

股票收益率标准差怎么算 - 证券投资组合计算题。若两股票Z与Y的收益率均值分别为0.05和0.03， -股识吧

一、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

二、已知一只股票的月对数收益率，怎么求年标准差呢

展开全部在EXCEL中调用STDEV函数，即可求出标准差，也可画出正态分布图。

三、投资学习题：股票提供的期望收益率为18%，标准差为22%。黄金提供的期望收益率为10%，标准差为30%。

1) 选择单一资产投资时，黄金由于收益率低，风险高，所以不会有人选择投资黄金。

2) 由于黄金与股票的相关系数为1（即完全正相关），黄金与股票的投资组合并不能抵消风险，所以投资组合中不会持有黄金。

上述假设并不能代表证券市场的均衡，因为股票收益率更高，风险更小。

四、证券投资组合计算题。若两股票Z与Y的收益率均值分别为0.05和0.03，

方差为0.36%和0.16%，若相关系数为 $\rho(ZY) = 0...$

五、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！

六、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

$COV(K_a, K_m) = r \cdot \sigma_a \cdot \sigma_m = 0.4 \cdot (0.16^{0.5}) \cdot (0.25^{0.5}) = 0.4 \cdot 0.4 \cdot 0.5 = 0.08$ ，

$COV(K_a, K_m)$ 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 $\sigma_a = COV(K_a, K_m) / (\sigma_a)^2 = 0.08 / 0.16 = 0.5$ ，

A股票的贝塔系数是0.5
A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%

七、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。

八、证券A、B、C的预期投资收益率分别为：12%、19%和12%；标准差分别为：0.0583、0.3239和0.1208。选择哪种证

你说呢...

参考文档

[下载：股票收益率标准差怎么算.pdf](#)

[《股票开通融资要多久》](#)

[《msci中国股票多久调》](#)

[《30万买股票能买多久》](#)

[《跌停的股票多久可以涨回》](#)

[《上市公司回购股票多久卖出》](#)

[下载：股票收益率标准差怎么算.doc](#)

[更多关于《股票收益率标准差怎么算》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/chapter/23467168.html>