

# 股票收益相关性分析三级目录有哪些\_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、什么是三级目录

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： $\{(5\%w)^2 + [10\%(1-w)]^2 + 2 * 5\% * 10\% * (-1) * (1-w)w\}^{(1/2)} = 0$ 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： $225w^2 - 300w + 100 = 0$ 或 $(15w - 10)^2 = 0$ 则 $w = 2/3$ 则，该投资组合的收益率为： $2\% * (2/3) + 5\% * (1/3) = 9\%/3 = 3\%$

## 二、投资学习题：股票提供的期望收益率为18%，标准差为22%。黄金提供的期望收益率为10%，标准差为30%。

- 1) 选择单一资产投资时，黄金由于收益率低，风险高，所以不会有人选择投资黄金。
- 2) 由于黄金与股票的相关系数为1（即完全正相关），黄金与股票的投资组合并不能抵消风险，所以投资组合中不会持有黄金。  
上述假设并不能代表证券市场的均衡，因为股票收益率更高，风险更小。

## 三、什么是三级目录

我的理解是你有一篇文章。

第一章.....此为一级目录 第一章第一节.....此为二级目录

第一章第一节第一小部分.....此为三级目录 1..... 1.1..... 1.1.1.....

## 四、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++

## 五、股票投资分析的基本方法有哪些？

先确定你要投资哪一类股票。  
因为别人不知道你的投资方向。  
股票小白，不要急于投入资金。  
想好了要投资哪一类股票，可以关注一下股票市场的指数基金。  
比如50指数基金，100指数基金，180指数基金，300指数基金。  
这些指数基金涵盖的股票范围不同，选一个与你投资范围接近的指数基金。  
逐步的买入。

## 六、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： $\{(5\%w)^2 + [10\%(1-w)]^2 + 2 * 5\% * 10\% * (-1) * (1-w)w\}^{(1/2)} = 0$ 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： $2\% * (2/3) + 5\% * (1/3) = 9\%/3 = 3\%$

## 七、投资什么基金可以没风险

想投资 外汇 黄金 之类。  
可以找我咨询 qq 8419344

## 八、计算证券收益风险及相关系数

先求单个证券的期望收益和标准差，因为相关系数为零，所以直接根据两个证券的比例计算组合的期望收益和标准差。

一楼说的对，没有权重没法计算。

这是最基本的计算，只要学过是肯定会做的。

10分就想要详细过程，还是死心吧。

## 参考文档

[下载：股票收益相关性分析三级目录有哪些.pdf](#)

[《股票实盘一般持多久》](#)

[《股票停牌重组要多久》](#)

[《股票多久才能反弹》](#)

[《股票日线周线月线时间多久》](#)

[下载：股票收益相关性分析三级目录有哪些.doc](#)

[更多关于《股票收益相关性分析三级目录有哪些》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/book/58715934.html>