

股票组合方差怎么算—谁帮我看一下，下面这个关于n个资产组合方差的公式是什么意思，能详细点最好。-股识吧

一、三个资产组合的预期收益率和方差，主要是最后方差的公式到最后一行的 $w_i w_j$ 方差 σ_{ij} 怎么算？

第一个的结果：收益率 $=0.1*0.4+0.2*0.3+0.3*0.15+0.4*0.1+0.5*0.05=0.21$ ，方差1的收益 $0.21*比例0.3=0.063$ （以下自己计算就可以了）+2的收益+3的收益=组合的预期收益率，方差 $=（1的收益-组合收益率）平方*比重+（2的收益-组合收益率）平方*比重+（3的收益-组合收益率）平方*比重$

二、某一个股票与股票市场组合的方差是什么意思

任何投资者都希望投资获得最大的回报，但是较大的回报伴随着较大的风险。

为了分散风险或减少风险，投资者投资资产组合。

资产组合是使用不同的证券和其他资产构成的资产集合，目的是在适当的风险水平下通过多样化获得最大的预期回报，或者获得一定的预期回报使用风险最小。

作为风险测度的方差是回报相对于它的预期回报的离散程度。

资产组合的方差不仅和其组成证券的方差有关，同时还有组成证券之间的相关程度有关。

为了说明这一点，必须假定投资收益服从联合正态分布（即资产组合内的所有资产都服从独立正态分布，它们间的协方差服从正态概率定律），投资者可以通过选择最佳的均值和方差组合实现期望效用最大化。

如果投资收益服从正态分布，则均值和方差与收益和风险一一对应。

如本题所示，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： $50\% \times (-7\%) + 50\% \times 17\% = 5\%$

正常： $50\% \times (12\%) + 50\% \times 7\% = 9.5\%$ 繁荣： $50\% \times (28\%) + 50\% \times (-3\%) = 12.5\%$ 则该投资组合的预期收益率为： $1/3 \times 5\% + 1/3 \times 9.5\% + 1/3 \times 12.5\% = 9\%$ 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。

三、谁帮我看一下，下面这个关于n个资产组合方差的公式是什么意思，能详细点最好。

你就这么记 $\sigma^2 = A^2 + B^2 + 2ABr$ 其中，A=x的标准差乘以x的权重，B就是y的。
r是xy的相关系数

四、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
 $= [(6\%)^2 \times (30\%)^2 + 2 \times 30\% \times 6\% \times 70\% \times 2\% \times 0.12 + (2\%)^2 \times (70\%)^2]$
 $= 0.000324 + 0.00006024 + 0.000784 = 0.00116824$ 开方后得标准差0.034180

五、方差要怎么算？

简单点讲，就是把这组数据中的每个数与平均数的差的平方和再除以这组数据的个数。

式子有点复杂， $S^2 = 1/n[(x_1 - a)^2 + \dots + (x_n - a)^2]$

$(x_2 - a)^2 + \dots + (x_3 - a)^2$. a是平均数，实际上应是另一字母，这里没打出来

六、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，

七、三个资产组合的预期收益率和方差，主要是最后方差的公式到最后一行的 $w_i w_j$ 方差 σ_{ij} 怎么算？

一组数据 x_1, x_2, \dots, x_n ，先求平均值。

方差 $= 1/n [(x_1 - \text{平均数})^2 + (x_2 - \text{平均数})^2 + \dots + (x_n - \text{平均数})^2]$

八、方差怎么算的。

一组数据 x_1, x_2, \dots, x_n ，先求平均值。

方差 $= 1/n [(x_1 - \text{平均数})^2 + (x_2 - \text{平均数})^2 + \dots + (x_n - \text{平均数})^2]$

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：股票组合方差怎么算.pdf](#)
[《股票扭亏不禁渔期是什么意思》](#)
[《现在都有什么炒股软件》](#)
[《货币债券股票什么意思啊》](#)
[下载：股票组合方差怎么算.doc](#)
[更多关于《股票组合方差怎么算》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/chapter/73539979.html>