

股票价格年化标准差怎么算：股票中收益率标准差如何计算-股识吧

一、如何计算股票历史波动率 详细 0 3

财富创业板技巧：下面以计算股票的历史波动率为例加以说明。

- 1、从市场上获得标的股票在固定时间间隔(如每天、每周或每月等)上的价格。
- 2、对于每个时间段，求出该时间段末的股价与该时段初的股价之比的自然对数。
- 3、求出这些对数值的标准差，再乘以一年中包含的时段数量的平方根(如，选取时间间隔为每天，则若扣除闭市，每年中有 250 个交易日，应乘以根号250)，得到的即为历史波动率。

历史波动率是基于过去的统计分析得出的，假定未来是过去的延伸，利用历史方法估计波动率类似于估计标的资产收益系列的标准差。

在股票市场中，历史波动率反映标的股价过去的波动。

然而，由于股价波动难以预测，利用历史波动率对权证价格进行预测一般都不能保证准确，但是由于目前我国内地没有权证市场，因而无法获得权证价格，也就无法计算隐含波动率。

因此权证发行商不投资者在权证发行初期只能利用历史波动率作参考。

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、股票中收益率标准差如何计算

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。

四、股票预期收益率及标准差 标准离差计算

$$r(B) = 12\% \times 0.4 + 4\% \times 0.4 + (-6\% \times 20\%) = 5.2\%$$

$$\text{方差}(B) = (12\% - 5.2\%)^2 \times 0.4 + (4\% - 5.2\%)^2 \times 0.4 + (-6\% - 5.2\%)^2 \times 0.2$$

$$\text{标准差}(B) = \sqrt{\text{方差}(B)} \quad r(A) = \text{四数和}/4 = 6.5\%$$

A的方差不会，感觉少个相关系数， $\beta = 12\%/20\% = 0.6$

通过capm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、急急急！！求大神计算，求两只股票的标准差。

单个股票收益率的方差 = $\beta^2 \times \text{市场收益率的方差} + \text{股票特定风险的方差}$
A股票的标准差 = $[(0.8^2) \times (20\%^2) + 30\%^2]^{(1/2)} = 0.34$
B股票的标准差 = $[(1.2^2) \times (20\%^2) + 20\%^2]^{(1/2)} = 0.3124$

参考文档

[下载：股票价格年化标准差怎么算.pdf](#)

[《买股票买多久可以赎回》](#)

[《股票卖的钱多久到》](#)

[《股票成交量多久一次》](#)

[《农民买的股票多久可以转出》](#)

[下载：股票价格年化标准差怎么算.doc](#)

[更多关于《股票价格年化标准差怎么算》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/chapter/27305131.html>