

两种股票协方差怎么算—下面这个题目怎么求协方差与相关系数?-股识吧

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、怎么计算自协方差函数？

也叫做自协方差函数，指的是在空间随机场 $Z(x)$ 中，点 x 和 $x+h$ 处两个随机变量 $z(x)$ 和在 $z(x+h)$ 的二阶混合中心距。

三、下面这个题目怎么求协方差与相关系数?

^^A股票期望值: $-5%*0.3+10%*0.4+25%*0.3=10%$ 标准差:根号 $((-5%-10%)^2*0.3+(10%-10%)^2*0.4+(25%-10%)^2*0.3)=11.62%$ B股票期望值: $-10%*0.3+15%*0.4+40%*0.3=15%$ 标准差:根号 $((-10%-15%)^2*0.3+(15%-15%)^2*0.4+(40%-15%)^2*0.3)=19.36%$ 相关系数= $(X_i-X_-)*(Y_i-Y_-)/\sqrt{(X_i-X_-)^2*\sqrt{(Y_i-Y_-)^2}}=1$ 协方差= $1*11.62%*19.36%=2.25%$

四、两因素方差分析中怎么计算各ss

两因素方差分析，求其中某个因素的SS值。
用这个公式计算， $\sum(\text{此因素水平对应的样本数}*(\text{对应水平的平均数}-\text{总均数})^2)$ 。
就能得到该因素的SS值了。

五、股票预期收益率及标准差 标准离差计算

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、协方差在证券收益与风险的计算中有什么作用？

协方差是指两个量的相关程度的指标。

如果衡量证券收益的话，比如说你买的某个股票和大盘的收益算出来的协方差，这个就能说明你的股票和大盘的变动是否正相关，负相关，或者不相关。

七、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。

参考文档

[下载：两种股票协方差怎么算.pdf](#)

[《股票拿出钱要多久》](#)

[《大宝退市的股票多久去老三板交易》](#)

[《新的股票账户多久可以交易》](#)

[《股票成交量多久一次》](#)

[下载：两种股票协方差怎么算.doc](#)
[更多关于《两种股票协方差怎么算》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/book/9380984.html>