

股票型基金的标准差是多少：基金的几个风险指标从哪看啊?标准差， 系数什么的-股识吧

一、如何计算基金组合中的标准差?标准差的大小代表什么意思?

你可以看看这里，有很详细的解释：[*：//cn.morningstar*/FundTools/learnersarticles/View.aspx?level=203&order=1](http://cn.morningstar.com/FundTools/learnersarticles/View.aspx?level=203&order=1)；

二、股票收益率的标准差怎么计算

先计算股票的平均收益率 x_0 ，然后将股票的各个收益率与平均收益率相减平方如 $(x_1-x_0)^2$ ，然后把所有的这些相减平方加起来后，开平方根得到股票收益率的标准差。

三、基金的几个风险指标从哪看啊?标准差， 系数什么的

反映投资组合市场风险的指标有基于收益率及方差的风险指标，如波动率、回撤、下行风险标准差等，也有基于投资价值对风险因子敏感程度的指标，如 系数、久期、凸性等。

系数是评估证券或投资组合系统性风险的指标，反映的是投资对象对市场变化的敏感度。

系数是一个统计指标，采用回归方法计算。

计算公式：
$$\rho = \text{Cov}(r_p, r_m) / \text{市场收益的方差}$$

四、基金的平均收益率和标准差相同，表示什么

展开全部标准差衡量的是期望收益率与实际收益率的偏差；

平均收益率衡量的是某段时间内收益率的平均。

两者相同一般是巧合所致不能说明什么。

当然，楼主也可以这么理解，就是收益与风险相匹配。如果收益率和标准差都比较大，那么可以理解为较高的收益必须承担较高的风险；如果都比较小，那么可以理解为较低的收益承担较低的风险。

五、股票基金规定不低于多少的基金资产投资于股票市场

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。

参考文档

[下载：股票型基金的标准差是多少.pdf](#)

[《股票有融字的可以申购什么新股》](#)

[《怎么知道我公司要交印花税》](#)

[《中小企业板和创业板有什么区别》](#)

[下载：股票型基金的标准差是多少.doc](#)

[更多关于《股票型基金的标准差是多少》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/book/43463748.html>