

## 多只股票的相关系数怎么算\_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、我想请教个问题, 如果是一个投资组合里有三个资产, 就比如是三个股票, 那我们可以得到收益, 平方差等。

三个资产 要画图就是画椭圆和直线的切点, 直线代表等收益线, 椭圆代表等方差线, 同样找切点, 这个确实有点复杂, 但画出来的图很好看, 像星系一样的

## 二、关于概率中相关系数的计算问题

从第一列中如果能找到8个和第二列对应的数据, 就可以

## 三、财务管理问题: 某公司持有ABC三种股票构成的证券组合, 系数分别为2.0、1.0和0.5

这种情况不应投资。

A的期望收益率=10%+2\*(14%-10%)=18%  
B的期望收益率=10%+1\*(14%-10%)=14%  
C的期望收益率=10%+0.5\*(14%-10%)=12%  
该组合的期望收益率=60%\*18%+30%\*14%+10%\*12%=16.2%  
预期收益也称为期望收益, 是指如果没有意外事件发生时根据已知信息所预测能得到的收益。

通常未来的资产收益是不确定的。

不确定的收益可以用多种可能的取值及其对应的概率来表示, 这两者的加权平均, 即数学期望值, 就是资产的预期收益。

学习之前先来做一个小测试吧点击测试我合不合适学会计在投资理财中, 预期收益的重要性, 怎么强调都不为过。

它是进行投资决策的关键, 输入变量计算。

不对它做出估计, 什么买卖决策、投资组合一切都免谈。

它不仅对投资者重要, 对于公司管理者来说, 也同样重要, 因为公司股票的预期收益是影响公司资本成本的主要因素, 关系到公司将来选择什么样的投资项目。

学习财务知识可以到恒企教育, 恒企教育在教辅交互上, 应用大数据实践精准教育, 真正实现个性化教育, 建立有效的课前、课中、课后辅导标准体系, 积极实践社群班级管理, 让学员自觉形成自适应学习。

#### 四、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

没看懂什么意思？

#### 五、相关系数的计算公式是怎样得来的

三个资产 要画图就是画椭圆和直线的切点，直线代表等收益线，椭圆代表等方差线，同样找切点，这个确实有点复杂，但画出来的图很好看，像星系一样的

#### 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、已知2支股票的期望报酬率 与市场的相关系数 贝塔值 标准离差，怎么求市场组合的期望报酬率

列两个CAPM的等式，求解 $R_f$ 和 $R_m$ 就可以了：股票的期望报酬率=无风险利率+Beta\*(市场期望报酬率-无风险利率)

#### 八、相关系数r的计算公式是什么？

相关系数定义式为：若 $Y=a+bX$ ，则有：令 $E(X) = \mu$ ， $D(X) = \sigma^2$ ，则 $E(Y) = b\mu + a$ ， $D(Y) = b^2\sigma^2$ ， $E(XY) = E(aX + bX^2) = a\mu + b(\sigma^2 + \mu^2)$ ， $Cov(X, Y) = E(XY) - E(X)E(Y) = b\sigma^2$ 。

相关系数是最早由统计学家卡尔·皮尔逊设计的统计指标，是研究变量之间线性相关程度的量，一般用字母 $r$ 表示。

由于研究对象的不同，相关系数有多种定义方式，较为常用的是皮尔逊相关系数。

相关系数定义式为：若 $Y=a+bX$ ，则有：令 $E(X) = \mu$ ， $D(X) = \sigma^2$ ，则 $E(Y) = b\mu + a$ ， $D(Y) = b^2\sigma^2$ ， $E(XY) = E(aX + bX^2) = a\mu + b(\sigma^2 + \mu^2)$ ， $Cov(X, Y) = E(XY) - E(X)E(Y) = b\sigma^2$ 。

相关表和相关图可反映两个变量之间的相互关系及其相关方向，但无法确切地表明两个变量之间相关的程度。

相关系数是用以反映变量之间相关关系密切程度的统计指标。

相关系数是按积差方法计算，同样以两变量与各自平均值的离差为基础，通过两个离差相乘来反映两变量之间相关程度；

着重研究线性的单相关系数。

需要说明的是，皮尔逊相关系数并不是唯一的相关系数，但是最常见的相关系数。

依据相关现象之间的不同特征，其统计指标的名称有所不同。

如将反映两变量间线性相关关系的统计指标称为相关系数（相关系数的平方称为判定系数）；

将反映两变量间曲线相关关系的统计指标称为非线性相关系数、非线性判定系数；

将反映多元线性相关关系的统计指标称为复相关系数、复判定系数等。

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。

需要指出的是，相关系数有一个明显的缺点，即它接近于1的程度与数据组数 $n$ 相关，这容易给人一种假象。

因为，当 $n$ 较小时，相关系数的波动较大，对有些样本相关系数的绝对值易接近于1；当 $n$ 较大时，相关系数的绝对值容易偏小。

特别是当 $n=2$ 时，相关系数的绝对值总为1。

因此在样本容量 $n$ 较小时，我们仅凭相关系数较大就判定变量 $x$ 与 $y$ 之间有密切的线性关系是不妥当的。

## 九、股票多日的累计涨跌幅如何计算

涨跌幅=(现价-上一个交易日收盘价)/上一个交易日收盘价\*100%。

股票具有商品的属性，说白了就是一种“商品”，和别的商品一样，它的价格也受到它的内在价值（标的公司价值）的控制，而且波动在价值上下。

像普通商品一样，股票的价格波动，会受到供求关系的影响。

就像市场上的猪肉一样，当需要的猪肉越来越多，当市场上猪肉供不应求，价格上升是必然的事；

当流入市场中的猪肉多了，造成供大于求，猪肉价这个时候肯定就不会上升。

在股票上就会这样体现：10元/股的价格，50个人卖出，但市场上有100个买，那另外50个买不到的人就会以11元的价格买入，股价就会上涨，反之就会下跌（由于篇幅问题，这里将交易进行简化了）。

平日里，双方的情绪好坏受多方面影响，进而影响到供求关系的稳定，其中产生较大影响的因素有3个，接下来我将给大家进行详细说明。

在这之前，先给大家送波福利，免费领取各行业的龙头股详细信息，涵盖医疗、军工、新能源能热门产业，随时可能被删：【绝密】机构推荐的牛股名单泄露，限时速领！！一、造成股票涨跌的因素有哪些？1、政策行业或产业的发展，离不开国家政策的指导，比如说新能源，几年前我国开始对新能源进行开发，有关企业、产业都得到了政府扶持，比如补贴、减税等。

政策带来了大批的资金投入，尤其是在相关行业中，会挖掘优秀的企业或者上市公司，最终导致股票的涨跌。

2、基本面用长期的目光看，市场的走势和基本面相同，基本面向好，市场整体就向好，比如说疫情后我国经济有所回升，企业盈利增加，股市也就一起回升了。

3、行业景气度这个是十分重要的，股票的变化一般都与行业走势相关，这类公司的股票价格普遍上涨的原因是行业景气度好，比如上面说到的新能源。

为了让大家及时了解到最新资讯，我特地掏出了压箱底的宝贝--股市播报，能及时掌握企业信息、趋势拐点等，点击链接就能免费获取：【股市晴雨表】金融市场一手资讯播报二、股票涨了就一定要买吗？很多新手刚刚接触到股票，一看某支股票涨势大好，立马买了几万块，结果一直往下跌，被套的死死的。

其实股票的变化趋势可以在短期被人为操纵，只要有人持有足够多的筹码，一般来说占据市场流通盘的40%，就可以完全控制股价。

如果你现在是刚入门的股票新手，优先采用长期持有龙头股进行价值投资的方法，避免在短线投资中赔了本。

吐血整理！各大行业龙头股票一览表，建议收藏！应答时间：2022-09-23，最新业务变化以文中链接内展示的数据为准，请点击查看

## 参考文档

[下载：多只股票的相关系数怎么算.pdf](#)

[《上市公司离职多久可以卖股票》](#)

[《大股东股票锁仓期是多久》](#)

[《股票开户一般多久到账》](#)

[下载：多只股票的相关系数怎么算.doc](#)

[更多关于《多只股票的相关系数怎么算》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/72194934.html>