股票方差怎么求－－如何计算证券的估计期望方差？公式是？-股识吧

一、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)=0.34B股票的标准差=[(1.2^2)*(20%^2)+20%^2]^(1/2)=0.3124

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、财务管理里面只知道股票各年的报酬率怎么求标准差

求平均值R0，再用各年报酬率减去平均报酬率差的平方除以总的年数就是报酬率方差，开平方就是报酬率的标准差了撒~~~

四、假设市场投资组合的收益率和方差分别为12%和0.25，无风险收益率为8%，A股票收益率的方差为0.16

COV（Ka，Km）=r*σ a*σ m=0.4*（0.16^0.5）*（0.25^0.5）=0.4*0.4*0.5=0.08，COV（Ka，Km）是A股票收益与市场投资组合收益之间的协方差，r是两者的相关

系数，σa是A股票收益的标准差，σm是市场投资组合收益的标准差βa=COV（Ka，Km）/（σa）^2=0.08/0.16=0.5，A股票的贝塔系数是0.5A股票要求收益率=无风险收益率+（市场投资组合收益率-无风险收益率）*贝塔系数=8%+（12%-8%）*0.5=10%

五、如何求股票的相关系数和协方差

给概率，股票收益率，期望收益率，方差，标准差，求相关系数，协方差

六、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。

七、如何计算证券的估计期望方差？公式是？

期望的估计是0.3方差的估计是1/3[(0.5-0.3)^2+(0.3-0.3)^2+(0.1-0.3)^2]=2.67%

八、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%)方*0.4+(4%-5.2%)方*0.4+(-6%-5.2%)方*0.2标准差(B)=方差(B)的开方
r(A)=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！

参考文档

下载：股票方差怎么求.pdf
《装卸费交印花税怎么交》
《华兰生物股票成本变低是什么原因》
《创业板股票购买条件是什么》
《股票收益0.46什么意思》
《炒股不懂得怎么看图》
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/21694399.html