

两种股票的协方差怎么算例题——下表是某一周甲乙两种股票每天交易的收盘价（即股票每天结束的价格）。某人在该周内持有若干甲乙股票，若按-

一、2元一次应用题某人用24000元买进甲、乙两种股票，在甲股票升值15%，乙股票下跌10%时卖出，共获利1350元

题目应该是这样吧2元一次应用题某人用24000元买进甲、乙两种股票，在甲股票升值15%，乙股票下跌10%时卖出，共获利1350元，求甲乙股票各买了多少元设甲股票买了X元，乙股票买了Y元，有方程组 $X+Y=24000$ $X*115\%+Y*90%=24000+1350$ 解得 $X=15000$ $Y=9000$

二、下表是某一周甲乙两种股票每天交易的收盘价（即股票每天结束的价格）。某人在该周内持有若干甲乙股票，若按

解：设该人持有甲股票X股，乙股票Y股 $\begin{cases} X(12.5-12) - Y(13.5-13.3) = 200 \\ X(12.9-12.5) + Y(13.9-13.3) = 1300 \end{cases}$ 解得 $\begin{cases} X:1000 \\ Y:1500 \end{cases}$ 答：该人持有甲股票1000股，乙股票1500股。

答案仅供参考

三、关于股票中贝塔系数和方差的问题

方差反映自身的风险。

自身的风险分两部分，一部分是系统风险，另一部分是非系统风险。

方差是这两种风险的总和。

贝塔系数只反映系统风险的大小。

你错了 横坐标是标准差。

四、求甲乙两种股票系统性风险大小,求甲乙股票与市场组合的

相关系数

没看懂什么意思？

五、有两种证券，两种证券的投资比重相当时，求新的组合的期望收益率，方差，和标准离差。怎么算啊？

单个证券的简单，2个的，你可以采用二叉树式计算试试

六、某一个股票与股票市场组合的方差是什么意思

任何投资者都希望投资获得最大的回报，但是较大的回报伴随着较大的风险。为了分散风险或减少风险，投资者投资资产组合。

资产组合是使用不同的证券和其他资产构成的资产集合，目的是在适当的风险水平下通过多样化获得最大的预期回报，或者获得一定的预期回报使用风险最小。

作为风险测度的方差是回报相对于它的预期回报的离散程度。

资产组合的方差不仅和其组成证券的方差有关，同时还有组成证券之间的相关程度有关。

为了说明这一点，必须假定投资收益服从联合正态分布（即资产组合内的所有资产都服从独立正态分布，它们间的协方差服从正态概率定律），投资者可以通过选择最佳的均值和方差组合实现期望效用最大化。

如果投资收益服从正态分布，则均值和方差与收益和风险一一对应。

如本题所示，两个资产的预期收益率和风险根据前面所述均值和方差的公式可以计算如下：1。

股票基金 预期收益率=1/3*(-7%)+1/3*12%+1/3*28%=11%

方差=1/3[(-7%-11%)^2+(12%-11%)^2+(28%-11%)^2]=2.05%

标准差=14.3%(标准差为方差的开根，标准差的平方是方差)。

债券基金 预期收益率=1/3*(17%)+1/3*7%+1/3*(-3%)=7%

方差=1/3[(17%-7%)^2+(7%-7%)^2+(-3%-7%)^2]=0.67%

标准差=8.2%注意到，股票基金的预期收益率和风险均高于债券基金。

然后我们来看股票基金和债券基金各占百分之五十的投资组合如何平衡风险和收益。

投资组合的预期收益率和方差也可根据以上方法算出，先算出投资组合在三种经济状态下的预期收益率，如下：萧条：50%*(-7%)+50%*17%=5%

正常：50%*(12%)+50%*7%=9.5% 繁荣：50%*(28%)+50%*(-3%)=12.5%则该投资组

合的预期收益率为： $1/3 \times 5\% + 1/3 \times 9.5\% + 1/3 \times 12.5\% = 9\%$ 该投资组合的方差为： $1/3[(5\% - 9\%)^2 + (9.5\% - 9\%)^2 + (12.5\% - 9\%)^2] = 0.001\%$ 该投资组合的标准差为： 3.08%

注意到，其中由于分散投资带来的风险的降低。

一个权重平均的组合（股票和债券各占百分之五十）的风险比单独的股票或债券的风险都要低。

投资组合的风险主要是由资产之间的相互关系的协方差决定的，这是投资组合能够降低风险的主要原因。

相关系数决定了两种资产的关系。

相关性越低，越有可能降低风险。

七、某人用24000元买进甲，乙两种股票，在甲股票升值15%，乙股票下跌10%时卖出，共获利1350元，

设买进甲X元，则乙买进24000 - X元 即 $x \times 0.15 - (24000 - x) \times 0.1 = 1350$ 解之得， $x = 15000$ 所以甲买进15000元，乙买进9000元。

八、股票预期收益率及标准差 标准离差计算

$r(B) = 12\% \times 0.4 + 4\% \times 0.4 + (-6\% \times 20\%) = 5.2\%$ 方差(B) = $(12\% - 5.2\%)^2 \times 0.4 + (4\% - 5.2\%)^2 \times 0.4 + (-6\% - 5.2\%)^2 \times 0.2$ 标准差(B) = 方差(B)的开方

$r(A) = \text{四数和}/4 = 6.5\%$ A的方差不会，感觉少个相关系数， $\beta = 12\%/20\% = 0.6$ 通过cap m可以计算市场组合的收益率，没有相关系数，不能计算a的方差标准离差率是标准离差与期望值之比。

其计算公式为：标准离差率 = 标准离差/期望值 简单说就是一单位收益需要承担的风险，风险越小越好！市场组合白话说假如市场上有100只股票，我构建一个市场组合包括所有的股票，也就是100只，比例按它们的市值当权数加权！

九、设 $A = \text{diag}(1, -2, 1)$ ， $A^*BA = 2BA - 8E$ ，求B？求解题过程

|等式两边左乘A，即 $AA^*BA = 2ABA - 8A$ ，再右乘A(-1)，得 $AA^*B = 2AB - 8E$ ， $(AA^* - 2A)B = -8E$ ， $(|A|E - 2A)B = -8E$ ， $(-2E - 2A)B = -8E$ ， $(E + A)B = 4E$ ， $B = 4(E + A)(-1)$ ，从而可以求B

。例如：
$$\begin{aligned} |A| &= -2B = (A^* - 2E)^{-1}(-8E)A^{-1} = -8(A^* - 2E)^{-1}A^{-1} = -8[A(A^* - 2E)]^{-1} = -8(A \\ A^* - 2A)^{-1} &= -8(|A|E - 2A)^{-1} = -8(-2E - 2A)^{-1} = 4(E + A)^{-1} = 4\text{diag}(2, -1, 2)^{-1} = 4\text{diag}(1/2, -1, \\ 1/2) &= \text{diag}(2, -4, 2) \end{aligned}$$
扩展资料：把相等的式子(至少两个)通过等号连接形成的新式子叫做等式。

形式：把相等的式子(或字母表示的数)通过“=”连接起来。

等式分为含有未知数的等式 and 不含未知数的等式。

例如： $x+1=3$ ——含有未知数的等式；

$2+1=3$ ——不含未知数的等式。

需要注意的是，个别含有未知数的等式无解，但仍是等式，例如： $x+1=x$ —— x 无解。

参考资料来源：股票百科-等式

参考文档

[下载：两种股票的协方差怎么算例题.pdf](#)

[《st股票摘帽最短多久》](#)

[《德新交运股票停牌多久复牌》](#)

[《同花顺股票多久提现》](#)

[《蜻蜓点睛股票卖出后多久能取出》](#)

[下载：两种股票的协方差怎么算例题.doc](#)

[更多关于《两种股票的协方差怎么算例题》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/article/64312391.html>