

为什么股票收益率相关系数为0；为什么净资产收益率越接近于10%，每股收益就越接近于0-股识吧

一、股票收益率的方差怎么求、相关系数怎么出来的。

(1) A股票收益率的期望值 = $(4\% - 2\% + 5\% + 6\% - 3\%) / 5 = 2\%$ A股票收益率的标准差 = 4.18% B股票收益率的期望值 = $10\% \times 0.3 + 20\% \times 0.3 - 8\% \times 0.4 = 5.8\%$ B股票收益率的标准差 = 11.91% (2) A、B股票的协方差 = A、B股票的相关系数 \times A股票收益率的标准差 \times B股票收益率的标准差 = $0.8 \times 4.18\% \times 11.91\% = 0.40\%$ (3) 投资组合的方差 = $0.3 \times 0.3 \times 4.18\% \times 4.18\% + 2 \times 0.3 \times 0.7 \times 0.40\% + 0.7 \times 0.7 \times 11.91\% \times 11.91\% = 0.88\%$ (4) 投资组合的贝他系数 = $0.5 \times 9.38\% / 15\% = 0.31$ 假设B股票的贝他系数为b，则： $0.3 \times 0.4 + 0.7 \times b = 0.31$ 解得：b = 0.27

1、男人和女人，决定是什么关系，通常是三秒钟的事情。

一见钟情否，通常只要一秒钟。

2、一段持久的爱情，肯定是双赢的，而且是平衡的，一旦有天失衡了，就是关系破裂的时候。

3、一个走向成熟的女人，可以没有像样的衣服，但是不能没有像样的包包，因为它会给女人安全感。

爱情可能背叛你，但是包包却永远不会。

4、选择一个男人的时候，设法了解他和母亲以及初恋的情况。

男人的母亲和初恋女孩，这两个女人已经决定了他的爱情观。

5、女人总想找一个自己欣赏的，比自己更强大的男人。

那样的男人都在塔尖上，大多数踮着脚尖都够不着，够着了可能因为争抢而摔死。

6、优等男早都被占坑了，你得赶紧占一个。

饰品 ptisys.com/list.php?catid=1705

7、别跟有处女情结的男人耗，这样的男人，不是自大就是自卑。

二、未预测到的宏观经济事件对股票收益率影响的期望为0，为什么啊

宏观经济对股市有影响 但是宏观经济也不明朗的时候 就无所谓期望值 而且股市是提前反应经济的 相互制约

三、为什么净资产收益率越接近于10%，每股收益就越接近于0

没有这样的说法。

看看计算公式：净资产收益率=净利润/净资产每股收益=净利润/总股本不会出现你说的情况。

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、净资产收益率为什么是0

六、相关系数等于0 为什么不能判断是否独立

相关系数只是判断只有有线性关系平方就没线性了

七、知道两只股票的收益率求相关系数

超额收益一般指超过市场平均水平的收益，相关系数是2个股票超额收益变动的一致性、同步性，一般用线性回归方法来求解。

八、净资产收益率为什么是0

展开全部净资产收益率是净利润与平均股东权益的百分比，也就是公司每股收益除以每股净资产得到的百分比率。

如果净资产收益的值是0，说明这家公司的净利润是0，这家企业就是亏损企业。

1.净资产收益率（英文简称ROE），又称股东权益报酬率、净值报酬率、权益报酬率，是衡量企业获利能力的重要指标。

2.企业资产包括了两部分：一部分是股东的投资，即所有者权益（它是股东投入的股本，企业公积金和留存收益等的总和）另一部分是企业借入和暂时占用的资金。企业适当的运用财务杠杆可以提高资金的使用效率，借入的资金过多会增大企业的财务风险，但一般可以提高盈利，借入的资金过少会降低资金的使用效率。

净资产收益率是衡量股东资金使用效率的重要财务指标。

九、为什么某股票的预期收益率等于无风险收益率时，β系数等于0？

学过capm公式吗？ $(r_i) = r_F + [E(r_M) - r_F] \beta_i$ 要使预期收益率等于0，只有风险溢价等于0，也就是只有beta是0.但事实上任何投资品种都有风险溢价，你这个问题都不成立哦

参考文档

[下载：为什么股票收益率相关系数为0.pdf](#)

[《股票一般多久买入卖出》](#)

[《一般股票买进委托需要多久》](#)

[《委托股票多久时间会不成功》](#)

[《股票卖的钱多久到》](#)

[下载：为什么股票收益率相关系数为0.doc](#)

[更多关于《为什么股票收益率相关系数为0》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/chapter/62009501.html>