

股票相关系数多少时风险最小~股票的β系数-股识吧

一、一位投资者预测A公司股票的报酬率是12%。标准差是8%。
B公司股票的报酬率是8%。标准差是5%、两家公司股票

这个得看投资者的风险偏好。

风险偏好型选A，风险厌恶型就难办了。

这个属于组合线的一般情形，计算AB组合的最小风险组合计算很复杂。

不过可以假设两支股票不相关，这样就简单多了。

大概可以算投资A28%，B72%。

二、证券投资组合计算题。若两股票Z与Y的收益率均值分别为0.05和0.03，

方差为0.36%和0.16%，若相关系数为 $\rho(ZY) = 0...$

三、假设证券市场中有股票A和B，其收益和标准差如下表，如果两只股票的相关系数为-1。

这道题是希望通过运用两只股票构建无风险的投资组合，由一价原理，该无风险投资组合的收益就是无风险收益率。

何为无风险投资组合？即该投资组合收益的标准差为0，由此，设无风险投资组合中股票A的权重为 w ，则股票B的权重为 $(1-w)$ ，则有： $\{(5\%w)^2 + [10\%(1-w)]^2 + 2 \cdot 5\% \cdot 10\% \cdot (-1) \cdot (1-w)w\}^{(1/2)} = 0$ 等式两边同时平方，并扩大10000倍（消除百分号），则有： $25(w^2) + 100(1-w)^2 - 100w(1-w) = 0$ 化简为： $225w^2 - 300w + 100 = 0$ $(15w - 10)^2 = 0$ 则 $w = 2/3$ 则，该投资组合的收益率为： $2\% \cdot (2/3) + 5\% \cdot (1/3) = 9\%/3 = 3\%$

四、（投资学）为什么低的相关系数可以降低风险?详细点。。
。谢谢

投资组合理论中，衡量风险的标准就是方差（variance）。

对于有两支股票1和2的投资组合，整个组合的方差由股票1方差、股票2方差和两支股票的协方差组成。

当相关系数低、甚至小于0的时候，协方差就减小，导致整个投资组合的方差（即风险）减小。

相关系数介于-1和1之间，当相关系数为1时，两支股票没有对冲风险的效应，当相关系数为0甚至小于0时，协方差就为0或者为负值，可以大幅降低整个组合的风险。

。

五、百度 某投资者将一只股票加入到某组合中,如该股票与拟加入组合有相同标准差,且两者相关系数小

良好的心态，要学会止损、割肉、设立盈亏点！比如：你10元买入一只股票，涨到11元，如果你设立的止盈点是10.4元，庄家短暂的洗盘一般不会把你洗出去，如果从11元跌回10.4元，你立刻止盈，虽然赚得很少，但减少了盲动性。

如果股价涨到12元后，你的止盈点相应提升到11元，股价到了14元，止盈点设置在12.8元……这样的话，庄稼洗盘和出货，你都能从容地获利出局。

望采纳！

六、假定贝克基金（baker fund）与标准普尔指数的相关系数为0.7，贝克基金的总风险中特有风险为多少

0.51，根据CAPM模型可以算出来

七、股票的 β 系数

目录 · 贝塔系数(β) · β 系数计算方式 · Beta的含义 · Beta的一般用途 贝塔系数(β)

贝塔系数衡量股票收益相对于业绩评价基准收益的总体波动性，是一个相对指标。

β 越高，意味着股票相对于业绩评价基准的波动性越大。

β 大于1，则股票的波动性大于业绩评价基准的波动性。

反之亦然。

如果 β 为 1, 则市场上涨 10%, 股票上涨 10%; 市场下滑 10%, 股票相应下滑 10%。

如果 β 为 1.1, 市场上涨 10% 时, 股票上涨 11%; 市场下滑 10% 时, 股票下滑 11%。

如果 β 为 0.9, 市场上涨 10% 时, 股票上涨 9%; 市场下滑 10% 时, 股票下滑 9%。

β 系数计算方式 (注: 杠杆主要用于计量非系统性风险) (一) 单项资产的 β 系数 单项资产系统风险用 β 系数来计量, 通过以整个市场作为参照物, 用单项资产的风险收益率与整个市场的平均风险收益率作比较, 即:

$\beta = \frac{\text{单项资产的风险收益率}}{\text{市场组合的平均风险收益率}}$ 另外, 还可按协方差公式计算 β 值, 即 $\beta = \frac{\text{该资产收益率与市场组合收益率的协方差}}{\text{市场组合收益率的方差}}$ 注意: 掌握 β 值的含义

◆ $\beta = 1$, 表示该单项资产的风险收益率与市场组合平均风险收益率呈同比例变化, 其风险情况与市场投资组合的风险情况一致; ◆ $\beta > 1$, 说明该单项资产的风险收益率高于市场组合平均风险收益率, 则该单项资产的风险大于整个市场投资组合的风险; ◆ $\beta < 1$, 说明该单项资产的风险收益率小于市场组合平均风险收益率, 则该单项资产的风险程度小于整个市场投资组合的风险。

小结: 1) β 值是衡量系统性风险, 2) β 系数计算的两种方式。

Beta 的含义 Beta 系数起源于资本资产定价模型 (CAPM 模型), 它的真实含义就是特定资产 (或资产组合) 的系统风险度量。

所谓系统风险, 是指资产受宏观经济、市场情绪等整体性因素影响而发生的价格波动, 换句话说, 就是股票与大盘之间的连动性, 系统风险比例越高, 连动性越强。与系统风险相对的就是个别风险, 即由公司自身因素所导致的价格波动。

总风险 = 系统风险 + 个别风险 而 Beta 则体现了特定资产的价格对整体经济波动的敏感性, 即, 市场组合价值变动 1 个百分点, 该资产的价值变动了几个百分点——或者用更通俗的说法: 大盘上涨 1 个百分点, 该股票的价格变动了几个百分点。

用公式表示就是: 实际中, 一般用单个股票资产的历史收益率对同期指数 (大盘) 收益率进行回归, 回归系数就是 Beta 系数。

Beta 的一般用途 一般的说, Beta 的用途有以下几个:

- 1) 计算资本成本, 做出投资决策 (只有回报率高于资本成本的项目才应投资);
- 2) 计算资本成本, 制定业绩考核及激励标准;
- 3) 计算资本成本, 进行资产估值 (Beta 是现金流贴现模型的基础);
- 4) 确定单个资产或组合的系统风险, 用于资产组合的投资管理, 特别是股指期货或其他金融衍生品的避险 (或投机)。

对 Beta 第四种用途的讨论将是本文的重点。

组合 Beta Beta 系数有一个非常好的线性性质, 即, 资产组合的 Beta 就等于单个资产的 Beta 系数按其在组合中的权重进行加权求和的结果。

八、已知两只股票相关系数为-1，如何求无风险利率，谢谢啦~~

列两个方程组，可以参考无风险套利推导公式++

九、怎样炒股才能风险最小呢？

良好的心态，要学会止损、割肉、设立盈亏点！比如：你10元买入一只股票，涨到11元，如果你设立的止盈点是10.4元，庄家短暂的洗盘一般不会把你洗出去，如果从11元跌回10.4元，你立刻止盈，虽然赚得很少，但减少了盲动性。如果股价涨到12元后，你的止盈点相应提升到11元，股价到了14元，止盈点设置在12.8元……这样的话，庄稼洗盘和出货，你都能从容地获利出局。望采纳！

参考文档

[下载：股票相关系数多少时风险最小.pdf](#)

[《a股股票牛市行情持续多久》](#)

[《股票保价期是多久》](#)

[《股票解禁前下跌多久》](#)

[《股票亏钱多久能结束》](#)

[下载：股票相关系数多少时风险最小.doc](#)

[更多关于《股票相关系数多少时风险最小》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/author/55438761.html>