

2只股票相关系数如何计算-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。 - 股识吧

一、假设市场只有两种股票A、B，其收益率标准差为0.25和0.6，与市场的相关系数分别为0.4和0.7，市场指数的平均

都是带公式的题嘛 (1) $A = A^* A / M = 0.4 * 0.25 / 0.1 = 1$ $B = B^* B / M = 0.7 * 0.6 / 0.1 = 4.2$ AB组合的 $= 0.5 * A + 0.5 * B = 2.6$ (2) $cov(A, B) = A^* B^* M^* M = 1 * 4.2 * 0.1 * 0.1 = 0.042$ (3) A股票预期收益率 = $RF + A^* (RM - RF) = 5\% + 1 * (15\% - 5\%) = 15\%$ B股票预期收益率 = $RF + B^* (RM - RF) = 5\% + 4.2 * (15\% - 5\%) = 47\%$ AB组合预期收益率 = $0.5 * 15\% + 0.5 * 47\% = 31\%$

二、两支股票的协方差怎么算啊

首先用简单的语言来说说什么叫做协方差，方差用来描述一组数据的波动或者分散程度；

方差实际上是方差的一种特殊情况，即主要变量为两个相同变量时。

协方差衡量两个变量的总体误差，具体计算公式可以百度.....利用公式可以计算出股票A的期望收益率为4.67%，B股票的期望收益率为22.33%，进一步能够计算能够得到协方差为1%。

这种知识类的在百度上搜一下，按照公式算就可以了。

对于公司有问题可以进一步提问。

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： $\{(5\%w)^2 + [10\%(1-w)]^2 + 2$

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

五、如何计算两个股票的相关系数(correlation)（急）

您的数据不够，无法计算。

需要有A股跟市场的相关系数0.1，B股跟市场的相关系数0.5，以及AB股之间的相关系数（未提供），才能算出AB组合跟市场的相关系数。

六、相关系数的计算公式是什么

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。

参考文档

[下载：2只股票相关系数如何计算.pdf](#)

[《做显卡的相关上市公司有哪些》](#)

[《50etf换手率多少》](#)

[《股票什么时候创造的》](#)

[《股票型基金怎么盈利模式》](#)

[下载：2只股票相关系数如何计算.doc](#)

[更多关于《2只股票相关系数如何计算》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/5018880.html>