

某只股票的标准差如何计算 - - 什么是股票中的股市标准差-股识吧

一、什么是股票中的股市标准差

股票投资中的标准差，指的就是其收益率的标准差，是投资时判断风险的一个参考数据。

标准差主要是根据股票净值于一段时间内波动的情况计算而来的。

一般而言，标准差愈大，表示股票净值的涨跌越剧烈，当然其潜在风险与潜在收益程度也较大。

股票的收益率标准差”是指过去一段时期内，股票每个月的收益率相对于平均月收益率的偏差幅度的大小。

股票的每月收益波动越大，那么它的标准差也越大。

二、某只股票要求的收益率为15%，收益率的标准差为25%，与市场投资组合收益率的相关系数为0.2，市场投资组合要

答：（1）计算甲、乙股票的必要收益率：由于市场达到均衡，则期望收益率 = 必要收益率
甲股票的必要收益率 = 甲股票的期望收益率 = 12%
乙股票的必要收益率 = 乙股票的期望收益率 = 15%
（2）计算甲、乙股票的β值：根据资产定价模型
甲股票： $12\% = 4\% + \beta \times (10\% - 4\%)$ ，则 $\beta = 1.33$
乙股票： $15\% = 4\% + \beta \times (10\% - 4\%)$ ，则 $\beta = 1.83$
（3）甲、乙股票的收益率与市场组合收益率的相关系数：
根据甲股票的收益率与市场组合收益率的相关系数 = $1.33 \times 0.2 = 0.266$
乙股票的收益率与市场组合收益率的相关系数 = $1.83 \times 0.2 = 0.366$
（4）组合的β系数、组合的风险收益率和组合的必要收益率：
组合的β系数 = $60\% \times 1.33 + 40\% \times 1.83 = 1.53$
组合的风险收益率 = $1.53 \times (10\% - 4\%) = 9.18\%$
组合的必然收益率 = $4\% + 9.18\% = 13.18\%$

三、已知一只股票的月对数收益率，怎么求年标准差呢

展开全部在EXCEL中调用STDEV函数，即可求出标准差，也可画出正态分布图。

四、在股市分析中是怎么来应用标准差的

标准差，ATR，这些指标都可以。
具体思路可以进一步留言

五、如何用excel计算股票收益率的标准差

你问的是标准差，还是平均期望收益？后者的话，假设数据在A2到B5，=SUMPRODUCT(A2 : A5 , B2 : B5)

参考文档

[下载：某只股票的标准差如何计算.pdf](#)

[《认缴股票股金存多久》](#)

[《股票定增多久能有结果》](#)

[下载：某只股票的标准差如何计算.doc](#)

[更多关于《某只股票的标准差如何计算》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/33021614.html>