

股票年标准差怎么计算——股票收益的期望和标准差计算。 -股识吧

一、急急急！！求大神计算，求两只股票的标准差。

布林带由布林格 (Bollinger)

发明，也叫布林通道，是各种投资市场广泛运用的路径分析指标。

一般价格的波动是在一定的区间内的，区间的宽度代表价格的变动幅度，越宽表示价格变动幅度越大，越窄表示价格变动幅度越小。

布林带由支撑线(LOWER)、阻力线(UPER) 和中线(MID)

三者组成，当价格突破阻力线（或支撑线）时，表示卖出（或买入）时机。

在布林格发明布林带之前，类似的路径分析指标已经在金融市场中使用了，但后来布林格将这种方法加以改进并系统化。

布林格本人最重要的贡献可以说并不是其发明的布林带指标，而是他在使用布林带指标时着重强调的相对高低概念，并在分析时贯彻了这一思想。

虽然此前已经有一些投资者意识到高低的位置都是相对的，但很少有人笃信并认真实践这一思想。

计算公式：MID = 收盘价的 n 个周期简单移动平均值 TMP2 = 收盘价在 m

个周期内的标准差 UPER = MID + P × TMP2 LOWER = MID - P × TMP2

（注：P为变量）标准差的含义和计算公式在所有统计学教材和注册会计师的《财务管理》教材中都有论述，有兴趣的投资者可以查阅。

布林带的基本应用方法：1.一般来说，布林中轨代表着市场的主要运行趋势；

2.当市场上升强势趋势形成后，布林带的下轨出现转头向下，市场趋势可暂时结束；

3.当布林带的三条线越靠越近，通道越收越紧时常意味着市场有可能转势，行情将会产生。

但是我认为这时候要结合RSI与KDJ指标来判断方向。

当你在综合其它的指标无明显的反转信号，当价格再次走向原来的方向的时候表明市场持续。

4.辨别W底，如果价格二次探底时，没有像第一次探底时冲破下轨，那么即使绝对数创新高，也可认为是探底成功。

5.头肩顶的情况，左肩上攻时力量最强，价格往往超出布林线之外，头部上攻，价格创新高，并能达上轨，但很少超过上轨。

右肩上攻通常无力触及上轨线。

6.价格处于上升趋势中时，布林线的特点是价格不断地触及上轨线，同时还常常向上突破越过上轨线。

下降趋势同理。

- 7.当市场进行横向整理状态时，布林带常会收紧，均线也趋向平缓。
当布林通道越收越小的时候，一定要结合其它的指标综合判断，并且要及时关注消息面的情况。
消息面很多时候会是市场的一个催化剂。
- 8.布林通道放大结束后要么是盘整，要么是反转。
而持续前期趋势的情况相对较少。
- 9.日线图上，如果价格逐步向上到布林线的上轨并持续运行在中轨之上，分析指标也走强，则很可能涨势形成。
反之跌势也同理；
- 10.在分析顶形态与底部形态的时候，顶部形态相对复杂，因此分析时相对要有耐心；
- 11.最好在运用的时候结合MACD等指标使用，这样不至于因分析太过单一而出现太多的失误；12价格不断的触及上轨且摆动指标为正为买入信号，价格不断触及下轨且摆动指标为负一般为卖出信号。

二、什么是布林带？

布林带由布林格 (Bollinger)

发明，也叫布林通道，是各种投资市场广泛运用的路径分析指标。

一般价格的波动是在一定的区间内的，区间的宽度代表价格的变动幅度，越宽表示价格变动幅度越大，越窄表示价格变动幅度越小。

布林带由支撑线(LOWER)、阻力线(UPER) 和中线(MID)

三者组成，当价格突破阻力线（或支撑线）时，表示卖出（或买入）时机。

在布林格发明布林带之前，类似的路径分析指标已经在金融市场中使用了，但后来布林格将这种方法加以改进并系统化。

布林格本人最重要的贡献可以说并不是其发明的布林带指标，而是他在使用布林带指标时着重强调的相对高低概念，并在分析时贯彻了这一思想。

虽然此前已经有一些投资者意识到高低的位置都是相对的，但很少有人笃信并认真实践这一思想。

计算公式： $MID = \text{收盘价的 } n \text{ 个周期简单移动平均值}$ $TMP2 = \text{收盘价在 } m \text{ 个周期内的标准差}$ $UPER = MID + P \times TMP2$ $LOWER = MID - P \times TMP2$

（注：P为变量）标准差的含义和计算公式在所有统计学教材和注册会计师的《财务管理》教材中都有论述，有兴趣的投资者可以查阅。

布林带的基本应用方法：1.一般来说，布林中轨代表着市场的主要运行趋势；

2.当市场上升强势趋势形成后，布林带的下轨出现转头向下，市场趋势可暂时结束；

- 3.当布林带的三条线越靠越近，通道越收越紧时常意味着市场有可能转势，行情将会产生。
但是我认为这时候要结合RSI与KDJ指标来判断方向。
当你在综合其它的指标无明显的反转信号，当价格再次走向原来的方向的时候表明市场持续。
- 4.辨别W底，如果价格二次探底时，没有像第一次探底时冲破下轨，那么即使绝对数创新高，也可认为是探底成功。
- 5.头肩顶的情况，左肩上攻时力量最强，价格往往超出布林线之外，头部上攻，价格创新高，并能达上轨，但很少超过上轨。
右肩上攻通常无力触及上轨线。
- 6.价格处于上升趋势中时，布林线的特点是价格不断地触及上轨线，同时还常常向上突破越过上轨线。
下降趋势同理。
- 7.当市场进行横向整理状态时，布林带常会收紧，均线也趋向平缓。
当布林通道越收越小的时候，一定要结合其它的指标综合判断，并且要及时关注消息面的情况。
消息面很多时候会是市场的一个催化剂。
- 8.布林通道放大结束后要么是盘整，要么是反转。
而持续前期趋势的情况相对较少。
- 9.日线图上，如果价格逐步向上到布林线的上轨并持续运行在中轨之上，分析指标也走强，则很可能涨势形成。
反之跌势也同理；
- 10.在分析顶形态与底部形态的时候，顶部形态相对复杂，因此分析时相对要有耐心；
- 11.最好在运用的时候结合MACD等指标使用，这样不至于因分析太过单一而出现太多的失误；12价格不断的触及上轨且摆动指标为正为买入信号，价格不断触及下轨且摆动指标为负一般为卖出信号。

三、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。

四、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cap m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！

五、股票日波动率的标准差怎么算？急！急！急！！！！

具体看你用什么方式来算，我接触到用garch的多。此外，那个不是乘以根号52，是乘以根号一年的交易日数。

参考文档

[下载：股票年标准差怎么计算.pdf](#)

[《股票要多久才能学会》](#)

[《股票多久能买完》](#)

[《股票转账多久到账》](#)

[《股票账户多久不用会失效》](#)

[下载：股票年标准差怎么计算.doc](#)

[更多关于《股票年标准差怎么计算》的文档...](#)

??

<https://www.gupiaozhishiba.com/article/9025905.html>