

如何得到股票的日回报的标准差_股票收益率的方差怎么求、相关系数怎么出来的。-股识吧

一、股票收益率的方差怎么求、相关系数怎么出来的。

(1) A股票收益率的期望值 = (4% - 2% + 5% + 6% - 3%) / 5 = 2% A股票收益率的标准差 = 4.18% B股票收益率的期望值 = 10% × 0.3 + 20% × 0.3 - 8% × 0.4 = 5.8% B股票收益率的标准差 = 11.91% (2) A、B股票的协方差 = A、B股票的相关系数 × A股票收益率的标准差 × B股票收益率的标准差 = 0.8 × 4.18% × 11.91% = 0.40% (3) 投资组合的方差 = 0.3 × 0.3 × 4.18% × 4.18% + 2 × 0.3 × 0.7 × 0.40% + 0.7 × 0.7 × 11.91% × 11.91% = 0.88% (4) 投资组合的贝他系数 = 0.5 × 9.38% / 15% = 0.31 假设B股票的贝他系数为b, 则: 0.3 × 0.4 + 0.7 × b = 0.31 解得: b = 0.27

1、男人和女人, 决定是什么关系, 通常是三秒钟的事情。

一见钟情否, 通常只要一秒钟。

2、一段持久的爱情, 肯定是双赢的, 而且是平衡的, 一旦有天失衡了, 就是关系破裂的时候。

3、一个走向成熟的女人, 可以没有像样的衣服, 但是不能没有像样的包包, 因为它会给女人安全感。

爱情可能背叛你, 但是包包却永远不会。

4、选择一个男人的时候, 设法了解他和母亲以及初恋的情况。

男人的母亲和初恋女孩, 这两个女人已经决定了他的爱情观。

5、女人总想找一个自己欣赏的, 比自己更强大的男人。

那样的男人都在塔尖上, 大多数踮着脚尖都够不着, 够着了可能因为争抢而摔死。

6、优等男早都被占坑了, 你得赶紧占一个。

饰品 ptisys.com/list.php?catid=1705

7、别跟有处女情结的男人耗, 这样的男人, 不是自大就是自卑。

二、股票日波动率的标准差怎么算? 急! 急! 急! ! ! !

该表提供根据股票日收益数据计算的历史波动率。

分别采用20日、60日简单移动法, 指数加权移动平均法和Garch模型计算日波动率。

。

本表使用对数收益数据。

对数收益 = $\log(1 + \text{百分比收益})$ 。

(来源：道富投资)

三、财务管理里面只知道股票各年的报酬率怎么求标准差

求平均值 R_0 ，再用各年报酬率减去平均报酬率差的平方除以总的年数就是报酬率方差，开平方就是报酬率的标准差了撒~~~

四、计算投资组合的标准差的公式是什么？可以举个例子吗？

标准差也就是风险。

它不仅取决于证券组合内各证券的风险，还取决于各个证券之间的关系。

投资组合的标准差计算公式为 $P = W_1 \sigma_1 + W_2 \sigma_2$ 各种股票之间不可能完全正相关，也不可能完全负相关，所以不同股票的投资组合可以减低风险，但又不能完全消除风险。

一般而言，股票的种类越多，风险越小。

关于三种证券组合标准差的简易算法：根据代数公式： $(a+b+c)^2 = a^2 + b^2 + c^2 + 2ab + 2ac + 2bc$ 第一步1，将A证券的权重 \times 标准差，设为A，2，将B证券的权重 \times 标准差，设为B，3，将C证券的权重 \times 标准差，设为C，第二步将A、B证券相关系数设为X将A、C证券相关系数设为Y将B、C证券相关系数设为Z展开上述代数公式，将x、y、z代入，即可得三种证券的组合标准差= $(A^2 + B^2 + C^2 + 2XAB + 2YAC + 2ZBC)$ 的1/2次方。

五、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)`

六、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，`=SUMPRO`

DUCT(A2:A5,B2:B5)

七、计算投资收益的标准差

算了下，好像答案和你的选项没有相同的。

22.32%首先是求预期收益率。

翻倍就是收益率100%；

减半就是-50% $e = 100\% * 70\% + (-50\%) * 30\% = 55\%$ 标准差 = $((55\% - 100\%)^2 * 0.7 + (55\% - (-50\%))^2 * 0.3)$ 开根号 = 0.2232

八、股票日波动率的标准差怎么算？急！急！急！！！！

该表提供根据股票日收益数据计算的历史波动率。

分别采用20日、60日简单移动法，指数加权移动平均法和Garch模型计算日波动率。

本表使用对数收益数据。

对数收益=log(1+百分比收益)。

(来源：道富投资)

参考文档

[下载：如何得到股票的日回报的标准差.pdf](#)

[《股票锁仓后时间是多久》](#)

[《社保基金打新股票多久上市》](#)

[《股票停牌多久下市》](#)

[《农业银行股票一般持有多久分红》](#)

[下载：如何得到股票的日回报的标准差.doc](#)

[更多关于《如何得到股票的日回报的标准差》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/33015424.html>