

股票收益与市场收益协方差怎么算- 下面这个题目怎么求协方差与相关系数?-股识吧

一、股票预期收益率及标准差 标准离差计算

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

二、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
 $\beta = COV(K_a, K_m) / (\sigma_a)^2 = 0.08 / 0.16 = 0.5$ ，
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 = $8\% + (12\% - 8\%) \cdot 0.5 = 10\%$

三、理财如何计算相关系数？在计算协方差时如何考虑投资收益率可能发生的概率？

A的预期收益是7%，B是6%，A方差是0.019，B方差是0.022，A的预期收益高，风险少，当然选A啦，当然是建立在数据准确和二选一的基础上

四、下面这个题目怎么求协方差与相关系数？

五、股票收益的期望和标准差计算。

听了我这段做股票的心得，你一定有很大的收获。

我觉得做股票吧，首先，心态要好，创造财富也得有好心情。

中国的股市，波段操作的赢利范围和可行性最大，另外，选取的个股，也必须跟随主力的动向，这样就不会让自己的资金冒险。

为了把握最理想的买卖点，必须有主力的带动和证券技术部门的老师指引去操作，这样才能达到在股市中长期的稳定赢利。

下面我给大家推荐一位在股市中比较资深的操盘老师，主要的实战操作，才能让我们信服，这位老师的操作平台资料就在我的空间里，相信自己的眼光，关注一段时间后，你会发现，做股票，这才叫实力！

六、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 = $1 \times 11.62\% \times 19.36\% = 2.25\%$

七、股票和债券的收益标准差分别为0.4和0.1,股票和债券之间的协方差为0.016,试求该组合的标准差.

这里还需要组合中股票和债券的投资比例。

这里因为楼主没有给出，所以我假设为：

参考文档

[下载：股票收益与市场收益协方差怎么算.pdf](#)

[《挂单多久可以挂股票》](#)

[《股票账户多久不用会失效》](#)

[下载：股票收益与市场收益协方差怎么算.doc](#)

[更多关于《股票收益与市场收益协方差怎么算》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/subject/12187424.html>