

## 两个股票间相关系数怎么求...已知两只股票相关系数为-1, 如何求无风险利率, 谢谢啦~~~-股识吧

### 一、如何快速比较股票间的相关性

- 。
- 。
- 。
- 。
- 。

这个问题嘿嘿我的毕设就是这个, 你可以先去期刊网去找找其他人怎么做的, 我记得我在01年做的时候, 样本剔除后只有300多支股票, 分析来分析去, 做了很多调整相关性做到了90%以上, 可是以前知名学者的全面分析下来只有50%多, 当时没有wind之类的东西, 全手工excel, 现在用wind方便多了。

但是由于我国证券市场从初始到现在因政策5次重大变动产生了较大的变化, 我建议你不妨从时间和市场两个角度缩小样本选取(可以选中小板为样本), 针对性更强。

### 二、刻画两个证券相关性参数是什么?

相关系数: 等于0, 表示两个证券独立;  
等于1, 表示两个证券完全正相关(变化趋势和幅度相同);  
等于-1, 表示完全负相关;  
大于0小于1, 表示正相关, 仅变化趋势一致;  
大于-1小于0, 表示变化趋势相反。

### 三、请教一道关于计算股票相关系数的题。

实际上协方差的公式是这样表达的:  $cov(A, B) = stdA * stdB * cor(A, B)$  其中stdA为资产组合A的标准差, stdB为资产组合B的标准差, cor(A, B)为资产组合A和B之间的相关系数。

简单的算就是 $10\% * 15\% * \text{相关系数} = 100$

#### 四、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强, 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, 仅仅由于其相关性强, 而同时受到一个因素干扰。

#### 五、求甲乙两种股票系统性风险大小, 求甲乙股票与市场组合的相关系数

#### 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++

#### 七、知道两种股票的历史收盘价怎么算两者之间的相关系数

协方差与期望值有如下关系:  $\text{Cov}(X, Y) = E(XY) - E(X)E(Y)$ 。  
 $D(X) = E(X^2) - [E(X)]^2$ 三个公式在了, 自己根据数字算吧

## 八、如何求股票的相关系数和协方差

给概率, 股票收益率, 期望收益率, 方差, 标准差, 求相关系数, 协方差

### 参考文档

[下载: 两个股票间相关系数怎么求.pdf](#)

[《股票怎么看昨日价格》](#)

[《退市的股票该怎么办》](#)

[《港美股开户应该什么条件》](#)

[《基金净值涨跌和什么有关》](#)

[下载: 两个股票间相关系数怎么求.doc](#)

[更多关于《两个股票间相关系数怎么求》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/article/22403706.html>