

怎么计算股票方差 - 股票的组合收益率，组合方差怎么求？ - 股识吧

一、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

二、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 $1/3[(0.5-0.3)^2+(0.3-0.3)^2+(0.1-0.3)^2]=2.67\%$

三、excel算方差，用varp，不是很会做后面括号里的内容

你用的是哪个版本？我的机子提示varp (number1 , [number2] , ...) 以你截图中的数据，算浦发发行的，输入=VARP(B2 : B12)

四、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。

五、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。

参考文档

[下载：怎么计算股票方差.pdf](#)

[《93年股票开户需要什么流程和手续》](#)

[《并购基金是什么》](#)

[《当天买的基金什么时候可以赎回》](#)

[下载：怎么计算股票方差.doc](#)

[更多关于《怎么计算股票方差》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/73092588.html>