

# 股票x与股票y的相关系数怎么影响收益率 - 如何通过股票走势图求出股票的期望收益率？-股识吧

## 一、股票型基金收益率的影响因素有哪些

影响股票型基金收益率的主要因素是股票持仓比例、持仓股票的价格涨跌幅度、持仓股票的占比（集中度）。

如果仓位过重。

市场下跌时，损失比例就相对大，例如当80%仓位，假定下跌幅度与大盘同步-5%，持仓亏损理论上达到4%，如果仓位只有60%，亏损是3%，还是能跑赢大盘。

另外，与基金赎回也有很大关系，市场的“羊群效应”对基金操作非常不利。

例如上涨时，多数人会在涨幅近顶时买入基金，此时，基金已经不好布局了（目标股涨幅较大，不宜加仓），但不断增加的资金反而降低了基金仓位，进退两难耶。

最坏的情况是下跌，越跌赎回压力越大，迫使基金被动减仓，进而造成股价更大的下跌，特别是市场在底部阶段，基金投资人大部分（95%）不会选择增持（买入），稍有风吹草动，都选择赎回，这些都严重影响激进的收益率。

## 二、（单选）X股票和Y股票今天在市场上以相同的价格出售。X股票的要求收益率是12%，Y股票的要求收益率

B

## 三、股票x和y的期望收益率是多少

20%和10%解析：股票的期望收益率等于各种可能的收益率以概率为权数的加权平均。

$$E_x = 0.2 \times (-20\%) + 0.5 \times 18\% + 0.3 \times 50\% = 20\% ;$$

$$E_y = 0.2 \times (-15\%) + 0.5 \times 20\% + 0.3 \times 10\% = 10\% .$$

## 四、在计算出股票之间的相关性之后，这样一个相关系数对于股民来讲有什么用，我们可以根据这个数字得到什么？

简单通俗解释：每个股票组合投资都是风险敞口的，而如果你股票之间相关性较大，则等于把鸡蛋放在一个篮子里，那么一旦你投资相关性非常强的股票组合不是市场热点（甚至是市场重灾区，比如，现在日本福岛核爆炸，那么核电以及核电配套设备公司相关性强，但是目前在市场受到核电利空打击，你的组合反而面临较大风险）的话，难以达到市场收益甚至亏损。

即便你找的都是贝塔系数较高的股票，但是由于自身相关，很可能是大盘强他们弱，仅仅由于其相关性强，而同时受到一个因素干扰。

## 五、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++

## 六、股票收益率与股票价格的关系

正比关系 股利收益率，又称获利率，是指股份公司以现金形式派发的股息或红利与股票市场价格的比率其计算公式为：

该收益率可用于计算已得的股利收益率，也可用于预测未来可能的股利收益率。

股票收益率 = 收益额 / 原始投资额

## 七、如何通过股票走势图求出股票的期望收益率？

假定投资者将无风险的资产和一个风险证券组合再构成一个新的证券组合，投资者可以在资本市场上将以不变的无风险的资产报酬率借入或贷出资金。

在这种情况下，如何计算新的证券组合的期望报酬率和标准差？假设投资于风险证券组合的比例（投资风险证券组合的资金/自有资金）为Q，那么1-Q为投资于无风险资产的比例。

无风险资产报酬率和标准差分别用 $r_{\text{无}}$ 、 $\sigma_{\text{无}}$

表示，风险证券组合报酬率和标准差分别用 $r_{\text{风}}$ 、 $\sigma_{\text{风}}$ 表示，因为无风险资产报酬率是不变的，所以其标准差应等于0，而无风险的报酬率和风险证券组合的报酬率不存在相关性，即相关系数等于0。

那么新的证券组合的期望报酬率和标准差公式分别为： $r_P = Qr_{\text{风}} + (1-Q)r_f$

## 参考文档

[下载：股票x与股票y的相关系数怎么影响收益率.pdf](#)

[《法院询价评估股票要多久》](#)

[《股票一般翻红多久》](#)

[《一只股票多久才能涨》](#)

[《行业暂停上市股票一般多久》](#)

[《股票转账多久到账》](#)

[下载：股票x与股票y的相关系数怎么影响收益率.doc](#)

[更多关于《股票x与股票y的相关系数怎么影响收益率》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/store/37612701.html>