

## 股票a和股票b的值怎么求、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、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： $2\% * (2/3) + 5\% * (1/3) = 9\%/3 = 3\%$

### 二、西方经济学微观经济学，例题1中，A股票的理论价格的计算求讲解

股票的预期收益率  $E(R_i) = R_f + [E(R_m) - R_f] \beta_i$  其中： $R_f$ ：

无风险收益率——一般用国债收益率来衡量  $E(R_m)$ ：市场投资组合的预期收益率  $\beta_i$ ：  
：投资的 值——市场投资组合的 值永远等于1；风险大于平均资产的投资 值大于1，反之小于1；无风险投资 值等于0

### 三、沪市A、B股 价格比是怎样计算出来的？

先把B股的股价转换成人民币，也就是  $1.75 * 6.8278 = 11.94865$

然后用A股的股价除以这个价钱  $27.80$  除以  $11.94865$  就等于  $2.33$  这个就是AB股价格比

### 四、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： $2\% * (2/3) + 5\% * (1/3) = 9\%/3 = 3\%$

## 五、如何解释一只股票的Beta值接近于1

beta值，是一种风险指数，用来衡量个别股票或股票基金相对于整个股市的价格波动情况。

值越高，意味着股票相对于业绩评价基准的波动性越大，反之亦然。

当 $\beta = 1$ 时，表示该股票的收益和风险与大盘指数收益和风险一致；当 $\beta > 1$ 时，表示该股票收益和风险均大于大盘指数的收益和风险。

## 六、股票指数怎样计算？

实际中，一般用单个股票资产的历史收益率对同期指数（大盘）收益率进行回归，回归系数就是Beta系数。

使用大盘的收益率和你选择的个股的收益率，在同花顺中可以导出excel中，然后再用数据分析进行回归分析，得到的斜率就是Beta系数。

## 七、股票B值是什么

你说的是股票贝塔值吧？贝塔系数是量度股票投资系统风险的指标。

所谓系统风险是指股票投资中没有办法通过分散投资来减低的风险，即是由整体经济状况和整体市场因素所造成的风险（如利率变动），与个别公司没有直接的关系。与其相对的是非系统风险，即由个股的个别因素（如会计丑闻）所造成的风险，是可以通过分散投资来消弭掉的。

金融学运用了贝塔系数来计算在一只股票上投资者可期望的合理风险回报率：

个股合理回报率 = 无风险回报率 +  $\beta$  × (整体股市回报率 - 无风险回报率) 贝塔系数 =

1, 代表该个股的系统风险等同大盘整体系统风险, 即受整体经济因素影响的程度跟大盘一样;

贝塔系数 > 1 则代表该个股的系统风险高于大盘, 即受整体经济因素影响的程度甚于大盘。

贝塔系数越高, 投资该股的系统风险越高, 投资者所要求的回报率也就越高。

高贝塔的股票通常属于景气循环股(cyclicals), 如地产股和耐用消费品股;

低贝塔的股票亦称防御类股(defensive

stocks), 其表现与经济景气的关联度较低, 如食品零售业和公用事业股。

个股的贝塔系数可能会随着大盘的升或跌而变动, 有些股票在跌市中可能会较在升市具更高风险。

## 八、股票的值怎么算?

(Beta)系数-----BETA(N)

返回当前证券N周期收益与大盘收益相比的贝塔系数.

## 参考文档

[下载：股票a和股票b的值怎么求.pdf](#)

[《股票实盘一般持多久》](#)

[《一只股票从增发通告到成功要多久》](#)

[下载：股票a和股票b的值怎么求.doc](#)

[更多关于《股票a和股票b的值怎么求》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/11625454.html>