

两种股票协方差怎么算...怎么计算自协方差函数？-股识吧

一、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。

二、下面这个题目怎么求协方差与相关系数？

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

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、

五、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 $X=15000$ $Y=9000$

参考文档

[下载：两种股票协方差怎么算.pdf](#)

[《增发股票会跌多久》](#)

[《三一股票分红需要持股多久》](#)

[《股票停牌复查要多久》](#)

[《卖完股票从证券里多久能取出来》](#)

[《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/chapter/9380950.html>