

股票收益率标准差什么意思，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？-股识吧

一、证券A、B、C的预期投资收益率分别为：12%、19%和12%；标准差分别为：0.0583、0.3239和0.1208。选择哪种证

你说呢...

二、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。

三、股票收益的期望和标准差计算。

听了我这段做股票的心得，你一定有很大的收获。

我觉得做股票吧，首先，心态要好，创造财富也得有好心情。

中国的股市，波段操作的赢利范围和可行性最大，另外，选取的个股，也必须跟随主力的动向，这样就不会让自己的资金冒险。

为了把握最理想的买卖点，必须有主力的带动和证券技术部门的老师指引去操作，这样才能达到在股市中长期的稳定赢利。

下面我给大家推荐一位在股市中比较资深的操盘老师，主要的实战操作，才能让我们信服，这位老师的操作平台资料就在我的空间里，相信自己的眼光，关注一段时间后，你会发现，做股票，这才叫实力！

四、证券A、B、C的预期投资收益率分别为：12%、19%和12%；标准差分别为：0.0583、0.3239和0.1208。选择哪种证

五、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！

参考文档

[下载：股票收益率标准差什么意思.pdf](#)

[《股票卖的钱多久到》](#)

[《股票转账多久到账》](#)

[下载：股票收益率标准差什么意思.doc](#)

[更多关于《股票收益率标准差什么意思》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/42443173.html>