

如果股票完全正相关--当两种股票完全负相关时，可以分散掉非系统性风险；-股识吧

一、在股票市场中，当两种股票完全负相关时，为什么所有的风险都可以分散掉？

因为负负得正！在资金安全保险的同时你的预期收益也要大幅度降低。

二、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

$\beta = 1.0$ 表示为平均风险股票。

如果 β 为 1，则市场上涨 10%，股票上涨 10%；

市场下滑 10%，股票相应下滑 10%。

如果 β 为 1.1，市场上涨 10%时，股票上涨 11%，；

市场下滑 10%时，股票下滑 11%。

如果 β 为 0.9，市场上涨 10%时，股票上涨 9%；

市场下滑 10%时，股票下滑 9%。

贝塔系数衡量股票收益相对于业绩评价基准收益的总体波动性，是一个相对指标。

越高，意味着股票相对于业绩评价基准的波动性越大。

大于 1，则股票的波动性大于业绩评价基准的波动性。

反之亦然。

扩展资料Beta的用途：计算资本成本，做出投资决策（只有回报率高于资本成本的项目才应投资）；

计算资本成本，制定业绩考核及激励标准；

计算资本成本，进行资产估值（Beta是现金流贴现模型的基础）；

确定单个资产或组合的系统风险，用于资产组合的投资管理，特别是股指期货或其他金融衍生品的避险（或投机）。

Beta系数有一个非常好的线性性质，即，资产组合的Beta就等于单个资产的Beta系数按其在组合中的权重进行加权求和的结果。

参考资料来源：股票百科—— β 系数

三、两种股票完全正相关，则该两种股票的组合效应会怎样？

正相关的意思是变动的方向一致意思是一个股票涨
另外一个股票也涨这样的投资组合 其实就是博命的组合 要涨两个都涨 要跌
两个都跌 当然这样就起不到所谓的风险分散的作用了

四、当两种股票完全负相关时，可以分散掉非系统性风险；

完全正确！

五、关于证券投资学的问题，一个判断题。两种完全正相关的股票组成的证券组合，不能抵消任何风险。答案说这句

系统风险是认识时候都不能消除的，只能降低。
对于非系统性风险是针对变动方向相反的股票组合而言的，完全负相关的才能够消除，正相关的而只能加强，而不能降低非系统性风险

参考文档

[下载：如果股票完全正相关.pdf](#)
[《挂单多久可以挂股票》](#)
[《联科科技股票中签后多久不能卖》](#)
[《股票涨30%需要多久》](#)
[《股票盘中临时停牌多久》](#)
[下载：如果股票完全正相关.doc](#)
[更多关于《如果股票完全正相关》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/subject/29695934.html>