

# 怎么算两只股票的方差~股票收益的期望和标准差计算。 - 股识吧

## 一、股票的组合收益率，组合方差怎么求？

分散投资降低了风险（风险至少不会增加）。

组合预期收益率=0.5\*0.1+0.5\*0.3=0.2 两只股票收益的协方差=-0.8\*0.3\*0.2=-0.048

组合收益的方差= (0.5\*0.2)^2+(0.5\*0.3)^2+2\*(-0.8)\*0.5\*0.5\*0.3\*0.2=0.0085

组合收益的标准差=0.092 组合前后发生的变化：组合收益介于二者之间；

风险明显下降。

## 二、股票的预期收益率和方差怎么算

&lt ;

p&gt ;

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！&lt ;

/p&gt ;

&lt ;

p&gt ;

例子：&lt ;

/p&gt ;

&lt ;

p&gt ;

&lt ;

/p&gt ;

&lt ;

p&gt ;

&nbsp; ;

&lt ;

/p&gt ;

&lt ;

p&gt ;

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 &nbsp; ;

&nbsp; ;

&nbsp; ;

&nbsp; ;

预期收益率= $1/3*(-7\%)+1/3*12\%+1/3*28\%=11\%$  &nbsp; ;

&nbsp; ;

&nbsp; ;

&nbsp; ;

方差= $1/3[(-7\%-11\%)^2+(12\%-11\%)^2+(28\%-11\%)^2]=2.05\%$  &nbsp; ;

&nbsp; ;

&nbsp; ;

&nbsp; ;

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 &nbsp; ;

&nbsp; ;

&nbsp; ;

&nbsp; ;

预期收益率= $1/3*(17\%)+1/3*7\%+1/3*(-3\%)=7\%$  &nbsp; ;

&nbsp; ;

&nbsp; ;

&nbsp; ;

方差= $1/3[(17\%-7\%)^2+(7\%-7\%)^2+(-3\%-7\%)^2]=0.67\%$  &nbsp; ;

&nbsp; ;

&nbsp; ;

&nbsp; ;

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： &nbsp; ;

&nbsp; ;

&nbsp; ;

&nbsp; ;

&nbsp; ;

萧条： $50%*(-7\%)+50%*17\%=5\%$  &nbsp; ;

&nbsp; ;

&nbsp; ;

&nbsp; ;

&nbsp; ;

正常： $50\% \times (12\%) + 50\% \times 7\% = 9.5\%$  &nbsp; ;

&nbsp; ;

&nbsp; ;

&nbsp; ;

&nbsp; ;

繁荣： $50\% \times (28\%) + 50\% \times (-3\%) = 12.5\%$

则该投资组合的预期收益率为： $\frac{1}{3} \times 5\% + \frac{1}{3} \times 9.5\% + \frac{1}{3} \times 12.5\% = 9\%$

该投资组合的方差为： $\frac{1}{3} [(5\% - 9\%)^2 + (9.5\% - 9\%)^2 + (12.5\% - 9\%)^2] = 0.001\%$

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。

&nbsp; ;

&nbsp; ;

&nbsp; ;

&nbsp; ;

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。

&lt; ;

/p> ;

### 三、如何得到2只股票的相关性？有无软件指标或算法？

个股之间没有太多的相关性，只有个股与大盘存在相关性

### 四、假设市场中只有两只股票x和y，他们的期望收益率分别等于0.2和0.1，方差分别等于0.01和0.0

题目里应该还有xy协方差为0吧

### 五、计算该股票平均收益率及协方差，急求！谢谢

用excel吧，其中日收益率等于每天股票价格的变化率。  
算出两只股票的日变化率，然后用公式“covariance=”来计算协方差。

## 六、如何计算方差，要有举例说明

一．方差的概念与计算公式 例1 两人的5次测验成绩如下：X：

50，100，100，60，50  $E(X)=72$ ；

Y：73，70，75，72，70  $E(Y)=72$ 。

平均成绩相同，但X不稳定，对平均值的偏离大。

方差描述随机变量对于数学期望的偏离程度。

单个偏离是消除符号影响 方差即偏离平方的均值，记为 $D(X)$ ：

直接计算公式分离散型和连续型，具体为：这里是一个数。

推导另一种计算公式得到：“方差等于平方的均值减去均值的平方”。

其中，分别为离散型和连续型计算公式。

称为标准差或均方差，方差描述波动程度。

## 七、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！

## 八、

## 参考文档

[下载：怎么算两只股票的方差.pdf](#)

[《证券转股票多久到账》](#)

[《股票定增后多久通过》](#)

[《创业板股票转账要多久》](#)

[《一个股票在手里最多能呆多久》](#)

[《社保基金打新股票多久上市》](#)

[下载：怎么算两只股票的方差.doc](#)

[更多关于《怎么算两只股票的方差》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/36139523.html>