如何计算两个股票的的相关系数假设市场只有两种股票A、B，其收益率标准差为0.25和0.6，与市场的相关系数分别为0.4和0.7，市场指数的平均-股识吧

一、求指教股票的β系数和标准差计算

简单说β系数是一种表示风险量度的参数，一般高风险对应高收益，所以在牛市或者大势看涨的时候可以选择β系数较高的股票进行投资。
贝塔系数[Beta coefficient]是一种评估证券系统性风险的工具，用以度量一种证券或一个投资证券组合相对总体市场的波动性。
在股票、(基金)等投资术语中常见。
用β系数估量风险叫β测量法，它来源于统计上的回归分析。
最早提出β值是在本世纪60年代初，大约过了10年，美国的金融管理者们才认识到它的价值。
在证券投资中，收益与风险并存，高收益意味着要承担高风险。
风险由系统风险和非系统风险构成，其中非系统风险可以通过持有数种证券构成的投资组合加以消除。
β系数是测量系统风险大小的一个指标，能确切表达单一股票风险与市场股票风险间的关系。
为帮助投资人分析系统风险大小，树立科学的投资理念，发达国家的证券市场都定期在权威报刊杂志上公布每种股票的β系数，国际上著名的投资咨询公司提供的上市公司研究报告中也要列出股票的β系数。
贝塔系数衡量股票收益相对于{业绩}评价基准收益的总体波动性，是一个相对指标。
β越高，意味着股票相对于{业绩}评价基准的波动性越大。
β大于1，则股票的波动性大于{业绩}评价基准的波动性。
反之亦然。
贝塔系数是统计学上的概念，是一个在＋1至-1之间的数值，它所反映的是某一投资对象相对于大盘的表现情况。
其绝对值越大，显示其收益变化幅度相对于大盘的变化幅度越大；
绝对值越小，显示其变化幅度相对于大盘越小。
如果是负值，则显示其变化的方向与大盘的变化方向相反；
大盘涨的时候它跌，大盘跌的时候它涨。
由于我们投资于投资(基金)的目的是为了取得专家理财的服务,以取得优于被动投资于大盘的表现情况，这一指标可以作为考察(基金)经理降低投资波动性风险的能力。
在计算贝塔系数时,除了(基金)的表现数据外,还需要有作为反映大盘表现的指标。

β系数计算方式贝塔系数利用回归的方法计算。
贝塔系数为1即证券的价格与市场一同变动。
贝塔系数高于1即证券价格比总体市场更波动。
贝塔系数低于1[大于0]即证券价格的波动性比市场为低。
贝塔系数的计算公式 公式为：其中Cov(ra,rm)是证券a的收益与市场收益的协方差

二、假设市场只有两种股票A、B，其收益率标准差为0.25和0.6，与市场的相关系数分别为0.4和0.7，市场指数的平均

都是带公式的题嘛（1） βA=ρA*δA/δM=0.4*0.25/0.1=1 βB=ρB*δB/δM=0.7*0.6/0.1=4.2AB组合的β=0.5*βA+0.5*βB=2.6（2）cov（A,B）=βA*βB*δM*δM=1*4.2*0.1*0.1=0.042（3）A股票预期收益率=RF+βA*（RM-RF）=5%+1*（15%-5%）=15%B股票预期收益率=RF+βB*（RM-
RF）=5%+4.2*（15%-5%）=47%AB组合预期收益率=0.5*15%+0.5*47%=31%

三、股票收益率的方差怎么求、相关系数怎么出来的。

（1）A股票收益率的期望值＝（4%－2%＋5%＋6%－3%）/5＝2%A股票收益率的标准差＝4.18%B股票收益率的期望值＝10%×0.3＋20%×0.3－8%×0.4＝5.8%B股票收益率的标准差 ＝11.91%（2）A、B股票的协方差＝A、B股票的相关系数×A股票收益率的标准差×B股票收益率的标准差＝0.8×4.18%×11.91%＝0.40%（3）投资组合的方差＝0.3×0.3×4.18%×4.18%＋2×0.3×0.7×0.40%＋0.7×0.7×11.91%×11.91%＝0.88%（4）投资组合的贝他系数＝0.5×9.38%/15%＝0.31假设B股票的贝他系数为b，则：0.3×0.4＋0.7×b＝0.31解得：b＝0.27
1、男人和女人，决定是什么关系，通常是三秒钟的事情。
一见钟情否，通常只要一秒钟。
2、一段持久的爱情，肯定是双赢的，而且是平衡的，一旦有天失衡了，就是关系破裂的时候。
3、一个走向成熟的女人，可以没有像样的衣服，但是不能没有像样的包包，因为它会给女人安全感。
爱情可能背叛你，但是包包却永远不会。
4、选择一个男人的时候，设法了解他和母亲以及初恋的情况。
男人的母亲和初恋女孩，这两个女人已经决定了他的爱情观。
5、女人总想找一个自己欣赏的，比自己更强大的男人。
那样的男人都在塔尖上，大多数踮着脚尖都够不着，够着了可能因为争抢而摔死。

6、优等男早都被占坑了，你得赶紧占一个。
饰品ptisys.com/list.php?catid=1705
7、别跟有处女情结的男人耗，这样的男人，不是自大就是自卑。

四、股票收益率的方差怎么求、相关系数怎么出来的。

（1）A股票收益率的期望值＝（4%－2%＋5%＋6%－3%）/5＝2%A股票收益率的标准差＝4.18%B股票收益率的期望值＝10%×0.3＋20%×0.3－8%×0.4＝5.8%B股票收益率的标准差 ＝11.91%（2）A、B股票的协方差＝A、B股票的相关系数×A股票收益率的标准差×B股票收益率的标准差＝0.8×4.18%×11.91%＝0.40%（3）投资组合的方差＝0.3×0.3×4.18%×4.18%＋2×0.3×0.7×0.40%＋0.7×0.7×11.91%×11.91%＝0.88%（4）投资组合的贝他系数＝0.5×9.38%/15%＝0.31假设B股票的贝他系数为b，则：0.3×0.4＋0.7×b＝0.31解得：b＝0.27
1、男人和女人，决定是什么关系，通常是三秒钟的事情。
一见钟情否，通常只要一秒钟。
2、一段持久的爱情，肯定是双赢的，而且是平衡的，一旦有天失衡了，就是关系破裂的时候。
3、一个走向成熟的女人，可以没有像样的衣服，但是不能没有像样的包包，因为它会给女人安全感。
爱情可能背叛你，但是包包却永远不会。
4、选择一个男人的时候，设法了解他和母亲以及初恋的情况。
男人的母亲和初恋女孩，这两个女人已经决定了他的爱情观。
5、女人总想找一个自己欣赏的，比自己更强大的男人。
那样的男人都在塔尖上，大多数踮着脚尖都够不着，够着了可能因为争抢而摔死。
6、优等男早都被占坑了，你得赶紧占一个。
饰品ptisys.com/list.php?catid=1705
7、别跟有处女情结的男人耗，这样的男人，不是自大就是自卑。

五、两种证券之间的相关系数的关系是什么？

相关系数总处于+1和-1之间：（1）相关系数等于1时，两种证券完全正相关；
（2）相关系数等于﹣1时，两种证券完全负相关；
（3）相关系数等于0时，两种证券之间完全独立；

（4）相关系数处于（-1,0）U（0,1）时，两种证券之间不完全相关。

六、相关系数的计算公式是什么

若Y=a+bX，则有：令E(X) = μ，D(X) = σ则E(Y) = bμ + a，D(Y) = bσE(XY) = E(aX + bX) = aμ + b(σ + μ)Cov(X,Y) = E(XY) − E(X)E(Y) = bσ扩展资料：定义相关关系是一种非确定性的关系，相关系数是研究变量之间线性相关程度的量。
由于研究对象的不同，相关系数有如下几种定义方式。
简单相关系数：又叫相关系数或线性相关系数，一般用字母r
表示，用来度量两个变量间的线性关系。
定义式其中，Cov(X,Y)为X与Y的协方差，Var[X]为X的方差，Var[Y]为Y的方差复相关系数：又叫多重相关系数。
复相关是指因变量与多个自变量之间的相关关系。
例如，某种商品的季节性需求量与其价格水平、职工收入水平等现象之间呈现复相关关系。
典型相关系数：是先对原来各组变量进行主成分分析，得到新的线性关系的综合指标，再通过综合指标之间的线性相关系数来研究原各组变量间相关关系。

七、知道两只股票的收益率求相关系数

超额收益一般指超过市场平均水平的收益，相关系数是2个股票超额收益变动的一致性、同步性，一般用线性回归方法来求解。

参考文档

下载：如何计算两个股票的的相关系数.pdf
《精准股票是什么公司》
《股票买了没成交怎么办》
《同花顺如何申购债券》
《理财存死期能提前取出来吗》

《债券基金的风险有哪些》
下载：如何计算两个股票的的相关系数.doc
更多关于《如何计算两个股票的的相关系数》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/35650483.html