

# 如何得到股票的日回报的标准差\_\_股票日波动率的标准差怎么算？急！急！急！！！！-股识吧

## 一、股票收益率的标准差怎么计算

具体我也不太清楚，所以帮你搜了一下，转发给你看，希望能帮到你！例子:上面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...具体我也不太清楚，所以帮你搜了一下，转发给你看，希望能帮到你！例子:上面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。

## 二、如何用excel计算股票收益率的标准差

你问的是标准差，还是平均期望收益？后者的话，假设数据在A2到B5，=SUMPRODUCT(A2:A5,B2:B5)

## 三、股票收益率的方差怎么求、相关系数怎么出来的。

(1) A股票收益率的期望值 =  $(4\% - 2\% + 5\% + 6\% - 3\%) / 5 = 2\%$  A股票收益率的标准差 = 4.18%  
B股票收益率的期望值 =  $10\% \times 0.3 + 20\% \times 0.3 - 8\% \times 0.4 = 5.8\%$   
B股票收益率的标准差 = 11.91%  
(2) A、B股票的协方差 = A、B股票的相关系数  $\times$  A股票收益率的标准差  $\times$  B股票收益率的标准差 =  $0.8 \times 4.18\% \times 11.91\% = 0.40\%$   
(3) 投资组合的方差 =  $0.3 \times 0.3 \times 4.18\% \times 4.18\% + 2 \times 0.3 \times 0.7 \times 0.40\% + 0.7 \times 0.7 \times 11.91\% \times 11.91\% = 0.88\%$   
(4) 投资组合的贝他系数 =  $0.5 \times 9.38\% / 15\% = 0.31$  假设B股票的贝他系数为b，则： $0.3 \times 0.4 + 0.7 \times b = 0.31$  解得： $b = 0.27$

- 1、男人和女人，决定是什么关系，通常是三秒钟的事情。  
一见钟情否，通常只要一秒钟。
- 2、一段持久的爱情，肯定是双赢的，而且是平衡的，一旦有天失衡了，就是关系破裂的时候。
- 3、一个走向成熟的女人，可以没有像样的衣服，但是不能没有像样的包包，因为它会给女人安全感。  
爱情可能背叛你，但是包包却永远不会。
- 4、选择一个男人的时候，设法了解他和母亲以及初恋的情况。  
男人的母亲和初恋女孩，这两个女人已经决定了他的爱情观。
- 5、女人总想找一个自己欣赏的，比自己更强大的男人。  
那样的男人都在塔尖上，大多数踮着脚尖都够不着，够着了可能因为争抢而摔死。
- 6、优等男早都被占坑了，你得赶紧占一个。

饰品ptisys.com/list.php?catid=1705

7、别跟有处女情结的男人耗，这样的男人，不是自大就是自卑。

## 四、股票日波动率的标准差怎么算？急！急！急！！！！

该表提供根据股票日收益数据计算的历史波动率。

分别采用20日、60日简单移动法，指数加权移动平均法和Garch模型计算日波动率。

本表使用对数收益数据。

对数收益= $\log(1+\text{百分比收益})$ 。

(来源：道富投资)

## 五、的期望回报率和标准差，怎么求它们的投资组合的期

市场组合期望收益率为：11%，标准差为：14.20% $w*0.05+(1-w)*0.11=0.1$ 所以 $w=1/6$ 标准差： $\sqrt{(1-w)^2*(14.2)^2}=11.8\%$

## 六、财务管理里面只知道股票各年的报酬率怎么求标准差

求平均值 $R_0$ ，再用各年报酬率减去平均报酬率差的平方除以总的年数就是报酬率方差，开平方就是报酬率的标准差了撒~~~

## 七、求股票的期望收益率和标准差

期望值= $15\%*40\%+10\%*60\%=12\%$ 标准差= $[40\%*(12\%-15\%)^2+60\%*(12\%-10\%)^2]^{(1/2)}=(0.4*0.0009+0.6*0.0004)^{(1/2)}=0.0006^{(1/2)}=0.0245$

## 八、股票收益率的标准差怎么计算

具体我也不太清楚，所以帮你搜了一下，转发给你看，希望能帮到你！例子:上面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...具体我也不太清楚，所以帮你搜了一下，转发给你看，希望能帮到你！例子:上面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。

## 参考文档

[下载：如何得到股票的日回报的标准差.pdf](#)

[《法院询价评估股票要多久》](#)

[《股票委托多久才买成功》](#)

[《股票合并后停牌多久》](#)

[《股票退市多久能拿到钱》](#)

[下载：如何得到股票的日回报的标准差.doc](#)

[更多关于《如何得到股票的日回报的标准差》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/4274602.html>