

单只股票的方差怎么算~方差怎么算？说详细-股识吧

一、方差怎么算？

一组数据 x_1, x_2, \dots, x_n ,先求平均值。

方差= $1/n [(x_1-\text{平均数})^2+(x_2-\text{平均数})^2+\dots+(x_n-\text{平均数})^2]$

二、5566677的方差怎么算？

平均数= $(5+5+6+6+6+7+7)/7=6$
 $S^2=[(5-6)^2+(5-6)^2+(7-6)^2+(7-6)^2+(6-6)^2+(6-6)^2+(6-6)^2]/7=4/7$ 望采纳

三、请问单根股票K线的波动范围怎么算？

单根股票K线的波动范围的计算主要有二种方法：

一、股票振幅= $\text{当期最高价}/\text{当期最低价} \times 100\% - 100\%$ ；

二、股票振幅= $(\text{当期最高价} - \text{当期最低价})/\text{上期收盘价} \times 100\%$ 。

股票振幅就是股票开盘后的当日最高价和最低价之间的差的绝对值与前日收盘价的百分比，它在一定程度上表现股票的活跃程度。

如果一只股票的振幅较小，说明该股不够活跃，反之则说明该股比较活跃。

股票振幅分析有日振幅分析、周振幅分析、月振幅分析等等类型。

比如，今天有一个股票，昨天收盘是10块，今天最高上涨到11块,涨10%，最低到过9块，下跌10%。

那么振幅20%，简单来说股票的振幅就是股票开盘后的当日最高价和最低价之间的差和前日收盘价的比差。

周振幅分析、月振幅分析以此类推。

四、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 = $8\% + (12\% - 8\%) \cdot 0.5 = 10\%$

五、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。

六、股票预期收益率及标准差 标准离差计算

$r(B) = 12\% \cdot 0.4 + 4\% \cdot 0.4 + (-6\% \cdot 20\%) = 5.2\%$ 方差(B) = $(12\% - 5.2\%)^2 \cdot 0.4 + (4\% - 5.2\%)^2 \cdot 0.4 + (-6\% - 5.2\%)^2 \cdot 0.2$ 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capm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!

七、方差怎样算

八、方差怎么算? 说详细

每个数减去平均数的平方相加再除以个数

参考文档

[下载：单只股票的方差怎么算.pdf](#)

[《持仓多久股票分红不缴税了》](#)

[《股票需要多久出舱》](#)

[《股票流通股多久可以卖》](#)

[《股票成交量多久一次》](#)

[下载：单只股票的方差怎么算.doc](#)

[更多关于《单只股票的方差怎么算》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/author/12354273.html>