

# 股票间相关性怎么计算公式，证券相关公式-股识吧

## 一、股票上的指标公式是什么？

技术指标有好多，在此就简要的列举几个，全当是抛砖引玉。

### DMA指标

DMA指标利用两条不同期间的平均线，计算差值之后，再除以基期天数。它是两条基期不同平均线的差值，由于其是将短期均线与长期均线进行了协调，也就是说它滤去了短期的随机变化和长期的迟缓滞后，使得其数值能更准确、真实、客观地反映股价趋势。

故它是一种反映趋势的指标 应用法则： DMA是两条基期不同平均线差值。实线向上交叉虚线，买进。

实线向下交叉虚线，卖出。

DMA 也可观察与股价的背离。

RSI指标 相对强弱指数是通过比较一段时期内的平均收盘涨数和平均收盘跌数来分析市场买沽盘的意向和实力，从而作出未来市场的走势。

(1)计算公式和方法  $RSI = [上升平均数 \div (上升平均数 + 下跌平均数)] \times 100$

应用法则： RSI 值于 0%-100%之间呈常态分配。

当6日RSI 值在94% 以上时，股市呈超买现象，若出现 M头为卖出时机；

当6日RSI 值在 13%以下时，股市呈现超卖现象，若出现 W底为买进时机。

当快速RSI 由下往上突破慢速RSI 时，为买进时机；

当慢速RSI 由上往下跌破快速RSI 时，为卖出时机。

## 二、数据相关性分析原理是？公式？假如我有2个变量或者3个变量、多个变量，如何计算？

建议先对你的数据做个正态性检验，这个是相关分析的基本条件，下来做个散点图，可以初步判断变量之间的是否具有相关性。

相关系数的定义：相关系数最早源自教育研究中，常涉及到两个事物(变量)的相互关系问题，例如，学习成绩与非智力因素的关系，数学成绩与物理成绩的关系，男女生学习成绩的关系，等等。

其关系表现为以下三种变化：

第一，正相关，一个变量增加或减少时，另一个变量也相应增加或减少；

第二，负相关，一个变量增加或减少时，另一个变量却减少或增加；第三，无相关

，说明两个变量是独立的，即由一个变量值，无法预测另一个变量值。  
统计学中，就用“相关系数”来从数量上描述两个变量之间的相关程度，用符号“r”来表示。

相关系数取值范围限于：-1 r +1 相关系数表示的意义：相关系数(r) 0.00  
0.00... ± 0.3 ± 0.30... ± 0.50 ± 0.50... ± 0.80 ± 0.80... ± 1.00 相关程度 无相关 微正负相关  
实正负相关 显著正负相关 高度正负相关 通过系统中的“相关分析”，我们就可以对多只货币币种之间的相关、交叉关系进行定量分析。

如果交易者希望分散他/她的投资组合，或者想加码但是不想投资在同一个货币对，或者仅仅想了解他们的交易风险有多大，或者仅为了寻找相关系数微正负相关的货币对建立品种组合池，那么相关性分析可以提供不错的帮助。

在表中随便选择一个空白处，输入函数“CORREL(array1,array2)”，其中：Array1 第一组数值单元格区域。

Array2 第二组数值单元格区域。

计算得到的数值就是EURESD和GBPUSD的相关系数，当然你也可以同样方法计算货币对的振幅值相关性。

望采纳

### 三、股票AMA 是怎么计算的？

已知AMA，反算价格水平x的公式推导 我是在 红三兵私募

找到的求使AMA发出买入信号时的价格水平x，其中：

AMA计算公式：AMA=AMA[1]+ C\*(x-AMA[1]) 则该问题为求x最小值，使：AMA-min(AMA[1],AMA[2],AMA[3]) filter(其中filter已知)

即求x，使得AMA=filter+min(AMA[1],AMA[2],AMA[3])，=> AMA[1]+C\*(x-AMA[1])=AMA => AMA[1]+C\*(x-AMA[1])-AMA=0 ——式

其中C=(smooth)^2=[ER\*(fastest-slowest)+slowest]^2 令 F=fastest-

slowest，S=slowest，则C=(ER\*F+S)^2 ——式 其中:ER=(x-

CLOSE[n])/[前N-1日价格移差绝对值之和+abs(x-CLOSE[1])]

如果x>=CLOSE[1]，则令：B=前N-1日价格移差绝对值之和-CLOSE[1]，如果x

### 四、求助：《财务管理》计算公式！！！！？

1.单利终值  $F = P \times (1 + i \times n)$  2.单利现值  $P = F / (1 + i \times n)$  3.复利终值

$F = P (1+i)^n$  4.复利现值  $P = F / (1+i)^n$

5.普通年金终值的计算（已知年金A，求终值F）

$F = A \times (F/A, i, n) = A \times$  普通年金终值系数 6. 偿债基金的计算

$A = F \times (A/F, i, n)$ 。

7. 普通年金现值  $P = A \times (P/A, i, n) = A \times$  普通年金现值系数 8. 年资本回收额的计算

$A = P \times (A/P, i, n)$ 。

9. 即付年金现值  $P = A \times (P/A, i, n) (1+i)$   $P = A \times [(P/A, i, n-1) + 1]$

10. 递延年金终值  $F = A (F/A, i, n)$

式中，“n”表示的是A的个数，与递延期无关。

11. 递延年金现值 计算方法一：先将递延年金视为n期普通年金，求出在m期普通年金现值，然后再折算到第一期期初： $P_0 = A \times (P/A, i, n) \times (P/F, i, m)$

式中，m为递延期，n为连续收支期数。

计算方法二：先计算m+n期年金现值，再减去m期年金现值：

$P_0 = A \times [(P/A, i, m+n) - (P/A, i, m)]$  计算方法三：

先求递延年金终值再折现为现值： $P_0 = A \times (F/A, i, n) \times (P/F, i, m+n)$

12. 永续年金的现值 永续年金的现值可以看成是一个n无穷大后付年金的现值。

$P(n \rightarrow \infty) = A[1 - (1+i)^{-n}]/i = A/i$

以上希望能帮到你，是我从我学的财务管理教材里面筛选出来的。

## 五、如何得到2只股票的相关性？有无软件指标或算法？

个股之间没有太多的相关性，只有个股与大盘存在相关性

## 六、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。

## 七、证券相关公式

标准差也就是风险。

他不仅取决于证券组合内各证券的风险，还取决于各个证券之间的关系。

投资组合的标准差计算公式为  $P=W_1 \sigma_1+W_2 \sigma_2$  各种股票之间不可能完全正相关，也不可能完全负相关，所以不同股票的投资组合可以减低风险，但又不能完全消除风险。

一般而言，股票的种类越多，风险越小。

关于三种证券组合标准差的简易算法：根据代数公式： $(a+b+c)^2=(a^2+b^2+c^2+2ab+2ac+2bc)$  第一步1，将A证券的权重  $\times$  标准差，设为A，2，将B证券的权重  $\times$  标准差，设为B，3，将C证券的权重  $\times$  标准差，设为C，第二步将A、B证券相关系数设为X将A、C证券相关系数设为Y将B、C证券相关系数设为Z展开上述代数公式，将x、y、z代入，即可得三种证券的组合标准差= $(A^2+B^2+C^2+2XAB+2YAC+2ZBC)$  的1/2次方。

## 八、在计算出股票之间的相关性之后，这样一个相关系数对于股民来讲有什么用，我们可以根据这个数字得到什么？

简单通俗解释：每个股票组合投资都是风险敞口的，而如果你股票之间相关性较大，则等于把鸡蛋放在一个篮子里，那么一旦你投资相关性非常强的股票组合不是市场热点（甚至是市场重灾区，比如，现在日本福岛核爆炸，那么核电以及核电配套设备公司相关性高，但是目前在市场受到核电利空打击，你的组合反而面临较大风险）的话，难以达到市场收益甚至亏损。

即便你找的都是贝塔系数较高的股票，但是由于自身相关，很可能是大盘强他们弱，仅仅由于其相关性高，而同时受到一个因素干扰。

## 九、问一下股票的相关费用计算。

买入 1.手续费千分之三，5元起步  $10.45 \times 500 \times 0.3\% = 15.675$ ；

2.沪市 每1000股加1元，过户费，1元起步；

总的费用  $15.68 + 1 = 16.68$  卖出

除上述两项费用，要价交易额的千分之一的印花税： $10.45 \times 500 \times 0.1\% = 5.225$

总的费用  $16.68 + 5.23 = 21.91$  保本价  $(21.91 + 16.68) / 500 + 10.45 = 10.5218$ ，

因此要到10.53之上才能盈利

## 参考文档

[下载：股票间相关性怎么计算公式.pdf](#)

[《创业板股票转账要多久》](#)

[《股票正式发布业绩跟预告差多久》](#)

[《股票钱多久能到银行卡》](#)

[《中泰齐富股票卖了多久可以提现》](#)

[下载：股票间相关性怎么计算公式.doc](#)

[更多关于《股票间相关性怎么计算公式》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/article/11918471.html>