

两种股票组合后的风险程度怎么算：证券组合的风险相关性？-股识吧

一、简述证券组合的风险

证券组合理论认为，证券组合的风险随着组合所包含证券数量的增加而降低，尤其是证券间关联性极低的多元化证券组合可以有效的降低非系统风险，使证券组合的投资风险趋向于市场平均风险水平。

因此，组合管理强调构成组合的证券应多元化。

在不卖空的情况下，证券组合的风险越小，特别是负完全相关的情况下，可获得无风险组合。

在不卖空的情况下，组合降低风险的程度由证券间的关联程度决定。

二、

三、多个证券组合，其风险和收益怎么求？

$0.3 \times 0.4 + 0.25 \times (-0.1) + 0.45 \times 0.15$ 这个就是你的期望收益啊求风险还需要计算收益率的方差。

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

五、证券组合的风险相关性？

简单点说，系统风险就是指整个市场的风险，比如经济衰退等这种对整个市场带来负面影响的风险，像美国爆发的次贷危机就属于系统风险 非系统风险就是指个股的风险，比如该公司经营不善之类的只对个股产生影响的风险

六、两种股票，系数为2和1.2。无风险报酬率为5%，投资组合的风险收益率为6%。计算投资组合的预期收益率

$E(R) = R_f + \beta * [E(R) - R_f]$ // 预期收益等于无风险收益加上风险溢价 = $5% + \beta * 6%$ 其中， $\beta(\text{portfolio}) = w_a * \beta_a + w_b * \beta_b$ // 投资组合的beta等于每种资产的beta按照其市值权重累加之和 题目里没有给出两种股票的价值权重 w_a ， w_b 。

如果我们假定投资组合中两种股票的市值相等， $w_a = w_b = 0.5$ ，则 $E(R) = 5% + (0.5 * 2 + 0.5 * 1.2) * 6% = 14.6%$

七、股票组合风险怎么算？急！

风险价值法(VAR)：VAR实际上是要回答在概率给定情况下，银行投资组合价值在下一阶段最多可能损失多少。

在风险管理的各种方法中，VAR方法最为引人注目。

细节你看看网站内容。

八、怎么算投资组合的风险

投资组合或对冲套利，用贝塔系统来评估风险的，你想做对冲套利可跟我说

参考文档

[下载：两种股票组合后的风险程度怎么算.pdf](#)

[《股票08年跌了多久》](#)

[《股票一般翻红多久》](#)

[《挂牌后股票多久可以上市》](#)

[《股票违规停牌一般多久》](#)

[《股票盘中临时停牌多久》](#)

[下载：两种股票组合后的风险程度怎么算.doc](#)

[更多关于《两种股票组合后的风险程度怎么算》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/read/35224851.html>