

# 股票的标准差是什么 - 股票收益率的标准差与上证指数标准差不同的原因-股识吧

## 一、股票收益率的标准差与上证指数标准差不同的原因

追踪指数都存在误差，所以其收益率的标准差不一样。

## 二、股票收益率的标准差与上证指数标准差不同的原因

追踪指数都存在误差，所以其收益率的标准差不一样。

## 三、基金里的标准差 是什么意思？

在投资基金上，一般投资人比较重视的是业绩，但是，投资人往往买进了近期业绩表现最佳的基金之后，基金表现反而不如预期，这是因为所选的基金波动幅度太大，没有稳定表现的关系。

衡量基金波动的稳定程度的工具就是标准差(Standard Deviation)。

标准差是指一类基金可能的变动程度。

标准差越大，基金未来净值可能变动的程度就越大，稳定度就越小，投资风险就越高。

比方说，一年期标准差是30%的基金，代表这类基金的净值在一年内可能上涨30%，但也可能下跌30%。

因此，如果有两只收益率相当的基金，投资人应该选择标准差较小的基金(承受较小的风险得到相同的收益)，如果有两只相同标准差的基金，则应该选择收益较高的基金(承受相同的风险，得到更高的收益)，在实务上，则建议投资人同时将收益将风险计入来判断选择基金。

举例来说，A基金二年期的收益率为36%，标准差为18%；

B基金的二年期收益率为24%，标准差为8%，从数据上来看，A基金的收益高于B基金，但同时风险也大于B基金，但是，A基金的“每单位风险收益率”为 $2(0.36/0.18)$ ，而B基金为 $3(0.24/0.08)$ 。

因此，原本单仅以收益来看是A基金胜出，但是经过风险因素(标准差)的调整之后

，B基金的表现反而更为优异。

另外，标准差也是投资可以用来判断基金属性的工具，依据晨星的统计，今年以来，股票型基金的平均标准差为5.14，积极配置型基金的平均标准差为5.04；

保守配置型基金的平均标准差为4.86；

普通债券基金，平均标准差为2.91；

货币市场基金平均标准差则为0.19；

由此可见，越是积极型的基金，标准差越大；

而如果投资人持有的基金标准差高于平均值，则代表投资人承担了较高的风险。

## 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、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 $=40\%*0.5=20\%$ b股变化范围是 $=20\%*1.5=30\%$ 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。

## 六、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。

**七、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：

## 参考文档

[下载：股票的标准差是什么.pdf](#)

[《今天买的股票多久才能卖》](#)

[《股票除权除息日多久》](#)

[《股票抛股要多久》](#)

[《股票转让后多久有消息》](#)

[下载：股票的标准差是什么.doc](#)

[更多关于《股票的标准差是什么》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/article/14699108.html>