

怎样计算股票方差请高手帮忙计算下这个投资组合的方差-股识吧

一、计算该股票平均收益率及协方差，急求！谢谢

用excel吧，其中日收益率等于每天股票价格的变化率。
算出两只股票的日变化率，然后用公式“covariance=”来计算协方差。

二、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，

三、excel算方差，用varp，不是很会做后面括号里的内容

你用的是哪个版本？我的机子提示varp(number1, [number2], ...) 以你截图中的数据，算浦发发行的，输入=VARP(B2:B12)

四、假设市场中只有两只股票x和y，他们的期望收益率分别等于0.2和0.1，方差分别等于0.01和0.0

题目里应该还有xy协方差为0吧

五、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*(30%)^2+2*30%*6%*70%*2%*0.12+(2%)^2*(70%)^2]=0.000324+0.00006024+0.000784=0.00116824开方后得标准差0.034180

六、如何计算证券的估计期望方差？公式是？

期望的估计是0.3方差的估计是 $1/3[(0.5-0.3)^2+(0.3-0.3)^2+(0.1-0.3)^2]=2.67\%$

七、计算该股票平均收益率及协方差，急求！谢谢

马克维茨证券均值方差，具体的公式书上有呀，

参考文档

[下载：怎样计算股票方差.pdf](#)

[《股票的大盘涨跌幅度是什么意思》](#)

[《星云股份是什么股票》](#)

[《如何开通两融》](#)

[《为什么很多中概股回归A股》](#)

[下载：怎样计算股票方差.doc](#)

[更多关于《怎样计算股票方差》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/store/31171239.html>