

# 金融工程股票价格的标准差怎么算 - - 每股利润的标准离差和每股利润的标准离差率如何计算-股识吧

## 一、金融工程中有关互换利差的计算

X公司的固定利率为8.0%，浮动利率为LIBOR；

Y公司的固定利率为8.8%，浮动利率为LIBOR。

说明Y公司投资固定利率有优势，X公司投资固定利率款为8.8%，说明其资信程度比Y公司低，但它能够获得与Y公司同样利率的浮动利率投资，说明其投资浮动利率款有优势。设计：X公司希望以固定利率进行投资，而Y公司希望以浮动利率进行投资，如果按照其各自所需要投资，总收益为LIBOR+8.0%，通过银行中介进行利率互换，即：X公司以浮动利率进行投资，收益LIBOR，Y公司以固定利率进行投资，收益8.8%，总收益达到LIBOR+8.8%，比不互换增加0.8%的投资收益，三者瓜分，银行得0.2%，X公司得0.2%，Y公司得0.4%(因为整个利益主要是Y公司信誉高而获得)。结果：X公司希望以固定利率进行投资，取得固定利率投资收益8.2%；

Y公司希望以浮动利率进行投资，取得浮动利率投资收益LIBOR+0.4%银行作为中介获得0.2%收益，承担投资信用风险。

## 二、每股利润的标准离差和每股利润的标准离差率如何计算

方差 $s^2 = [(x_1 - \bar{x})^2 + (x_2 - \bar{x})^2 + \dots + (x_n - \bar{x})^2] / n$  (x为平均数) 标准差=方差的算术平方根  
标准离差以绝对数衡量决策方案的风险，在期望值相同的情况下，标准离差越大，风险越大；

反之，标准离差越小，则风险越小。

需要注意：由于标准离差是衡量风险的绝对数指标，对于期望值不同的决策方案，该指标数没有直接可比性。

对此，必须进一步借助标准离差率的计算来说明问题。

标准离差率计算公式： $Q = s / E$

标准离差是一个相对指标，它以相对数反映决策方案的风险程度。

在期望值不同的情况下，标准离差率越大，风险越大；

反之，标准离差率越小，风险越小。

关注：对于单个方案，决策者可根据其标准离差(率)的大小，并将其同设定的可接受的此项指标最高限值对比，看前者是否低于后者，然后做出取舍；

对于多方案择优，决策者的行动准则应是选择低风险高收益的方案，即选择标准离

差最低、期望收益最高的方案。

三、

## 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、炒股“标准误差”怎么算？

一加一等于0

## 六、投资风险与股市风险系数（系数），标准差和期望值的关系

标准差和 是衡量证券风险的两个指标，侧重不同。

标准差强调的是证券自身的波动，波动越大，标准差越大，是绝对的波动的概念；证券A的标准差比证券B小，我们说，证券A的整体波动风险比较小，证券B的整体波动风险比较大。

标准差中，既包含了市场风险，又包含了该证券的特异风险，specificrisk。

相反，强调的是相对于整个市场（M），这个证券的波动大小，是以整个市场为参照物的。

当市场波动1个百分点时，证券A波动1.25个百分点，所以我们说，证券A的市场风险较大；

证券B相对市场，则波动0.95个百分点，我们说，证券B的市场风险较小。

扩展资料：防范对策防范并化解财务风险。

以实现财务管理目标，是企业财务管理的工作重点。

&nbsp; ;

(1)认真分析财务管理的宏观环境及其变化情况，提高适应能力和应变能力。

为防范财务风险，企业应对不断变化的财务管理宏观环境进行认真分析研究，把握其变化趋势及规律，并制定多种应变措施，适时调整财务管理政策和改变管理方法。

。

(2)不断提高财务管理人员的风险意识。

必须将风险防范贯穿于财务管理工作的始终。

(3)提高财务决策的科学化水平。

防止因决策失误而产生的财务风险。

在决策过程中。

应充分考虑影响决策的各种因素，尽量采用定量计算及分析方法并运用科学的决策模型进行决策。

对各种可行方案要认真进行分析评价。

从中选择最优的决策方案，切忌主观臆断。

(4)理顺企业内部财务关系，做到责、权、利相统一。

要明确各部门在企业财务管理中的地位、作用及应承担的职责，并赋予其相应的权力，真正做到权责分明，各负其责。

参考资料来源：股票百科-投资风险

## 参考文档

[下载：金融工程股票价格的标准差怎么算.pdf](#)

[《股票被炒过要多久才能再炒》](#)

[《股票腰斩后多久回本》](#)

[《卖完股票从证券里多久能取出来》](#)

[《上市公司离职多久可以卖股票》](#)

[下载：金融工程股票价格的标准差怎么算.doc](#)

[更多关于《金融工程股票价格的标准差怎么算》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/store/36402655.html>