

股票的相关系数如何计算.如何快速比较股票间的相关性-股识吧

一、一只股票的自相关性怎么算

在自相关图中，自相关系数始终控制在两倍标准差范围内，并且在零轴附近波动，这是纯随机性非常强的平稳时间序列。

有单调趋势的一般为非平稳系列，有正弦波动规律或者周期变化规律的也是非平稳系列平稳性你也可以用时序图来检验

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

三、股票相关性计算

相关性分析比较书面化，因为实际中同时影响多只股票的因素很多，不好剔除。但是如果你要简单性进行数据分析的话，那么就设立一个时间段，把这个时间段两只或者多只股票的涨跌幅变化进行对比就可以了。

这是最简单但最不精确的方法。

如果你想严谨一些，那么选定时间段，选取两只或多只股票所在的行业，把这几只股票和行业整体情况作对比，再将整个行业和大盘作对比，只要你选取的时间段足够长，那么得出的整个行业的 β 系数还是比较靠谱的，依据这个 β 系数你再相互比较应该就可以得出这几只股票间的

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、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。

六、股票的计算方法

- 1、非利息收入 = 手续费及佣金收支净额 + 净交易（损失）/收益 + 证券投资净（损失）/收益 + 其他营业收入；
- 2、营业收入 = 净利息收入 + 非利息收入；
- 3、非经常性损益为按照《公开发行证券的公司信息披露规范问题第1号：非经常性损益（2004年修订）》的要求确定和计算的；

- 4、证券投资包括：可供出售证券、持有至到期日债券、分类为贷款及应收款的债券、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产；
- 5、每股股息 = 股息总额 ÷ 期末股本总数；
- 6、每股净资产 = 期末本行股东应享权益合计 ÷ 期末股本总数；
- 7、总资产净回报率 = 税后利润 ÷ 资产平均余额，资产平均余额 = (期初资产总计 + 期末资产总计) ÷ 2；
- 8、股本净回报率（不含少数股东权益）= 本行股东应享税后利润 ÷ 本行股东应享权益平均余额，本行股东应享权益平均余额 = (期初本行股东应享权益合计 + 期末本行股东应享权益合计) ÷ 2；
- 9、股本净回报率（含少数股东权益）根据《国有商业银行公司治理及相关监管指引》（银监发[2006]22号）的规定计算；
- 10、净利差 = 生息资产平均利率 - 付息负债平均利率，生息资产平均利率 = 利息收入 ÷ 生息资产平均余额，付息负债平均利率 = 利息支出 ÷ 付息负债平均余额，平均余额为本行管理账目未经审计的日均余额；
- 11 净息差 = 净利息收入 ÷ 生息资产平均余额，平均余额为本行管理账目未经审计的日均余额；
- 12、贷存比 = 期末客户贷款总额 ÷ 期末客户存款余额；
- 13、非利息收入占比 = 非利息收入 ÷ 营业收入；
- 14、成本收入比 = (员工费用 + 业务费用 + 折旧和摊销) ÷ (营业收入 + 联营及合营企业投资净收益 - 其他营业支出)，其他营业支出 = 保险索偿支出 + 其他支出，根据《国有商业银行公司治理及相关监管指引》（银监发[2006]22号）的规定计算；
- 15、不良贷款率 = 期末不良贷款余额 ÷ 期末客户贷款总额，根据《国有商业银行公司治理及相关监管指引》（银监发[2006]22号）的规定计算；
- 16、拨备覆盖率 = 期末贷款减值准备 ÷ 期末不良贷款余额，根据《国有商业银行公司治理及相关监管指引》（银监发[2006]22号）的规定计算；
- 17、信贷成本 = 贷款减值损失 ÷ 客户贷款平均余额，客户贷款平均余额 = (期初客户贷款总额 + 期末客户贷款总额) ÷ 2；

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： $Cov(X, Y) = E(XY) - E(X)E(Y)$ 。
 $D(X) = E(X^2) - [E(X)]^2$ 三个公式在了，自己根据数字算吧

八、股票指数、债券指数、基金指数之间的相关系数怎么算

各指数分类都不一样，不具可比性，还怎么算其相关性。

不过，可以针对具体的股票指数、债券指数、基金指数，通过历史数据运用数理统计进行相关分析。

九、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 $10\% * 15\% * 相关系数 = 100$

参考文档

[下载：股票的相关系数如何计算.pdf](#)

[《股票买过后多久能卖出》](#)

[《股票委托多久才买成功》](#)

[《股票腰斩后多久回本》](#)

[下载：股票的相关系数如何计算.doc](#)

[更多关于《股票的相关系数如何计算》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/article/33823211.html>