

股票收益的方差怎么计算.股票收益的期望和标准差计算。 -股识吧

一、市场指数收益的方差为225%，一项 值为1.2的资产，其收益的方差是400%，那么，资产的非系统性风险占总风险

你问的是相关系数么？ $\rho = \frac{\text{市场指数收益与该资产收益协方差}}{\text{资产收益方差}} = r * \frac{\text{市场指数标准差} * \text{资产收益标准差}}{\text{市场指数方差}} = r * \frac{\text{资产收益标准差}}{\text{市场指数标准差}} = r * 2 / 1.5$ 求得相关系数 $r = 0.9$ ，风险分散效应较弱。

二、股票中收益率标准差如何计算

先计算股票的平均收益率 x_0 ，然后将股票的各个收益率与平均收益率相减平方如 $(x_1 - x_0)^2$ ，然后把所有的这些相减平方加起来后，开平方根得到股票收益率的标准差。

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、股票中收益率标准差如何计算

$E(R)=0.1*0.3+0.05*0.7=0.065$ 方差 $[30%*(10%-0.065)^2+70%*(12%-5\%)^2=$ 标准差平方
等于方差

五、股票收益率的标准差怎么计算

先计算股票的平均收益率 x_0 ，然后将股票的各个收益率与平均收益率相减平方如 $(x_1-x_0)^2$ ，然后把所有的这些相减平方加起来后，开平方根得到股票收益率的标准差。

六、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 $r(X, Y)=Cov(X, Y)/(\sigma_x \sigma_y)=3.02/(0.77 \times 3.93) = 0.9$

979 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

七、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*(-7%)+1/3*12%+1/3*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*(17%)+1/3*7%+1/3*(-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%*(-7%)+50%*17%=5%

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

合的预期收益率为：1/3*5%+1/3*9.5%+1/3*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。

八、求股票的期望收益率和标准差，方差？

$E(R)=0.1*0.3+0.05*0.7=0.065$ 方差 $[30%*(10%-0.065)^2+70%*(12%-5\%)^2=$ 标准差平方
等于方差

九、股票的组合收益率，组合方差怎么求？

分散投资降低了风险（风险至少不会增加）。

组合预期收益率=0.5*0.1+0.5*0.3=0.2 两只股票收益的协方差=-0.8*0.3*0.2=-0.048

组合收益的方差= (0.5*0.2)^2+(0.5*0.3)^2+2*(-0.8)*0.5*0.5*0.3*0.2=0.0085

组合收益的标准差=0.092 组合前后发生的变化：组合收益介于二者之间；

风险明显下降。

参考文档

[下载：股票收益的方差怎么计算.pdf](#)

[《量子手机膜比水凝膜怎么样》](#)

[《股票买入价与成本价佣金怎么算的》](#)

[《股票盘感指的是什么》](#)

[《期货、股票、基金哪一种好》](#)

[下载：股票收益的方差怎么计算.doc](#)

[更多关于《股票收益的方差怎么计算》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/author/22767415.html>