

股票收益率的标准差反映了什么；股票收益的期望和标准差计算。-股识吧

一、股票预期收益率及标准差 标准离差计算

每股收益（Earning Per Share，简称EPS）

，又称每股税后利润、每股盈余，指税后利润与股本总数的比率。

它是测定股票投资价值的重要指标之一，是分析每股价值的一个基础性指标，是综合反映公司获利能力的重要指标，它是公司某一时期净收益与股份数的比率。

例子：利润100W，股数100W股 10元/股，总资产1000W

利润率 = $100/1000*100\% = 10\%$ 每股收益 = $100W/100W = 1$ 元

利润100W，股数50W股 40元/股，总资产2000W 利润率 = $100/2000*100\% = 5\%$

每股收益 = $100W/50W = 2$ 元

从上边你可以看到，每股收益太低，这只股票的绩效是不容乐观的

二、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！

三、已知某股票近三年的收益率，市场组合收益率，市场组合标准差，无风险收益率，如何求股票的期望报酬率？？

甲股票的期望收益率为 $(10\%+6\%+8\%)/3=8\%$

乙股票的期望收益率为 $(7\%+13\%+10\%)/3=10\%$

四、股票预期收益率及标准差 标准离差计算

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

$$\text{方差}(B) = (12\% - 5.2\%)^2 \times 0.4 + (4\% - 5.2\%)^2 \times 0.4 + (-6\% - 5.2\%)^2 \times 0.2$$

$$\text{标准差}(B) = \sqrt{\text{方差}(B)} \quad r(A) = \frac{\text{四数和}}{4} = 6.5\%$$

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！

五、某公司股票的报酬率（收益率）及概率分布情况如下：

概率（PI） 0.15 0.20 0.30 0.20 0.15

证券期望收益率 = 无风险收益率 + 证券特别风险溢价 其中 风险溢价 = 风险报酬系数 \times 收益标准差，计算公式变为：证券期望收益率 = 无风险收益率 + 风险报酬系数 \times 标准差 计算一下可以知道，甲公司收益标准差为4.94，乙公司的收益标准差为5.06 代入公式，可得：甲公司股票的报酬率 = $3\% + 4.94 \times 5\% = 27.7\%$ 乙公司股票的报酬率 = $3\% + 5.06 \times 8\% = 43.4\%$

参考文档

[下载：股票收益率的标准差反映了什么.pdf](#)

[《朋友叫我炒股跟他买对他有什么好处》](#)

[《天然气股份有限公司是什么行业》](#)

[《炒股和期货为什么我还在一直亏钱》](#)

[下载：股票收益率的标准差反映了什么.doc](#)

[更多关于《股票收益率的标准差反映了什么》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/69350362.html>