

股票收益率标准差是多少|股票的预期收益率和方差怎么算-股识吧

一、股票收益率的标准差与上证指数标准差不同的原因

追踪指数都存在误差，所以其收益率的标准差不一样。

二、股票的标准差与股票收益率标准差的关系

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。

三、某只股票要求的收益率为15%，收益率的标准差为25%，与市场投资组合收益率的相关系数为0.2，市场投资组合要

答：（1）计算甲、乙股票的必要收益率：由于市场达到均衡，则期望收益率 = 必要收益率
甲股票的必要收益率 = 甲股票的期望收益率 = 12%
乙股票的必要收益率 = 乙股票的期望收益率 = 15%
（2）计算甲、乙股票的β值：根据资产定价模型
：甲股票： $12\% = 4\% + \beta \times (10\% - 4\%)$ ，则 $\beta = 1.33$
乙股票： $15\% = 4\% + \beta \times (10\% - 4\%)$ ，则 $\beta = 1.83$
（3）甲、乙股票的收益率与市场组合收益率的相关系数：
根据甲股票的收益率与市场组合收益率的相关系数 = $1.33 \times 0.2 = 0.266$
乙股票的收益率与市场组合收益率的相关系数 = $1.83 \times 0.2 = 0.366$
（4）组合的β系数、组合的风险收益率和组合的必要收益率：
组合的β系数 = $60\% \times 1.33 + 40\% \times 1.83 = 1.53$
组合的风险收益率 = $1.53 \times (10\% - 4\%) = 9.18\%$
组合的必然收益率 = $4\% + 9.18\% = 13.18\%$

四、股票的预期收益率和方差怎么算

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。

五、股票预期收益率及标准差 标准离差计算

$r(B) = 12\%*0.4 + 4\%*0.4 + (-6\%*20\%) = 5.2\%$

方差(B) = $(12\%-5.2\%)^2*0.4 + (4\%-5.2\%)^2*0.4 + (-6\%-5.2\%)^2*0.2$

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！

六、某只股票要求的收益率为15%，收益率的标准差为25%，与市场投资组合收益率的相关系数为0.2，市场投资组合要

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。

七、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：股票收益率标准差是多少.pdf](#)

[《诱骗投资者买卖股票判多久》](#)

[《北上资金流入股票后多久能涨》](#)

[《股票涨30%需要多久》](#)

[下载：股票收益率标准差是多少.doc](#)

[更多关于《股票收益率标准差是多少》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/38665538.html>