

股票收益率标准差怎么计算；的期望回报率和标准差，怎么求它们的投资组合的期-股识吧

一、股票a的标准差40%贝塔系数0.5
股票b的标准差20%贝塔系数1.5 问哪知股票的风险溢价更高？

股票b的风险溢价更高。

在一倍标准差下如果市场变化了一倍，a股变化范围是 $=40\% \times 0.5 = 20\%$ b股变化范围是 $=20\% \times 1.5 = 30\%$ 即b股本身股价变化不大，但随市场变化而变的范围很大。

如果能准确把握这市场的变化，则投资b股。

a股股价，虽然自身价格的变化比较大，但随市场变化而变的特性却小多了。是相对市场比较稳定的一个股票。

二、股票和债券的收益标准差分别为0.4和0.1,股票和债券之间的协方差为0.016,试求该组合的标准差.

这里还需要组合中股票和债券的投资比例。

这里因为楼主没有给出，所以我假设为：

三、某种股票的期望收益率为10%，其标准离差为0.04，风险价值系数为30%，则该股票的风险收益率为

标准离差率 = 标准离差/期望值 $=0.04/10\%=0.4$

风险收益率 = 风险价值系数 \times 标准离差率 = $30\% \times 0.4 = 12\%$

四、假设证券市场中有股票A和B，其收益和标准差如下表，如果两只股票的相关系数为-1。

这道题是希望通过运用两只股票构建无风险的投资组合，由一价原理，该无风险投

投资组合的收益就是无风险收益率。

何为无风险投资组合？即该投资组合收益的标准差为0，由此，设无风险投资组合中股票A的权重为 w ，则股票B的权重为 $(1-w)$ ，则有： $\{(5\%w)^2+[10\%(1-w)]^2+2*5\%*10\%(-1)(1-w)w\}^{(1/2)}=0$ 等式两边同时平方，并扩大10000倍（消除百分号），则有： $25(w^2)+100(1-w)^2-100w(1-w)=0$ 化简为： $225w^2-300w+100=0(15w-10)^2=0$ 则 $w=2/3$ 则，该投资组合的收益率为： $2\%*(2/3)+5\%*(1/3)=9\%/3=3\%$

五、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。

六、的期望回报率和标准差，怎么求它们的投资组合的期

投资组合的预期回报率就是两个股票预期回报率的加权平均，投资组合的标准差就复杂一些，还需要知道两个股票的相关系数。

比如股票a的回报率为8%，股票b回报率为12%，股票a的权重为40%，股票b的权重为60%，则投资组合预期回报率= $8\%*40\%+12\%*60\%=10.4\%$

参考文档

[下载：股票收益率标准差怎么计算.pdf](#)

[《买了8万的股票持有多久可打新》](#)

[《买股票从一万到一百万需要多久》](#)

[下载：股票收益率标准差怎么计算.doc](#)

[更多关于《股票收益率标准差怎么计算》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/store/8764261.html>