

单个股票标准差如何计算：求股票的期望收益率和标准差-股识吧

一、证券组合标准差的计算？

$0.3 \times 0.3 \times 0.06 \times 0.06 + 0.7 \times 0.7 \times 0.08 \times 0.08 + 2 \times 0.3 \times 0.7 \times 0.06 \times 0.08 = 0.098752$ 0.098752开方为0.3142
比例1的平方*标准差1的平方+比例2的平方*标准差2的平方+比例1*比例2*标准差1*标准差2*2最后开方。
没有办法输入公式真麻烦。

二、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 $r(X,Y) = Cov(X,Y) / (\sigma_x \times \sigma_y) = 3.02 / (0.77 \times 3.93) = 0.9979$
参考资料来源：百度百科-期望收益率参考资料来源：百度百科-协方差参考资料来源：百度百科-方差

三、怎么计算股票收益的年标准差

例如上述值在A2: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

四、如何用excel计算股票收益率的标准差

你问的是标准差，还是平均期望收益？后者的话，假设数据在A2到B5，=SUMPRODUCT(A2:A5,B2:B5)

五、求股票的期望收益率和标准差

期望值=15%*40%+10%*60%=12%标准差= $[40%*(12%-15\%)^2+60%*(12%-10\%)^2]^{1/2}=(0.4*0.0009+0.6*0.0004)^{1/2}=0.0006^{1/2}=0.0245$

参考文档

[下载：单个股票标准差如何计算.pdf](#)

[《公司上市多久股东的股票可以交易》](#)

[《股票卖的钱多久到》](#)

[《今天买的股票多久才能卖》](#)

[下载：单个股票标准差如何计算.doc](#)

[更多关于《单个股票标准差如何计算》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/read/33681595.html>