

股票收益率的相关系数怎么计算；股票的预期收益率和方差怎么算-股识吧

一、知道两种股票的历史收盘价怎么算两者之间的相关系数

协方差与期望值有如下关系： $Cov(X, Y) = E(XY) - E(X)E(Y)$ 。
 $D(X) = E(X^2) - [E(X)]^2$ 三个公式在了，自己根据数字算吧

二、上市公司发行股票的收益率是怎么计算的

- 1、计算公式：股票收益率=收额 当股票未出卖时，收益额即为股利。
衡量股票投资收益水平指标主要有股利收益率、持有期收益率与拆股后持有期收益率等。
- 2、利收益率，又称获利率，是指股份公司以现金形式派发的股息或红利与股票市场价格的比率。
该收益率可用于计算已得的股利收益率，也可用于预测未来可能的股利收益率。

三、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= $1/3 \times (-7\%) + 1/3 \times 12\% + 1/3 \times 28\% = 11\%$

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= $1/3 \times (17\%) + 1/3 \times 7\% + 1/3 \times (-3\%) = 7\%$

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： $50\% \times (-7\%) + 50\% \times 17\% = 5\%$

正常： $50\% \times (12\%) + 50\% \times 7\% = 9.5\%$ 繁荣： $50\% \times (28\%) + 50\% \times (-3\%) = 12.5\%$ 则该投资组

合的预期收益率为： $1/3 \times 5\% + 1/3 \times 9.5\% + 1/3 \times 12.5\% = 9\%$ 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。

四、股票，期望收益率，方差，均方差的计算公式

1、期望收益率计算公式： $HPR = (\text{期末价格} - \text{期初价格} + \text{现金股息}) / \text{期初价格}$ 例：A股票过去三年的收益率为3%、5%、4%，B股票在下一年有30%的概率收益率为10%，40%的概率收益率为5%，另30%的概率收益率为8%。

计算A、B两只股票下一年的预期收益率。

解：A股票的预期收益率 = $(3\% + 5\% + 4\%) / 3 = 4\%$ B股票的预期收益率 = $10\% \times 30\% + 5\% \times 40\% + 8\% \times 30\% = 7.4\%$ 2、在统计描述中，方差用来计算每一个变量（观察值）与总体均数之间的差异。

为避免出现离均差总和为零，离均差平方和受样本含量的影响，统计学采用平均离均差平方和来描述变量的变异程度。

扩展资料：1、协方差计算公式例： X_i 1.1 1.9 3， Y_i 5.0 10.4 14.6解： $E(X) = (1.1 + 1.9 + 3) / 3 = 2$ $E(Y) = (5.0 + 10.4 + 14.6) / 3 = 10$ $E(XY) = (1.1 \times 5.0 + 1.9 \times 10.4 + 3 \times 14.6) / 3 = 23.02$ $Cov(X, Y) = E(XY) - E(X)E(Y) = 23.02 - 2 \times 10 = 3.02$ 2、相关系数计算公式解：由上面的解题可求X、Y的相关系数为 $r(X, Y) = Cov(X, Y) / (\sigma_X \times \sigma_Y) = 3.02 / (0.77 \times 3.93) = 0.9979$ 参考资料来源：股票百科-期望收益率参考资料来源：股票百科-

协方差参考资料来源：股票百科-方差

五、股票收益率的计算公式是什么？

股票收益率=收益额/原始投资额当股票未出卖时，收益额即为股利。

衡量股票投资收益水平指标主要有股利收益率、持有期收益率与拆股后持有期收益率等。

股票收益率是反映股票收益水平的指标。

投资者购买股票或债券最关心的是能获得多少收益，衡量一项证券投资收益大小以收益率来表示。

股票持有期收益率 持有期收益率指投资者持有股票期间股息收入和买卖差价之和与股票买入价的比率。

股票还没有到期日，投资者持有股票时间短则几天、长则数年，持有期收益率是反映投资者在一定的持有期内的全部股利收入与资本利得占投资本金的比重。

持有期收益率为投资者最关心的指标，但如果要把它与债券收益率及银行利率等其他金融资产的收益率作比较，必须注意时间的可比性，即要把持有期收益率转化为年率。

扩展资料：反映股票收益率的高低，一般有三个指标： 本期股利收益率。
是以现行价格购买股票的预期收益率。

持有期收益率。

股票没有到期，投资者持有股票的时间有长有短，股票在持有期间的收益率为持有期收益率。

折股后的持有期收益率。

股份公司进行折股后，出现股份增加和股价下降的情况，因此，折股后股票的价格必须调整。

参考资料： 百科-股票收益率

六、 股价指数的收益率怎么算??

请问楼主问的是否是传统说的炒指数？如果是，基本指数的杠杆率跟外汇一样，有200，100倍的杠杆，也就是将你的收益或损失扩大200倍或者100倍。

一般会规定买入1手或者0.1手指数升跌一个基点多少钱，按你买的手数计算收益损失 如果正常指数收益，比如从今年年初开始，A股指数到目前涨了80%，如果害鼎愤刮莅钙缝水俯惊你能完全按照A股指数的成分买入股票，相对来说，现在你的收益将是跟指数相同，也就是80%。

七、 相关系数的计算公式是怎样得来的

相关系数介于区间 $[-1, 1]$ 内。

当相关系数为-1，表示完全负相关，表明两项资产的收益率变化方向和变化幅度完全相反。

当相关系数为+1时，表示完全正相关，表明两项资产的收益率变化方向和变化幅

度完全相同。
当相关系数为0时，表示不相关。

参考文档

[下载：股票收益率的相关系数怎么计算.pdf](#)

[《对股票有什么》](#)

[《603663三祥新材是什么股票》](#)

[《央视有什么节目是关于股票的》](#)

[《投资理财哪个app》](#)

[下载：股票收益率的相关系数怎么计算.doc](#)

[更多关于《股票收益率的相关系数怎么计算》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/read/22461282.html>