

多只股票的相关系数怎么算-请问在知道一个股票组合中三只股票的 系数和他们所占的比例的情况向，如何算出这个股票组合的 系数。-股识吧

一、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++

二、请问在知道一个股票组合中三只股票的 系数和他们所占的比例的情况向，如何算出这个股票组合的 系数。

用各自的 系数乘以各自的资金所占百分比，再求和即可。
证券之星问股

三、我想请教个问题，如果是一个投资组合里有三个资产，就比如是三个股票，那我们可以得到收益，平方差等。

三个资产 要画图就是画椭圆和直线的切点，直线代表等收益线，椭圆代表等方差线，同样找切点，这个确实有点复杂，但画出来的图很好看，像星系一样的

四、相关系数的计算公式是怎样得来的

相关系数介于区间 $[-1, 1]$ 内。

当相关系数为-1，表示完全负相关，表明两项资产的收益率变化方向和变化幅度完全相反。

当相关系数为+1时，表示完全正相关，表明两项资产的收益率变化方向和变化幅度完全相同。

当相关系数为0时，表示不相关。

五、某只股票要求的收益率为15%，收益率的标准差为25%，与市场投资组合收益率的相关系数为0.2，市场投资组合要

答：（1）计算甲、乙股票的必要收益率：由于市场达到均衡，则期望收益率 = 必要收益率
甲股票的必要收益率 = 甲股票的期望收益率 = 12%
乙股票的必要收益率 = 乙股票的期望收益率 = 15%
（2）计算甲、乙股票的 值：根据资产定价模型
甲股票： $12\% = 4\% + \beta \times (10\% - 4\%)$ ，则 $\beta = 1.33$
乙股票： $15\% = 4\% + \beta \times (10\% - 4\%)$ ，则 $\beta = 1.83$
（3）甲、乙股票的收益率与市场组合收益率的相关系数：
根据甲股票的收益率与市场组合收益率的相关系数 = $1.33 \times 0.2 = 0.266$
乙股票的收益率与市场组合收益率的相关系数 = $1.83 \times 0.2 = 0.366$
（4）组合的 系数、组合的风险收益率和组合的必要收益率：
组合的 系数 = $60\% \times 1.33 + 40\% \times 1.83 = 1.53$
组合的风险收益率 = $1.53 \times (10\% - 4\%) = 9.18\%$
组合的必然收益率 = $4\% + 9.18\% = 13.18\%$

参考文档

[下载：多只股票的相关系数怎么算.pdf](#)

[《股票改名st会停牌多久》](#)

[《股票改名st会停牌多久》](#)

[《股票多久可以买卖次数》](#)

[《联科科技股票中签后多久不能卖》](#)

[《股票abc调整一般调整多久》](#)

[下载：多只股票的相关系数怎么算.doc](#)

[更多关于《多只股票的相关系数怎么算》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/author/11426522.html>