

股票之间相关性怎么看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？-股识吧

一、请问股票相关指数分别是什么时候意思？图中如何理解？麻烦了，谢谢！

指数是表示相关股票趋势变化的数字累加而成的一种趋势图表。图中表示的是未来的一段时间相关指数和股票股价的一种变化趋势，通过趋势来判断买和卖，实现收益或损失。

二、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： $\text{cov}(A, B) = \text{std}A * \text{std}B * \text{cor}(A, B)$ 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 $10\% * 15\% * \text{相关系数} = 100$

三、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

四、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

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、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。

七、股票相关系数为负是什么意思

这要看你拿什么做比较了。

如果是两个股票相关系数为负就是指一个股票涨的时候，另一个股票跌。

如果是一个股票和大盘的相关系数为负就是指当这个股票涨的时候大盘会跌大概的意思就是这个样子，因为相关系数一般是1到-1之间，负相关也有强弱之分。

股票里有个叫 β 系数的就是指这个股票与大势的关系

八、如何看懂炒作题材概念与股票之间的关系

股票上涨需要有一个外在的动力刺激，无非也就是事件驱动。因此炒作概念与题材需要有相关的消息或者新闻政策等刺激股票才能出现上涨。但题材概念炒作往往是在疯狂的时候，会把股价引到一个很高的价位。而后的走势就是慢慢价值回归一地鸡毛。所以说题材概念炒作一定要把握时机以及掌握见好就收的原则。

参考文档

[下载：股票之间相关性怎么看.pdf](#)

[《投资股票多久收益一次》](#)

[《股票停止交易多久》](#)

[《股票挂单有效多久》](#)

[《股票停牌重组要多久》](#)

[《公司上市多久后可以股票质押融资》](#)

[下载：股票之间相关性怎么看.doc](#)

[更多关于《股票之间相关性怎么看》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/author/11044537.html>