

如何计算两只股票的协方差：协方差怎么算？？-股识吧

一、协方差的计算方法

解：首先计算x、y的期望值： $u_x = (3+2+4+5+6) / 5 = 4$ $u_y = (9+7+12+15+17) / 5 = 12$
利用你给的公式把 x_i (3、2、4、5、6)、 y_i (9、7、12、15、17) 及如上计算得到的期望依次带入公式，算得， $Cov(X, Y) = 26/5$ 。

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、如何计算两个股票的相关系数(correlation) (急)

您的数据不够，无法计算。

需要有A股跟市场的相关系数0.1，B股跟市场的相关系数0.5，以及AB股之间的相关系数（未提供），才能算出AB组合跟市场的相关系数。

四、协方差怎们算？

$$Cov(X, Y) = E(XY) - E(X)E(Y) = E[X - E(X)][Y - E(Y)].$$

五、协方差怎么算？？

$cov(x, y) = EXY - EX * EY$ 协方差的定义，EX为随机变量X的数学期望，同理，EXY是XY的数学期望，挺麻烦的，建议你看一下概率论
 $cov(x, y) = EXY - EX * EY$ 协方差的定义，EX为随机变量X的数学期望，同理，EXY是XY的数学期望，挺麻烦的，建议你看一下概率论

六、如何计算两个两个方差矩阵的协方差矩阵

原式= $\frac{d}{dx} \int_0^{\cos x} \cos(t^2) dt - \frac{d}{dx} \int_0^{\sin x} \cos(t^2) dt = \frac{d}{d\cos x} \int_0^{\cos x} \cos(t^2) dt \cdot \frac{d\cos x}{dx} - \frac{d}{d\sin x} \int_0^{\sin x} \cos(t^2) dt \cdot \frac{d\sin x}{dx} = \cos(\cos^2 x) \cdot (-\sin x) - \cos(\sin^2 x) \cdot \cos x = -\sin x \cdot \cos(\cos^2 x) - \cos x \cdot \cos(\sin^2 x)$ 注： $\int_a^b f(t) dt$ 表示f(t)的以a为下限、b为上限的定积分。

七、协方差的计算公式是什么，能不能举个例子

高考方差是各个数据与平均数之差的平方的平均数,即 $s^2 = \frac{1}{n} [(x_1 - \bar{x})^2 + (x_2 - \bar{x})^2 + \dots + (x_n - \bar{x})^2]$, 其中, \bar{x} 表示样本的平均数, n表示样本的数量, x_n 表示个体, 而 s^2 就表示方差。

实例（甘肃省，2002年）某校初三年级甲、乙两班举行电脑汉字输入速度比赛，两个班参加比赛的学生每分钟输入汉字的个数，经统计和计算后结果如下表所示：

班级	参加人数	平均字数	中位数	方差
甲	55	135	149	191
乙	55	135	151	110

有一位同学根据上表得出如下结论：甲、乙两班学生的平均水平相同 乙班优秀的人数比甲班优秀的人数多（每分钟输入汉字达150个以上为优秀） 甲班学生比赛成绩的波动比乙班学生比赛成绩的波动大。上述结论正确的是_____（填序号）。

解：填 、 、 ，解：甲乙的平均数相同，所以 甲、乙两班学生的平均水平相同。根据中位数可知乙的中位数大，所以 乙班优秀的人数比甲班优秀的人数多。根据方差数据可知，方差越大波动越大，反之越小，所以甲班学生比赛成绩的波动比乙班学生比赛成绩的波动大。

故填： 。点评：本题考查统计知识中的中位数、平均数和方差的意义。要知道平均数和中位数反映的是数据的集中趋势，方差反映的是离散程度。

八、互协方差阵DxxDxyDyx如何求解

根据图象的协方差矩阵的求解公式,采取传统的方法最少要遍历2次图象才能求得图象的协方差矩阵:第1次是求均值,第2次是求每一个样本与均值样本之差的积。如果图象...

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

参考文档

[下载：如何计算两只股票的协方差.pdf](#)

[《股票年化是什么意思是什么意思》](#)

[《股票怎么算翻了几倍》](#)

[《怎么去除股票指标公式》](#)

[《炒股指标怎么设置》](#)

[下载：如何计算两只股票的协方差.doc](#)

[更多关于《如何计算两只股票的协方差》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/book/40865777.html>