

股票的均值方差 如何计算—股市指标DMA中的平均值是什么平均值，假如我要算10日跟2日的怎么算，我文化不高，麻烦说仔细点啊，-股识吧

一、股票的预期收益率和方差怎么算

具体我也不太清楚，所以帮你搜了一下，转发给你看，希望能帮到你！例子：上面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)2。

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： $1/3*5\%+1/3*9.5\%+1/3*12.5\%=9\%$ 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。

二、股票，期望收益率，方差，均方差的计算公式

1、期望收益率计算公式： $HPR=(\text{期末价格}-\text{期初价格}+\text{现金股息})/\text{期初价格}$ 例：A股票过去三年的收益率为3%、5%、4%，B股票在下一年有30%的概率收益率为10%，40%的概率收益率为5%，另30%的概率收益率为8%。

计算A、B两只股票下一年的预期收益率。

解：A股票的预期收益率 = (3% + 5% + 4%) / 3 = 4% B股票的预期收益率

= 10% × 30% + 5% × 40% + 8% × 30% = 7.4%
2、在统计描述中，方差用来计算每一个变量（观察值）与总体均数之间的差异。

为避免出现离均差总和为零，离均差平方和受样本含量的影响，统计学采用平均离均差平方和来描述变量的变异程度。

扩展资料：1、协方差计算公式例：Xi 1.1 1.9 3, Yi 5.0 10.4 14.6解：E(X) =

(1.1+1.9+3)/3=2 E(Y) = (5.0+10.4+14.6)/3=10 E(XY)=(1.1 × 5.0+1.9 × 10.4+3 × 14.6)/3=23

.02 Cov(X, Y)=E(XY)-E(X)E(Y)=23.02-2 × 10=3.022、相关系数计算公式解：由上面的

解题可求X、Y的相关系数为 $r(X, Y) = \text{Cov}(X, Y) / (\sigma_x \sigma_y) = 3.02 / (0.77 \times 3.93) = 0.9$

979参考资料来源：股票百科-期望收益率参考资料来源：股票百科-

协方差参考资料来源：股票百科-方差

三、在股票当中的加权平均数是如何计算出来的

2001年1月19日证监会公布的《公开发行证券公司信息披露编报规则第9号——净资产收益率和每股收益的计算及披露》规定，当期发行在外普通股加权平均数= $S_0 + S_1 + S_i \times M_i \div M_0 - S_j \times M_j \div M_0$ 。

其中：P为报告期利润；

S₀为期初股份总数；

S₁为报告期因公积金转增股本或股票股利分配等增加股份数；

S_i为报告期因发行新股或债转股等增加股份数；

S_j为报告期因回购或缩股等减少股份数；

M₀为报告期月份数；

M_i为增加股份下一月份起至报告期期末的月份数；

M_j为减少股份下一月份起至报告期期末的月份数。

四、

五、方差如何计算

比如说一组数据1, 2, 3先求出它的平均值为3所以方差= $\frac{1}{3} \times [(1-3)^2 + (2-3)^2 + (3-3)^2] = \frac{1}{3} \times 5 = \frac{5}{3}$ 极差；
极差就是一组数据中最大的数减去最小的数的值还是以刚才的例子为例极差=3-1=2

六、股票问题：怎么计算平均值？

用加权平均数公式来计算：计算方法： $(4.68 \times 200 + 4.42 \times 1000) / 1200 = 4.463$

参考文档

[下载：股票的均值方差 如何计算.pdf](#)

[《股票能提前多久下单》](#)

[《股票通常会跌多久》](#)

[《股票开户最快多久能到账》](#)

[《卖完股票从证券里多久能取出来》](#)

[《公司上市多久后可以股票质押融资》](#)

[下载：股票的均值方差 如何计算.doc](#)

[更多关于《股票的均值方差 如何计算》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/store/36014321.html>