

P. 41

$$\mu_A = E[R_A] = \frac{2\% + 3\% + 4\%}{3} = 3\%$$

$$\mu_B = E[R_B] = \frac{-1\% + 5\% + 2\%}{3} = 2\%$$

パーセントを小数に直す。

$$\text{Var}[R_A] = \frac{(2\% - 3\%)^2 + (3\% - 3\%)^2 + (4\% - 3\%)^2}{3} = 0.00007\cdots$$

$$\text{Var}[R_B] = \frac{(-1\% - 2\%)^2 + (5\% - 2\%)^2 + (2\% - 2\%)^2}{3} = 0.0006\cdots$$

$$\sigma_{R_A} = \sqrt{0.00007\cdots} = 0.008165\cdots \doteq 0.82\%$$

$$\sigma_{R_B} = \sqrt{0.0006\cdots} = 0.024495\cdots \doteq 2.45\%$$

パーセントを小数に直す。

$$\text{Cov}[R_A, R_B] = \frac{(2\% - 3\%)(-1\% - 2\%) + (3\% - 3\%)(5\% - 2\%) + (4\% - 3\%)(2\% - 2\%)}{3}$$

$$= 0.0001$$

$$\rho_{R_A R_B} = \frac{0.0001}{0.008165 \times 0.024495} \doteq 0.5$$

エクセルで計算すると  
ちょうど0.5になります。