指标

。

越高，意味着股票相对于{业绩}评价基准的波动性越大。

大于1，则股票的波动性大于{业绩}评价基准的波动性。

反之亦然。

贝塔系数是统计学上的概念，是一个在 +1至-1之间的数值，它所反映的是某一投资对象相对于大盘的表现情况。

其绝对值越大，显示其收益变化幅度相对于大盘的变化幅度越大；

绝对值越小，显示其变化幅度相对于大盘越小。

如果是负值，则显示其变化的方向与大盘的变化方向相反；

大盘涨的时候它跌，大盘跌的时候它涨。

由于我们投资于投资(基金)的目的是为了取得专家理财的服务,以取得优于被动投资于大盘的表现情况，这一指标可以作为考察(基金)经理降低投资波动性风险的能力

。在计算贝塔系数时,除了(基金)的表现数据外,还需要有作为反映大盘表现的指标。

系数计算方式贝塔系数利用回归的方法计算。

贝塔系数为1即证券的价格与市场一同变动。

贝塔系数高于1即证券价格比总体市场更波动。

贝塔系数低于1[大于0]即证券价格的波动性比市场为低。

贝塔系数的计算公式 公式为：其中Cov(ra,rm)是证券 a 的收益与市场收益的协方差

三、 证券组合标准差的计算？

$0.3*0.3*0.06*0.06+0.7*0.7*0.08*0.08+2*0.3*0.7*0.06*0.08=0.098752$ 0.098752开方为0.3142
比例1的平方*标准差1的平方+比例2的平方*标准差2的平方+比例1*比例2*标准差1*标准差2*2最后开方。

没有办法输入公式真麻烦。

四、 求股票的期望收益率和标准差，方差？

$E(R)=0.1*0.3+0.05*0.7=0.065$ 方差 $[30%*(10%-0.065)^2+70%*(12%-5\%)^2=$ 标准差平方
等于方差

五、 股票A,B的标准差怎么求

不知道，可以求出收益率期望值:股票A=0.2*(40%)+0.3*(-10%)=5%, B=11%, M=11%

六、股票周标准差，年标准差如何计算

七、股票周标准差，年标准差如何计算

年标准差等于周标准差乘 $\sqrt{50}$ 。
衍生金融工具书上写的

八、股票a和股票b的期望收益率和标准差分别为多少

1、 $E=0.15*40\%+0.25*60\%=0.21$

2、 $\sigma^2=0.1^2*(40\%)^2+0.2^2*(60\%)^2+2*0.1*0.2*40\%*60%*0.5$

$\sigma^2=0.1^2*(40\%)^2+0.2^2*(60\%)^2+2*0.1*0.2*40\%*60%*(-0.5)$

3、相关系数越大，组合的标准差越大，相关系数越小，组合的标准差越小

有个公式： $\sigma^2= A^2x^2+ B^2(1-x)^2+2 A Bx(1-x) AB$

其中：x是股票A所占比重

九、炒股“标准误差”怎么算？

一加一等于0

参考文档

[下载：股票的标准差是多少.pdf](#)

[《股票能提前多久下单》](#)

[《上市公司回购股票多久卖出》](#)

[《卖完股票从证券里多久能取出来》](#)

[《股票资金冻结多久能解冻》](#)

[下载：股票的标准差是多少.doc](#)

[更多关于《股票的标准差是多少》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/book/7223244.html>