

股票收益率的相关系数怎么算关于股票平均收益率的求法？-股识吧

一、股票收益率怎么求

你想知道谁的收益率？如果是数据中每天的收益率，就是最后一项的涨跌幅。
如果是买卖收益率，就是：卖出获得的钱÷买入花的钱-1=股票买卖的收益率以此类推谢谢你的提问

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

三、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。

四、关于股票平均收益率的求法？

因为申购整数是一千，所有十亿除一千，（股价）等于一百万，再计算资金可以获取的签号，所以两万亿除一万，等于两亿。

前者除后者就是0，5%。

这是中签率。

手机回答，乱了点

五、相关系数的计算公式是怎样得来的

相关系数介于区间 $[-1, 1]$ 内。

当相关系数为-1，表示完全负相关，表明两项资产的收益率变化方向和变化幅度完全相反。

当相关系数为+1时，表示完全正相关，表明两项资产的收益率变化方向和变化幅度完全相同。

当相关系数为0时，表示不相关。

六、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++

参考文档

[下载：股票收益率的相关系数怎么算.pdf](#)

[《股票要多久才能学会》](#)

[《买股票要多久才能买到》](#)

[《股票亏钱多久能结束》](#)

[下载：股票收益率的相关系数怎么算.doc](#)

[更多关于《股票收益率的相关系数怎么算》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/21913625.html>