

**股票日收益率方差多少合适！投资学习题：股票提供的期望收益率为18%，标准差为22%。黄金提供的期望收益率为10%，标准差为30%。-股识吧**

**一、市场指数收益的方差为225%，一项 值为1.2的资产，其收益的方差是400%，那么，资产的非系统性风险占总风险**

你问的是相关系数么？ $\rho = \frac{\text{市场指数收益与该资产收益协方差}}{\text{资产收益方差}} = r \cdot \frac{\text{市场指数标准差} \cdot \text{资产收益标准差}}{\text{市场指数方差}} = r \cdot \frac{\text{资产收益标准差}}{\text{市场指数标准差}} = r \cdot 2/1.5$ 求得相关系数 $r=0.9$ ，风险分散效应较弱。

**二、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...

**三、股票换手率多少好**

任何投资者都希望投资获得最大的回报，但是较大的回报伴随着较大的风险。

为了分散风险或减少风险，投资者投资资产组合。

资产组合是使用不同的证券和其他资产构成的资产集合，目的是在适当的风险水平下通过多样化获得最大的预期回报，或者获得一定的预期回报使用风险最小。

作为风险测度的方差是回报相对于它的预期回报的离散程度。

资产组合的方差不仅和其组成证券的方差有关，同时还有组成证券之间的相关程度有关。

为了说明这一点，必须假定投资收益服从联合正态分布（即资产组合内的所有资产都服从独立正态分布，它们间的协方差服从正态概率定律），投资者可以通过选择最佳的均值和方差组合实现期望效用最大化。

如果投资收益服从正态分布，则均值和方差与收益和风险一一对应。

如本题所示，两个资产的预期收益率和风险根据前面所述均值和方差的公式可以计

算如下：1。

股票基金 预期收益率=1/3\*(-7%)+1/3\*12%+1/3\*28%=11%

方差=1/3[(-7%-11%)^2+(12%-11%)^2+(28%-11%)^2]=2.05%

标准差=14.3%(标准差为方差的开根，标准差的平方是方差)2。

债券基金 预期收益率=1/3\*(17%)+1/3\*7%+1/3\*(-3%)=7%

方差=1/3[(17%-7%)^2+(7%-7%)^2+(-3%-7%)^2]=0.67%

标准差=8.2%注意到，股票基金的预期收益率和风险均高于债券基金。

然后我们来看股票基金和债券基金各占百分之五十的投资组合如何平衡风险和收益

。投资组合的预期收益率和方差也可根据以上方法算出，先算出投资组合在三种经济状态下的预期收益率，如下：萧条：50%\*(-7%)+50%\*17%=5%

正常：50%\*(12%)+50%\*7%=9.5% 繁荣：50%\*(28%)+50%\*(-3%)=12.5%则该投资组合的预期收益率为：1/3\*5%+1/3\*9.5%+1/3\*12.5%=9%该投资组合的方差为：1/3[(5%-9%)^2+(9.5%-9%)^2+(12.5%-9%)^2]=0.001%该投资组合的标准差为：3.08%

注意到，其中由于分散投资带来的风险的降低。

一个权重平均的组合（股票和债券各占百分之五十）的风险比单独的股票或债券的风险都要低。

投资组合的风险主要是由资产之间的相互关系的协方差决定的，这是投资组合能够降低风险的主要原因。

相关系数决定了两种资产的关系。

相关性越低，越有可能降低风险。

## 四、投资收益率多少合适

展开全部首先高于资本成本（贷款利息就是其中之一）是必须的。

不同的行业也是不同的，首先高科技行业较高，可能是100%，200%甚至更高。

不过我们也要看到，他们在科研上的风险。

如果说大众点的话，20%吧！这是一个比较合适的值！

如果一般性企业能够达到20%的话，就可以说不错了。

不过还是那句话，风险越高，所要求的回报自然也高！

## 五、投资收益率一般多少是比较合适的

你好，当前银行中低风险评级的理财，年化收益率通常在4.5%附近，私人银行客户

级别的产品一般也不高于4.9%。

## 六、某一个股票与股票市场组合的方差是什么意思

任何投资者都希望投资获得最大的回报，但是较大的回报伴随着较大的风险。

为了分散风险或减少风险，投资者投资资产组合。

资产组合是使用不同的证券和其他资产构成的资产集合，目的是在适当的风险水平下通过多样化获得最大的预期回报，或者获得一定的预期回报使用风险最小。

作为风险测度的方差是回报相对于它的预期回报的离散程度。

资产组合的方差不仅和其组成证券的方差有关，同时还有组成证券之间的相关程度有关。

为了说明这一点，必须假定投资收益服从联合正态分布（即资产组合内的所有资产都服从独立正态分布，它们间的协方差服从正态概率定律），投资者可以通过选择最佳的均值和方差组合实现期望效用最大化。

如果投资收益服从正态分布，则均值和方差与收益和风险一一对应。

如本题所示，两个资产的预期收益率和风险根据前面所述均值和方差的公式可以计算如下：1。

股票基金 预期收益率= $1/3*(-7\%)+1/3*12\%+1/3*28\%=11\%$

方差= $1/3[(-7\%-11\%)^2+(12\%-11\%)^2+(28\%-11\%)^2]=2.05\%$

标准差=14.3%(标准差为方差的开根，标准差的平方是方差)2。

债券基金 预期收益率= $1/3*(17\%)+1/3*7\%+1/3*(-3\%)=7\%$

方差= $1/3[(17\%-7\%)^2+(7\%-7\%)^2+(-3\%-7\%)^2]=0.67\%$

标准差=8.2%注意到，股票基金的预期收益率和风险均高于债券基金。

然后我们来看股票基金和债券基金各占百分之五十的投资组合如何平衡风险和收益

。

投资组合的预期收益率和方差也可根据以上方法算出，先算出投资组合在三种经济状态下的预期收益率，如下：萧条： $50%*(-7\%)+50%*17\%=5\%$

正常： $50%*(12\%)+50%*7\%=9.5\%$  繁荣： $50%*(28\%)+50%*(-3\%)=12.5\%$ 则该投资组合

的预期收益率为： $1/3*5\%+1/3*9.5\%+1/3*12.5\%=9\%$ 该投资组合的方差为： $1/3[(5\%-9\%)^2+(9.5\%-9\%)^2+(12.5\%-9\%)^2]=0.001\%$ 该投资组合的标准差为：3.08%

注意到，其中由于分散投资带来的风险的降低。

一个权重平均的组合（股票和债券各占百分之五十）的风险比单独的股票或债券的风险都要低。

投资组合的风险主要是由资产之间的相互关系的协方差决定的，这是投资组合能够降低风险的主要原因。

相关系数决定了两种资产的关系。

相关性越低，越有可能降低风险。

**七、投资学习题：股票提供的期望收益率为18%，标准差为22%。黄金提供的期望收益率为10%，标准差为30%。**

- 1) 选择单一资产投资时，黄金由于收益率低，风险高，所以不会有人选择投资黄金。
- 2) 由于黄金与股票的相关系数为1（即完全正相关），黄金与股票的投资组合并不能抵消风险，所以投资组合中不会持有黄金。  
上述假设并不能代表证券市场的均衡，因为股票收益率更高，风险更小。

## 参考文档

[下载：股票日收益率方差多少合适.pdf](#)

[《股票买进需要多久》](#)

[《股票违规停牌一般多久》](#)

[《股票亏钱多久能结束》](#)

[《股票多久能买能卖》](#)

[下载：股票日收益率方差多少合适.doc](#)

[更多关于《股票日收益率方差多少合适》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/38822769.html>