

一支股票的标准差怎么算——股票型基金的标准差是多少-股识吧

一、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~~~

二、股票预期收益率及标准差 标准离差计算

$r(B) = 12\% \times 0.4 + 4\% \times 0.4 + (-6\% \times 20\%) = 5.2\%$
方差(B) = $(12\% - 5.2\%)^2 \times 0.4 + (4\% - 5.2\%)^2 \times 0.4 + (-6\% - 5.2\%)^2 \times 0.2$
标准差(B) = 方差(B)的开方

$r(A) = \text{四数和} / 4 = 6.5\%$
A的方差不会，感觉少个相关系数， $\beta = 12\% / 20\% = 0.6$ 通过cap m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！

三、每股利润的标准离差 和每股利润的标准离差率如何计算

股票的标准差，指的就是其收益率的标准差

股票的标准差主要是根据基金净值于一段时间内波动的情况计算而来的。

一般而言，标准差愈大，表示净值的涨跌较剧烈，风险程度也较大。

股票的收益率标准差”是指过去一段时期内，基金每个月的收益率相对于平均月收益率的偏差幅度的大小。

基金的每月收益波动越大，那么它的标准差也越大。

四、股票型基金的标准差是多少

股票型基金的标准差是指一类基金可能的变动程度。

标准差越大，基金未来净值可能变动的程度就越大，稳定度就越小，投资风险就越高。

在投资基金上，一般投资人比较重视的是业绩，但是，投资人往往买进了近期业绩表现最佳的基金之后，基金表现反而不如预期，这是因为所选的基金波动幅度太大，没有稳定表现的关系。

衡量基金波动的稳定程度的工具就是标准差(Standard Deviation)。

五、如果一只股票的年连续复利收益率的标准差是45%，那么公司持有该股票1个月的收益的标准差是

收益率的标准差，衡量的是实际收益率围绕预期收益率（即平均收益率）分布的离散度，反映的是投资的风险。

收益率的标准差，是先求收益率离差平方和的平均数，再开平方得来。

计算过程是将实际收益率减去预期收益率，得到收益率的离差；

再将各个离差平方，并乘上该实际收益率对应的概率后进行加总，得到收益率的方差，将方差开平方就得到标准差。

参考文档

[下载：一支股票的标准差怎么算.pdf](#)

[《股票一般翻红多久》](#)

[《st股票最长停牌多久》](#)

[《股票买入委托通知要多久》](#)

[《大股东股票锁仓期是多久》](#)

[下载：一支股票的标准差怎么算.doc](#)

[更多关于《一支股票的标准差怎么算》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/subject/21620921.html>

