

## 股票方差怎么求.关于方差计算的问题-股识吧

### 一、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！

### 二、已知四个股票CDEF在投资组合中的占比,也知道了他们的协方差矩阵,怎么求出投资组合的收益率和方差？

四个股票，还有点儿麻烦，要加 $4*4=16$ 项，设权重分别为 $w_1, w_2, w_3, w_4$ 协方差矩阵的16项分别为 $m_{11}$ 到 $m_{44}$ ，则投资组合方差= $w_1*w_1*m_{11}+w_1*w_2*m_{12}+w_1*w_3*m_{13}+w_1*w_4*m_{14}+w_2*w_1*m_{21}+w_2*w_2*m_{22}+w_2*w_3*m_{23}+w_2*w_4*m_{24}+w_3*w_1*m_{31}+w_3*w_2*m_{32}+w_3*w_3*m_{33}+w_3*w_4*m_{34}+w_4*w_1*m_{41}+w_4*w_2*m_{42}+w_4*w_3*m_{43}+w_4*w_4*m_{44}$

### 三、急急急！！求大神计算，求两只股票的标准差。

单个股票收益率的方差= $\beta^2*$ 市场收益率的方差+股票特定风险的方差  
A股票的标准差= $[(0.8^2)*(20\%^2)+30\%^2]^{(1/2)}=0.34$   
B股票的标准差= $[(1.2^2)*(20\%^2)+20\%^2]^{(1/2)}=0.3124$

### 四、关于方差计算的问题

当然是日方差了，你算的30日平均值，然后用每日价格和平均价格比较，得出的是

日方差。

如果是每个月（30日）的某个股价（如没30日的股票收盘价）为基准，那才是月方差。

## 五、已知每个月股价，求月方差和年方差

这样算是不对的，应该先算出年平均收益率，然后用年平均收益计算方差，你已经知道了每月收益，年平均收益很简单就求出来了啊

## 参考文档

[下载：股票方差怎么求.pdf](#)

[《股票被炒过要多久才能再炒》](#)

[《大股东股票锁仓期是多久》](#)

[《股票流通股多久可以卖》](#)

[下载：股票方差怎么求.doc](#)

[更多关于《股票方差怎么求》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/author/12459198.html>