

单个股票的方差怎么求.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-股识吧

一、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.

二、关于股票中贝塔系数和方差的问题

一组数据 x_1, x_2, \dots, x_n ,先求平均值。

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

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。

$$a=(1/n)^* \left((a_1-a)^2+(a_2-a)^2+(a_3-a)^2+\dots+(a_n-a)^2 \right)$$

五、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： $s^2 = [(x_1-M)^2 + (x_2-M)^2 + (x_3-M)^2 + \dots + (x_n-M)^2] \div n$

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、方差怎么求啊？

甲： $DX(\text{方差}) = ((89-90)^2 + (85-90)^2 + (91-90)^2 + (90-90)^2 + (95-90)^2) / 5$
乙： $DX(\text{方差}) = ((80-90)^2 + (82-90)^2 + (98-90)^2 + (95-90)^2 + (95-90)^2) / 5$
你那儿有计算器伐，有的话自己算下吧
 $DX(\text{方差}) = ((\text{各组数据} - \text{平均数})^2\text{-之和}) / \text{数据个数}$

八、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！

九、离散型随机变量的方差

高中数学公式你写对了0那一项忽略了你怎么可能算对比如 $X=0$ 248
对应为概率是0.25 0.25 0.25 0.25 所以最后得到的 X 的希望则为14/4 方差为0

因为都是0.25没有波动 你带那公式看D是不是该是0呢 必须是啊 公式是对的
先把期望求对 后面带公式

参考文档

[下载：单个股票的方差 怎么求.pdf](#)

[《买了股票持仓多久可以用》](#)

[《买了股票持仓多久可以用》](#)

[《股票退市多久能拿到钱》](#)

[《股票抽签多久确定中签》](#)

[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/12671062.html>