

股票无风险布局是什么、股市有风险，所谓的风险具体是什么??-股识吧

一、什么基金好？

我个人感觉余额宝好

二、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： $225w^2 - 300w + 100 = 0$ 或 $(15w - 10)^2 = 0$ 则 $w = 2/3$ 则，该投资组合的收益率为： $2\% * (2/3) + 5\% * (1/3) = 9\%/3 = 3\%$

三、无套利定价方法与风险中性定价方法的联系与区别是什么？

一、区别在于两种定价方法思路不同 无套利定价法的思路：其基本思路为：构建两种投资组合，让其终值相等，则其现值一定相等；
否则的话，就可以进行套利，即卖出现值较高的投资组合，买入现值较低的投资组合，并持有到期末，套利者就可赚取无风险收益。

风险中性定价法的基本思路：假定风险中性世界中股票的上升概率为 P ，由于股票未来期望值按无风险利率贴现的现值必须与股票目前的价格相等，因此可以求出概率 P 。

然后通过概率 P 计算股票价格 二、联系 总的来说两种种定价方法只是思路不同，但是结果是一样的，并且风险中性定价法是在无套利分析的基础上做出了所有投资者都是风险中性的假设。

四、股票买什么样的没风险

有主力资金关注的就没风险

五、在我国证券投资中无风险投资具体包括哪些？

严格的说，任何投资都是有风险的，只是风险大小的问题，（希腊国家差不多破产）风险相对较小的，银行存款、国债。

六、股市有风险，所谓的风险具体是什么??

权证是股市中最大的风险，别的都不是太大的问题，只要不买涨幅过高的股，长期持有都会赚钱的。

参考文档

[下载：股票无风险布局是什么.pdf](#)

[《股票型基金需要多久》](#)

[《一般股票持有多久才能赚钱》](#)

[《吉林银行股票多久上市》](#)

[《卖完股票从证券里多久能取出来》](#)

[下载：股票无风险布局是什么.doc](#)

[更多关于《股票无风险布局是什么》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/73429735.html>