

三只股票系数怎么算~如何分析两只股票的涨幅的相关系数？-股识吧

一、如何查看单个股票每年的 β 系数，求教详细过程，诚心感谢了

各个股票风险不同，比如银行股风险就比较小，取大盘平均风险系数为1，那某股票相对于大盘的风险系数就是贝塔系数，风险比大盘小，系数就小于1，反之，则大于1

二、兴达公司持有A.B.C三种股票构成的证券组合，其系数分别是1.8,1.5,1.7，在证券组合中所占比重为百分之50，百分之30，百分之20，股票的市场收益率为百分之15，无风险收益率为百分之12

$$R=12\%+(1.8*50\%+1.5*30\%+1.7*20\%)*15\%$$

三、如何分析两只股票的涨幅的相关系数？

首先你需要选择两只股票的涨跌数据，比如可以是向前为其三个月的数据，或者是一年的数据，然后把两只股票每天的涨跌数据 一一对应收集起来。

然后就可以采用简单的相关分析，甚至其他的统计分析方法分析两只股票的关系。不过说实话

中国的股票数据反映的并不是经济规律的真相，更多的是政策和市场信息的影响。

四、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

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

五、求助：《财务管理》计算公式！！！！？

1.单利终值 $F = P \times (1 + i \times n)$ 2.单利现值 $P = F / (1 + i \times n)$ 3.复利终值

$F = P(1+i)^n$ 4.复利现值 $P = F / (1+i)^n$

5.普通年金终值的计算（已知年金 A ，求终值 F ）

$F = A \times (F/A, i, n) = A \times$ 普通年金终值系数 6.偿债基金的计算

$A = F \times (A/F, i, n)$ 。

7.普通年金现值 $P = A \times (P/A, i, n) = A \times$ 普通年金现值系数 8.年资本回收额的计算

$A = P \times (A/P, i, n)$ 。

9.即付年金现值 $P = A \times (P/A, i, n) (1+i)$ $P = A \times [(P/A, i, n-1) + 1]$

10.递延年金终值 $F = A (F/A, i, n)$

式中，“ n ”表示的是 A 的个数，与递延期无关。

11.递延年金现值 计算方法一：先将递延年金视为 n 期普通年金，求出在 m 期普通年金现值，然后再折算到第一期期初： $P_0 = A \times (P/A, i, n) \times (P/F, i, m)$

式中， m 为递延期， n 为连续收支期数。

计算方法二：先计算 $m+n$ 期年金现值，再减去 m 期年金现值：

$P_0 = A \times [(P/A, i, m+n) - (P/A, i, m)]$ 计算方法三：

先求递延年金终值再折现为现值： $P_0 = A \times (F/A, i, n) \times (P/F, i, m+n)$

12.永续年金的现值 永续年金的现值可以看成是一个 n 无穷大后付年金的现值。

$P(n \rightarrow \infty) = A[1 - (1+i)^{-n}]/i = A/i$

以上希望能帮到你，是我从我学的财务管理教材里面筛选出来的。

六、求解这道题，关于风险资产投资组合，谢谢！

这是一道年金现值的问题。

年金为50,贴现率为6%，期限为3年。

$P = 50 \times (P/A, 6\%, 3) = 50 \times 2.673 = 133.7$

终值，是现在一定量的资金折算到未来某一时点说对应的价值。

通常记做“F”现值，是指未来某一时点上的一定量资金折算到现在所对应的价值，通常记做“P”年金，是指一定时期内每次等额收付的系列款项。

通常记做“A”假设*i*为利率（或者收益率，贴现率）

计算公式： $f=p(1+i)^n$ $P=F(1+i)^{-n}$ $F=A[(1+i)^n - 1] / i$ $P=A[1 - (1+i)^{-n}] / i$

由于输入法问题，^表示次方为了方便计算，通常还记做 $F=P(F/P, i, n)$ $P=F(F/P, i, n)$

$F=A(F/A, i, n)$ $P=A(P/A, i, n)$ 这些括号里的分别为复利终值系数，复利现值系数，年金终值系数，年金现值系数。

这些系数都是通过查表得到。

具体相关解释和系数表，一般在财务管理教材中都会有，因为是相当重要的基础工具。

参考文档

[下载：三只股票系数怎么算.pdf](#)

[《股票交易最快多久可以卖出》](#)

[《出财报后股票分红需要持股多久》](#)

[《股票改名st会停牌多久》](#)

[《只要钱多久能让股票不下跌吗》](#)

[《法院裁定合并重组后股票多久停牌》](#)

[下载：三只股票系数怎么算.doc](#)

[更多关于《三只股票系数怎么算》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/chapter/10896787.html>