

股票收益率的方差怎么求——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？-股识吧

一、如何用excel计算股票收益率的标准差

用excel计算股票收益率的标准差方法如下：在zhidaoA2：B5之间 则有两种方式
=STDEVP(A2：A5，B2：B5)值是15.06% STDEV：

返回给定表达式中所有值的统计标准差 =STDEV(A2：A5，B2：B5)值是16.10%
STDEVP：返回给定表达式中所有值的填充统计标准差

二、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%

三、股票收益率的标准差怎么计算

先计算股票的平均收益率 \bar{x} ，然后将股票的各个收益率与平均收益率相减平方如 $(x_1 - \bar{x})^2$ ，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。

四、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

五、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wiwj方差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

参考文档

[下载：股票收益率的方差怎么求.pdf](#)

[《加息后股票价格下跌意味着什么》](#)

[《炒股开户有什么流程》](#)

[《牛市强势股怎么选择》](#)

[《股票中的主力出货是什么意思》](#)

[下载：股票收益率的方差怎么求.doc](#)

[更多关于《股票收益率的方差怎么求》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/22514740.html>