

股票标准差代表什么意思|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、基金的平均收益率和标准差相同，表示什么

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)。

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。

比方说，一年期标准差是30%的基金，代表这类基金的净值在一年内可能上涨30%，但也可能下跌30%。

因此，如果有两只收益率相当的基金，投资人应该选择标准差较小的基金(承受较小的风险得到相同的收益)，如果有两只相同标准差的基金，则应该选择收益较高的基金(承受相同的风险，得到更高的收益)，在实务上，则建议投资人同时将收益将风险计入来判断选择基金。

举例来说，A基金二年期的收益率为36%，标准差为18%；

B基金的二年期收益率为24%，标准差为8%，从数据上来看，A基金的收益高于B基金，但同时风险也大于B基金，但是，A基金的“每单位风险收益率”为 $2(0.36/0.18)$ ，而B基金为 $3(0.24/0.08)$ 。

因此，原本单仅以收益来看是A基金胜出，但是经过风险因素(标准差)的调整之后，B基金的表现反而更为优异。

另外，标准差也是投资可以用来判断基金属性的工具，依据晨星的统计，今年以来，股票型基金的平均标准差为5.14，积极配置型基金的平均标准差为5.04；

保守配置型基金的平均标准差为4.86；

普通债券基金，平均标准差为2.91；

货币市场基金平均标准差则为0.19；

由此可见，越是积极型的基金，标准差越大；

而如果投资人持有的基金标准差高于平均值，则代表投资人承担了较高的风险。

二、股市中的各种指标的英文缩写所包含得意思是什么

股市中的各种指标的英文缩写的含义（1）MACD指标；

MACD称为指数平滑异同移动平均线(Moving Average Convergence and Divergence)。是从双移动平均线发展而来的，由快的移动平均线减去慢的移动平均线。

（2）相对强弱指标（RSI）；

是由 Wells Wider 创制的一种通过特定时期内股价的变动情况计算市场买卖力量对比，来判断股价内部本质强弱、推测价格未来的变动方向的技术指标。

（3）涨跌比率 ADR；

涨跌比率又称回归式的腾落指数，是将一定期间内，股价上涨的股票家数与下跌的股票家数做一统计求出其比率。

（4）超买超卖线obos；

又叫超买超卖指标，和ADR、ADL一样是专门研究股票指数走势的中长期技术分析工具。

（5）腾落指数 ADL；

是以股票每天上涨或下跌之家数作为计算与观察的对象，以了解股票市人气的盛衰，探测大势内在的动量是强势还是弱势。

（6）能量潮 OBV；

是将成交量值予以数量化，制成趋势线。

（7）随机指标 KDJ；

期货和股票市场常用的技术分析工具。

（8）乖离率BIAS；

乖离率，简称Y值，是移动平均原理派生的一项技术指标。

（9）心理线PSY；

心理线是一种建立在研究投资人心理趋向基础上，将某段时间内投资者倾向买方还是卖方的心理与事实转化为数值，形成人气指标，做为买卖股票的参数。

（10）动向指标DMI；

又叫移动方向指数或趋向指数。

是属于趋势判断的技术性指标。

（11）动量指标MTM；

是一种专门研究股价波动的技术分析指标。

（12）宝塔线 TOWER；

是以白（或红）黑（或绿）的实体棒线来划分股价的涨跌，及研判其涨跌趋势的一种线路。

（13）布林线指标BOLL；

是通过计算股价的“标准差”，再求股价的“信赖区间”。

以上是股市分析常用的指标，其它的还有：成交量比率 VR、停损指标 SAR、震荡量指标 OSC等。

三、股票收益的期望和标准差计算。

听了我这段做股票的心得，你一定有很大的收获。

我觉得做股票吧，首先，心态要好，创造财富也得有好心情。

中国的股市，波段操作的赢利范围和可行性最大，另外，选取的个股，也必须跟随主力的动向，这样就不会让自己的资金冒险。

为了把握最理想的买卖点，必须有主力的带动和证券技术部门的老师指引去操作，这样才能达到在股市中长期的稳定赢利。

下面我给大家推荐一位在股市中比较资深的操盘老师，主要的实战操作，才能让我们信服，这位老师的操作平台资料就在我的空间里，相信自己的眼光，关注一段时间后，你会发现，做股票，这才叫实力！

四、标准差为0有什么意义

*：[//ahscyz.net.cn/wsfw/kxg/shengwu/web1/res/seniorbio/consult/001/0114.htm](http://*ahscyz.net.cn/wsfw/kxg/shengwu/web1/res/seniorbio/consult/001/0114.htm)标准差（standard deviation）样本内各变数变异程度的度量。

由样本计算标准差的公式为：为求和符号。

从上可知标准差是反映样本内各个变数与平均数差异大小的一个统计参数。

从S可了解样本内各变数的变异程度及样本平均数代表性的可反之亦然。

此外，在生物统计中，还用样本标准差来估计总体标准差。

在实践中通常用下式计算样本标准差S。

举例：调查某小组18名学生的身高（cm），其数据为：173，165，154，180，175，170，166，162，158，169，160，174，179，177，168，157，160，163。

经计算得 $\sum x = 3010$ ， $\sum x^2 = 504408$ ，数的次数分布作出估计，如观察数据属常态分布（正态分布），于是有：在的范围内；

变数的个数约有95.46%落在 $x \pm 2S$ 的范围内；

变数的个数约有 167.2222 ± 7.9303 （159.2919 ~ 175.1525）厘米的范围内；

约有95%的学生身高在 $167.2222 \pm 2 \times 7.9303$ （151.3616 ~ 183.0828）厘米的范围差是分析数量性状最常用的两个参数。

五、股票a的标准差40%贝塔系数0.5

股票b的标准差20%贝塔系数1.5 问哪知股票的风险溢价更高？

股票b的风险溢价更高。

在一倍标准差下如果市场变化了一倍，a股变化范围是 $=40\% \times 0.5 = 20\%$ b股变化范围是 $=20\% \times 1.5 = 30\%$ 即b股本身股价变化不大，但随市场变化而变的范围很大。如果能准确把握这市场的变化，则投资b股。a股股价，虽然自身价格的变化比较大，但随市场变化而变的特性却小多了。是相对市场比较稳定的一个股票。

六、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。

七、概率中的期望，方差，标准差都代表什么？它们之间有怎样的函数关系？

是一个平均的问题期望，意思就是这个事情的总的平均结果会是怎样通俗的讲，就是平均值，也可以说是平均水平算法是概率*取值的总和，反映的是事情达成的总的预期水平值这就是期待值希望对你有帮助 方差是标准差的平方

—— 方差和标准差。

方差和标准差是测算离散趋势最重要、最常用的指标。

方差是各变量值与其均值离差平方的平均数，它是测算数值型数据离散程度的最重要的方法。

标准差为方差的平方根，用S表示。

标准差相应的计算公式为 标准差是方差开方后的结果(即方差的算术平方根)

假设这组数据的平均值是m 方差公式 $s^2 = 1/n[(x_1 - m)^2 + (x_2 - m)^2 + \dots + (x_n - m)^2]$

假设方差是a。

则标准差就是这个方差开方 标准差与方差不同的是，标准差和变量的计算单位相同，比方差清楚，因此很多时候我们分析的时候更多的是使用标准差。

八、基金里的标准差 是什么意思？

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)。

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。

比方说，一年期标准差是30%的基金，代表这类基金的净值在一年内可能上涨30%，但也可能下跌30%。

因此，如果有两只收益率相当的基金，投资人应该选择标准差较小的基金(承受较小的风险得到相同的收益)，如果有两只相同标准差的基金，则应该选择收益较高的基金(承受相同的风险，得到更高的收益)，在实务上，则建议投资人同时将收益将风险计入来判断选择基金。

举例来说，A基金二年期的收益率为36%，标准差为18%；

B基金的二年期收益率为24%，标准差为8%，从数据上来看，A基金的收益高于B基金，但同时风险也大于B基金，但是，A基金的“每单位风险收益率”为 $2(0.36/0.18)$ ，而B基金为 $3(0.24/0.08)$ 。

因此，原本单仅以收益来看是A基金胜出，但是经过风险因素(标准差)的调整之后，B基金的表现反而更为优异。

另外，标准差也是投资可以用来判断基金属性的工具，依据晨星的统计，今年以来，股票型基金的平均标准差为5.14，积极配置型基金的平均标准差为5.04；

保守配置型基金的平均标准差为4.86；

普通债券基金，平均标准差为2.91；

货币市场基金平均标准差则为0.19；

由此可见，越是积极型的基金，标准差越大；

而如果投资人持有的基金标准差高于平均值，则代表投资人承担了较高的风险。

参考文档

[下载：股票标准差代表什么意思.pdf](#)

[《中国股市这么差为什么还有人买》](#)

[《股票价跌量增要不要抛》](#)

[下载：股票标准差代表什么意思.doc](#)

[更多关于《股票标准差代表什么意思》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/65658785.html>