股票与市场组合的方差怎么算-
如何求股票的相关系数和协方差-股识吧

一、对于包含四个资产的投资组合，方差是怎么算的。

马克维茨证券均值方差，具体的公式书上有呀，

二、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

三、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，σ a是A股票收益的标准差，σ m是市场投资组合收益的标准差β a=COV（Ka，Km）/（σ a）^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%

四、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！

五、这是一道财务管理的题：A公司股票有关数据如下：市场收益的方差＝0.04326 A公司股票与市场收

1. 不是证券市场模型，而是证券市场线(SML)模型吧：r = 4.9% + Beta * 9.4%2. A公司的beta系数=0.0635/0.04326=1.47代入上面的模型，期望收益r = 18.7%

六、股票收益的期望和标准差计算。

七、单个证券与市场组合协方差

因为协方差是双线性函数啊，双线性函数的概念在线性代数书里有，对你说的这种情况，实际是用到了：Cov（aX+bY，cZ）=acCov（X，Z）+bcCov(Y，Z)
把aX+bY推广到N项就可以了

八、请高手帮忙计算下这个投资组合的方差

投资组合的方差=资产1的方差*资产1的权重的平方+2*资产1的标准差*资产1的权重*资产2的标准差*资产2的权重*二者相关系数+资产2的方差*资产2的权重的平方=[(6%)^2*(30%)^2+2*30%*6%*70%*2%*0.12+(2%)^2*(70%)^2]=0.000324+0.00006024+0.000784=0.00116824开方后得标准差0.034180

参考文档

下载：股票与市场组合的方差怎么算.pdf
《a股股票牛市行情持续多久》
《股票买进需要多久》

《股票实盘一般持多久》
《股票大盘闭仓一次多久时间》
下载：股票与市场组合的方差怎么算.doc
更多关于《股票与市场组合的方差怎么算》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/26809937.html