

# 负协方差的股票有哪些；（投资学）为什么低的相关系数可以降低风险?详细点。。。谢谢-股识吧

## 一、当两种股票完全负相关时,这两种股票的组合效应能不能分散风险

完全负相关的品种组合在一起不会选择作为分散风险组合 相反作为锁定风险组合就和外汇期货交易中的锁单效果类似 等待行情反转 择机解除锁仓 敝见 敬请交流

## 二、某一股票与市场组合的协方差是什么意思？

### 1.保守型投资组合。

采用这种类型的投资组合方式，其资金的分配情况应当是，将80%或全部的资金用于购买不同的具有中、长期投资价值的股票，而只将约20%或20%以下的少量资金用于对短线股票的炒作。

这种投资组合方式需要投资者选择那些有较高股息的股票作为投资对象，这可以使投资者在经济呈现稳定增长的情形下，从那些经营情况良好、投资回报安全稳定的公司的股票中，获取较为满意的投资回报。

但是，采用这种保守型的投资组合方式，也要求投资者时刻注意公司的经营情况的变化和国家有关的政策动向，因为任何一种股票都绝对不可能永葆青春，常胜不衰，它完全有可能在国家方针政策转向、产业结构调整、市场环境变化等因素的影响下由盛转衰，由盈转亏。

所以，保守型投资组合虽然可以较大限度地降低投资风险，但也并不是说就能够完全消除风险。

### 2.投机型投资组合。

这种投资组合方式正好与保守型投资组合方式相反；

是将大部分或全部的资金都用于投机性股票炒作的一种资金组合方式。

采用这种方式的盈利情况，基本上取决于投资者对各种股票涨跌形势的准确判断。如果投资者有较强的分析判断能力、充裕的时间以及敏锐的洞察力，则采用这种投资组合方式往往能够获得比其他形式的资金组合方式更为可观的利润和收益，但同时它也比其他的资金组合方式有着更大的风险性。

### 3.随机应变型投资组合。

这是投资者根据市场的具体情况来决定采用何种投资组合方式的一种投资方法。

这种方法认为，在股市不太活跃的情况下，应采用保守型投资组合，即将资金投入长到长线中，以获取较为稳定的收入；

而在股市十分活跃的情况下，应采用投机型投资组合，以便能从各种股票的跌涨差价中获取更大的收益。

这一投资组合方式因能够较好地适应股市的变化，而被多数投资者所采用，采用这一方法的关键一点，是投资者要有能力对股市的大势有一个比较准确的形势判断。

#### 4.市场分散型投资组合。

这是投资者根据不同的市场情况采用不同投资组合方式的一种投资方法。

这种方法认为，在有新股上市时，即将资金投入到一级市场上进行炒作；

在大势上涨时，即将资金投入到二级市场上进行炒作；

在无新股上市、大势下跌的情况下，即将资金投入到一级半市场上进行炒作。

这样，分散市场投资的组合型式，已被实践证明是可行的，而且已被好多投资者所采用。

### 三、如何判断独立电源组合是否有效？

用万用表测量两端电压为220v伏特，如果一段端电压低，比如说几十伏特，则判断是正极接地，如果是负的十几伏特，则判断为负极接地，万用表使用前应检查其完好无损坏，且再合格有效期内，电压档位再交流电压档位，接线段子为E和G，不要搞错就可以了，你试试看。

### 四、（投资学）为什么低的相关系数可以降低风险?详细点。。

。谢谢

投资组合理论中，衡量风险的标准就是方差（variance）。

对于有两支股票1和2的投资组合，整个组合的方差由股票1方差、股票2方差和两支股票的协方差组成。

当相关系数低、甚至小于0的时候，协方差就减小，导致整个投资组合的方差（即风险）减小。

相关系数介于-1和1之间，当相关系数为1时，两支股票没有对冲风险的效应，当相关系数为0甚至小于0时，协方差就为0或者为负值，可以大幅降低整个组合的风险

。

## 五、怎样才能看出哪些是绩优股,哪些是绩差股

绩优股就是业绩优良公司的股票。

但对于绩优股的定义国内外却有所不同。

在我国，投资者衡量绩优股的主要指标是每股税后利润和净资产收益率。

一般而言，每股税后利润在全体上市公司中处于中上地位，公司上市后净资产收益率连续三年显著超过10%的股票当属绩优股之列。

主要有以下特点：1、具有较高的投资价值：绩优股公司拥有资金、市场、信誉等方面的优势，对各种市场变化具有较强的承受和适应能力，绩优股的股价一般相对稳定且呈阶段上升趋势。

因此，绩优股受到投资者、尤其是从事长期投资的稳健型投资者的青睐。

2、回报率高、稳定：投资报酬率相当优厚稳定，股价波幅变动不大。

当多头市场来临时，它不会首当其冲而使股价上涨。

经常的情况是，其它股票已经连续上涨一截，绩优股才会缓慢攀升；

而当空头市场到来，投机股率先崩溃，其它股票大幅滑动时，绩优股往往仍能坚守阵地，不至于在原先的价位上过分滑降，具有典型的防守性特点。

而相反的，绩差股是指业绩较差的公司的股票。

这类上市公司或者由于行业前景不好，或者由于经营不善等，有的甚至进入亏损行列。

其股票在市场上的表现萎靡不振，股价走低，交投不活跃，年终分红也差。

投资者在考虑选择这些股票时，要有比较高的风险意识，切忌盲目跟风投机。

也可以通过每股税后利润判断是否是绩差股，一般来说，每股税后利润为负，且常年为负我们就说他是绩差股。

当然绩优股和绩差股也不是一层不变的，绩优股连续亏损严重也会变为绩差股，绩差股同时也可以连续盈利变为绩优股。

参考绩优股：[http://baike.baidu.com/link?url=y4xyZVvawzC8wKLX94aFzaTA2rf\\_OU37lHkZ6ECLuEMfey903LZhJrAU1ivb7-4NtZ9Tt-k9539eldrnmSFBcK](http://baike.baidu.com/link?url=y4xyZVvawzC8wKLX94aFzaTA2rf_OU37lHkZ6ECLuEMfey903LZhJrAU1ivb7-4NtZ9Tt-k9539eldrnmSFBcK)

## 六、协方差在证券收益与风险的计算中有什么作用

展开全部协方差是指两个量的相关程度的指标。

如果衡量证券收益的话，比如说你买的某个股票和大盘的收益算出来的协方差，这个就能说明你的股票和大盘的变动是否正相关，负相关，或者不相关。

## 七、a股市场有没有带有明显负相关性的股票

答：目前A股没有，但是美股有，美股有专门代表做空预期的空头指数，还有对冲基金。

### 参考文档

[下载：负协方差的股票有哪些.pdf](#)

[《股票交易停牌多久》](#)

[《二级市场高管增持的股票多久能卖》](#)

[《股票订单多久能成交》](#)

[《股票多久能买完》](#)

[下载：负协方差的股票有哪些.doc](#)

[更多关于《负协方差的股票有哪些》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/59285178.html>