

# 两只股票的协方差怎么求，急急急！！求大神计算，求两只股票的标准差。-股识吧

## 一、如何求股票的相关系数和协方差

给概率，股票收益率，期望收益率，方差，标准差，求相关系数，协方差

## 二、急急急！！求大神计算，求两只股票的标准差。

单个股票收益率的方差= $\beta^2 \times \text{市场收益率的方差} + \text{股票特定风险的方差}$   
A股票的标准差= $[(0.8^2) \times (20\%^2) + 30\%^2]^{(1/2)} = 0.34$   
B股票的标准差= $[(1.2^2) \times (20\%^2) + 20\%^2]^{(1/2)} = 0.3124$

## 三、此题的协方差如何求？

A的均值： $16 \times 1/4 + 12 \times 1/2 + 8 \times 1/4 = 12$  A的标准差：

$$(16-12)^2 \times 1/4 + (12-12)^2 \times 1/2 + (8-12)^2 \times 1/4 = 2.83$$

B的均值： $4 \times 1/3 + 6 \times 1/3 + 8 \times 1/3 = 6$  B的标准差：

$$(4-6)^2 \times 1/3 + (6-6)^2 \times 1/2 + (8-6)^2 \times 1/3 = 1.63$$

A和B的相关系数： $[(16-12) \times (4-6) + (12-12) \times (6-6) + (8-12) \times (8-6)] \div \{[(16-12)^2 + (12-12)^2 + (8-12)^2] \times [(4-6)^2 + (6-6)^2 + (8-6)^2]\} = 0$   
AB组合的协方差： $0 \times 2.83 \times 1.63 = 0$

## 四、急急急！！求大神计算，求两只股票的标准差。

单个股票收益率的方差= $\beta^2 \times \text{市场收益率的方差} + \text{股票特定风险的方差}$   
A股票的标准差= $[(0.8^2) \times (20\%^2) + 30\%^2]^{(1/2)} = 0.34$   
B股票的标准差= $[(1.2^2) \times (20\%^2) + 20\%^2]^{(1/2)} = 0.3124$

## 五、请教：怎么求n个变量两两间的协方差

随机变量X,Y协方差 $\text{cov}(X,Y) = \rho \sqrt{D(X)D(Y)}$ ,其中  $\rho$  是X,Y的相关系数, $D(X),D(Y)$  是X,Y的方差.或者还可以由定义式来求： $\text{cov}(X,Y) = E[(X-EX)(Y-EY)] = EXY - EXEY$ ,其中E是数学期望.

## 参考文档

[下载：两只股票的协方差怎么求.pdf](#)

[《股票委托多久才买成功》](#)

[《德新交运股票停牌多久复牌》](#)

[《农业银行股票一般持有多久分红》](#)

[下载：两只股票的协方差怎么求.doc](#)

[更多关于《两只股票的协方差怎么求》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/chapter/12615981.html>