

单个股票的方差 怎么求--关于股票中贝塔系数和方差的问题-股识吧

一、如何求方差

设这组数据: x_1 、 x_2 、 x_3 、.....、 x_n 的平均数是 M ，先求出 M ，然后代入方差的公式就可以了： $s^2 = [(x_1-M)^2 + (x_2-M)^2 + (x_3-M)^2 + \dots + (x_n-M)^2] \div n$

二、关于股票中贝塔系数和方差的问题

方差反映自身的风险。

自身的风险分两部分，一部分是系统风险，另一部分是非系统风险。

方差是这两种风险的总和。

贝塔系数只反映系统风险的大小。

你错了 横坐标是标准差。

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

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

$COV(K_a, K_m)$ 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%

四、方差怎么求

先求平均值，方差等于每个值与平均值的差的平方的总和，再给总和开方，再除以值的个数。

$$a=(1/n)^* \quad ((a1-a)^2+(a2-a)^2+(a3-a)^2+\dots+(an-a)^2)$$

五、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

六、方差怎么算？

一组数据 x_1, x_2, \dots, x_n ,先求平均值。

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

七、单独个股 系数在哪里可以查到？或者如何简单计算？在线等。

实际中，一般用单个股票资产的历史收益率对同期指数（大盘）收益率进行回归，回归系数就是Beta系数。

使用大盘的收益率和你选择的个股的收益率,在同花顺中可以导出excel中,然后再用数据分析进行回归分析,得到的斜率就是Beta系数.

八、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

先求平均值，方差等于每个值与平均值的差的平方的总和，再给总和开方，再除以值的个数。

$$a=(1/n)^* \quad ((a1-a)^2+(a2-a)^2+(a3-a)^2+\dots+(an-a)^2)$$

九、知道月方差怎么求年方差？

已知：（月方差）用样本估计总体，所以年方差为：每个月的方差之和除以12
仅供借鉴！

参考文档

[下载：单个股票的方差 怎么求.pdf](#)

[《股票合并多久能完成》](#)

[《股票定增后多久通过》](#)

[《股票资金冻结多久能解冻》](#)

[下载：单个股票的方差 怎么求.doc](#)

[更多关于《单个股票的方差 怎么求》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/read/12670936.html>