

什么样的股票相关系数小、哪种类型的股票风险比较小？ -股识吧

一、哪种类型的股票风险比较小？

一般认为防御型行业的股票风险比较小，包括电力，水务，煤炭，交通运输等等

二、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++

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： $\{(5\%w)^2 + [10\%(1-w)]^2 + 2 * 5\% * 10\% * (-1) * (1-w)w\}^{(1/2)} = 0$ 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： $2\% * (2/3) + 5\% * (1/3) = 9\%/3 = 3\%$

四、上证50与中证500与沪深300有什么区别？哪个比较好

上证50：上证50指数是根据科学客观的方法，挑选上海证券市场规模大、流动性好的最具代表性的50只股票组成样本股，以便综合反映上海证券市场最具市场影响力的一批龙头企业的整体状况。

上证50指数自2004年1月2日起正式发布。

其目标是建立一个成交活跃、规模较大、主要作为衍生金融工具基础的投资指数。

中证500：是中证指数有限公司所开发的指数中的一种，其样本空间内股票是扣除

沪深300指数样本股及最近一年日均总市值排名前300名的股票，剩余股票按照最近一年（新股为上市以来）的日均成交金额由高到低排名，剔除排名后20%的股票，然后将剩余股票按照日均总市值由高到低进行排名，选取排名在前500名的股票作为中证500指数样本股。

中证500指数综合反映沪深证券市场中小市值公司的整体状况。

沪深300：指数的选样方法是对样本空间股票在最近一年（新股为上市以来）的日均成交金额由高到低排名，剔除排名后50%的股票，然后对剩余股票按照日均总市值由高到低进行排名，选取排名在前300名的股票作为样本股。

沪深300指数的市值覆盖率高、与上证180指数及深证100指数等现有市场指数相关性高、样本股集中了市场中大量优质股票，因此，可以成为反映沪深两个市场整体走势的“晴雨表”。

五、股票a的标准差40%贝塔系数0.5

股票b的标准差20%贝塔系数1.5 问哪知股票的风险溢价更高？

列两个方程组，可以参考无风险套利推导公式++

参考文档

[下载：什么样的股票相关系数小.pdf](#)

[《同花顺怎么查一个股票的历史盈亏》](#)

[《股票术语秒板什么意思》](#)

[《股票的五档和明细是什么》](#)

[《海顺新材怎么总是跌》](#)

[下载：什么样的股票相关系数小.doc](#)

[更多关于《什么样的股票相关系数小》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/article/60767236.html>

