

【第7章補足資料】

表 7.3, 表 7.4, 図 7.1 の原データ(●●版 P.135 など参照)

株価の分析

年	AmTbco	ATT	USSteel	GM	At-Tpk-Sf	CocaCola	Borden	Firestone	SharonS.
1937	-0.305	-0.173	-0.318	-0.477	-0.457	-0.065	-0.319	-0.400	-0.435
1938	0.513	0.098	0.285	0.714	0.107	0.238	0.076	0.336	0.238
1939	0.055	0.200	-0.047	0.165	-0.424	-0.078	0.381	-0.093	-0.295
1940	-0.126	0.030	0.104	-0.043	-0.189	-0.077	-0.051	-0.090	-0.036
1941	-0.280	-0.183	-0.171	-0.277	0.637	-0.187	0.087	-0.194	-0.240
1942	-0.003	0.067	-0.039	0.476	0.865	0.156	0.262	1.113	0.126
1943	0.428	0.300	0.149	0.225	0.313	0.351	0.341	0.580	0.639
1944	0.192	0.103	0.260	0.290	0.637	0.233	0.227	0.473	0.282
1945	0.446	0.216	0.419	0.216	0.373	0.349	0.352	0.229	0.578
1946	-0.088	-0.046	-0.078	-0.272	-0.037	-0.209	0.153	-0.126	0.289
1947	-0.127	-0.071	0.169	0.144	0.026	0.355	-0.099	0.009	0.184
1948	-0.015	0.056	-0.035	0.107	0.153	-0.231	0.038	0.000	0.114
1949	0.305	0.038	0.133	0.321	0.067	0.246	0.273	0.223	-0.222
1950	-0.096	0.089	0.732	0.305	0.579	-0.248	0.091	0.650	0.327
1951	0.016	0.090	0.021	0.195	0.040	-0.064	0.054	-0.131	0.333
1952	0.128	0.083	0.131	0.390	0.434	0.079	0.109	0.175	0.062
1953	-0.010	0.035	0.006	-0.072	-0.027	0.067	0.210	-0.084	-0.048
1954	0.154	0.176	0.908	0.715	0.469	0.077	0.112	0.756	0.185
平均	0.066	0.062	0.146	0.173	0.198	0.055	0.128	0.190	0.116
SD	0.231	0.121	0.292	0.309	0.358	0.203	0.170	0.383	0.282

相関係数マトリクス

	AmTbco	ATT	USSteel	GM	At-Tpk-Sf	CocaCola	Borden	Firestone	SharonS.
AmTbco	1.000								
ATT	0.768	1.000							
USSteel	0.424	0.530	1.000						
GM	0.686	0.652	0.693	1.000					
At-Tpk-Sf	0.197	0.186	0.425	0.466	1.000				
CocaCola	0.687	0.407	0.224	0.462	0.177	1.000			
Borden	0.618	0.704	0.210	0.396	0.344	0.327	1.000		
Firestone	0.452	0.546	0.613	0.761	0.741	0.381	0.448	1.000	
SharonS.	0.556	0.611	0.510	0.421	0.447	0.379	0.364	0.490	1.000

【第7章補足資料】

表 7.5 さまざまなポートフォリオの評価(f) (書籍版 p.138 参照)

重率 x	平均 e	(分散 σ^2)	標準偏差 σ	f
0.00	0.055	0.041	0.203	-0.05661
0.05	0.062	0.039	0.197	-0.04604
0.10	0.069	0.037	0.192	-0.03640
0.15	0.077	0.036	0.190	-0.02774
0.20	0.084	0.036	0.189	-0.02011
0.25	0.091	0.036	0.190	-0.01352
0.30	0.098	0.037	0.193	-0.00795
0.35	0.105	0.039	0.197	-0.00337
0.40	0.112	0.041	0.204	0.00030
0.45	0.119	0.045	0.212	0.00313
0.50	0.127	0.049	0.221	0.00523
0.55	0.134	0.053	0.231	0.00667
0.60	0.141	0.059	0.242	0.00754
0.65	0.148	0.065	0.255	0.00791
0.70	0.155	0.072	0.268	0.00786
0.75	0.162	0.079	0.282	0.00745
0.80	0.170	0.088	0.296	0.00672
0.85	0.177	0.097	0.311	0.00572
0.90	0.184	0.106	0.326	0.00448
0.95	0.191	0.117	0.342	0.00304
1.00	0.198	0.128	0.358	0.00142