

## 股票年度收益率的标准差数据怎么找\_在股市分析中是怎么来应用标准差的-股识吧

一、投资学习题：股票提供的期望收益率为18%，标准差为22%。黄金提供的期望收益率为10%，标准差为30%。

1) 选择单一资产投资时，黄金由于收益率低，风险高，所以不会有人选择投资黄金。

2) 由于黄金与股票的相关系数为1（即完全正相关），黄金与股票的投资组合并不能抵消风险，所以投资组合中不会持有黄金。

上述假设并不能代表证券市场的均衡，因为股票收益率更高，风险更小。

## 二、每股利润的标准离差和每股利润的标准离差率如何计算

方差 $s^2 = [(x_1 - \bar{x})^2 + (x_2 - \bar{x})^2 + \dots + (x_n - \bar{x})^2] / n$  (x为平均数) 标准差=方差的算术平方根  
标准离差以绝对数衡量决策方案的风险，在期望值相同的情况下，标准离差越大，风险越大；

反之，标准离差越小，则风险越小。

需要注意：由于标准离差是衡量风险的绝对数指标，对于期望值不同的决策方案，该指标数没有直接可比性。

对此，必须进一步借助标准离差率的计算来说明问题。

标准离差率计算公式： $Q = s / E$

标准离差是一个相对指标，它以相对数反映决策方案的风险程度。

在期望值不同的情况下，标准离差率越大，风险越大；

反之，标准离差率越小，风险越小。

关注：对于单个方案，决策者可根据其标准离差(率)的大小，并将其同设定的可接受的此项指标最高限值对比，看前者是否低于后者，然后做出取舍；

对于多方案择优，决策者的行动准则应是选择低风险高收益的方案，即选择标准离差最低、期望收益最高的方案。

## 三、股市怎么看ROE？

1.净资产收益率ROE(Rate of Return on Common Stockholders' Equity)，净资产收益率又称股东权益报酬率/净值报酬率/权益报酬率/权益利润率/净资产利润率，是净利润与平均股东权益的百分比，是公司税后利润除以净资产得到的百分比率，该指标反映股东权益的收益水平，用以衡量公司运用自有资本的效率。

指标值越高，说明投资带来的收益越高。

该指标体现了自有资本获得净收益的能力。

2.一般来说，负债增加会导致净资产收益率的上升。

企业资产包括了两部分，一部分是股东的投资，即所有者权益(它是股东投入的股本，企业公积金和留存收益等的总和)，另一部分是企业借入和暂时占用的资金。

企业适当的运用财务杠杆可以提高资金的使用效率，借入的资金过多会增大企业的财务风险，但一般可以提高盈利，借入的资金过少会降低资金的使用效率。

净资产收益率是衡量股东资金使用效率的重要财务指标。

## 四、炒了很多年股票，突然想看看这些年的收益和亏损，请问可以查到么？

完全可以，一般账户软件会有基本的粗略显示盈亏。

## 五、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

## 六、公司理财问题，急！！！！

根据商务统计学基础知识，标准差是描述某一种证券本身收益率平均值/期望的变异程度的。

标准差本身只能是正数(因为它是某一证券收益率跟它自身收益率期望的差值的平方和)。

所以问题的答案是：这个说法不对。

标准差是用来衡量该证券在历史或者未来预测的收益率数值跟它的期望值之间的偏

离程度的(变异程度).如果想比较该证券有风险跟无风险收益率的差异性，应该使用标准差系数这个指标.看两者哪个标准差指标数值大，便能判断哪个股价变动比较大，风险也就相对比较大.一般说来，因为无风险收益率的标准差小，而有风险收益率的大，所以他们的标准差系数前者小，后者则大。这样一来，由于风险偏好的作用，投资者一般愿意挑战标准差系数大的证券品种。

## 参考文档

[下载：股票年度收益率的标准差数据怎么找.pdf](#)

[《股票卖出多久继续买进》](#)

[《股票合并后停牌多久》](#)

[《委托股票多久时间会不成功》](#)

[《场内股票赎回需要多久》](#)

[下载：股票年度收益率的标准差数据怎么找.doc](#)

[更多关于《股票年度收益率的标准差数据怎么找》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/26148479.html>