

如何求ab两只股票的相关系数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、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

二、AB两种证券的相关系数为0.6, 预期报酬率分别为14%和18%, 标准差分别为0.1和0.2, 在投资组合中AB两种证券的

投资组合的预期报酬率就是简单的算术平均= $0.5 \times 14\% + 0.5 \times 18\% =$

16% 投资组合的标准差的平方= $0.5 \times 0.5 \times 0.1 \times 0.1 + 0.5 \times 0.5 \times 0.2 \times 0.2 + 2 \times 0.6 \times 0.5 \times 0.5 \times 0.1 \times 0.2 = 0.0185$ 所以投资组合的标准差为0.136

三、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

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、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++

六、如何分析两只股票的涨幅的相关系数？

首先你需要选择两只股票的涨跌数据，比如可以是向前为其三个月的数据，或者是一年的数据，然后把两只股票每天的涨跌数据一一对应收集起来。

然后就可以采用简单的相关分析，甚至其他的统计分析方法分析两只股票的关系。不过说实话

中国的股票数据反映的并不是经济规律的真相，更多的是政策和市场信息的影响。

七、两证券协方差和相关系数的计算

一、首先要明白这2个的定义 1、相关系数是协方差与两个投资方案投资收益标准差之积的比值，其计算公式为：相关系数总是在-1到+1之间的范围内变动，-1代表完全负相关，+1代表完全正相关，0则表示不相关。

2、协方差是一个用于测量投资组合中某一具体投资项目相对于另一投资项目风险的统计指标。

其计算公式为：当协方差为正值时，表示两种资产的收益率呈同方向变动；

协方差为负值时，表示两种资产的收益率呈反方向变动。

二、要辨清两者的关系 1、相关系数与协方差一定是在投资组合中出现的，只有组合才有相关系数和协方差。

单个资产是没有相关系数和协方差之说的。

2、相关系数和协方差的变动方向是一致的，相关系数的正的，协方差一定是正的。

3、（1）协方差表示两种证券之间共同变动的程度：相关系数是变量之间相关程度的指标根据协方差的公式可知，协方差与相关系数的正负号相同，但是协方差是相关系数和两证券的标准差的乘积，所以协方差表示两种证券之间共同变动的程度。

（2）相关系数是变量之间相关程度的指标，相关系数在0到1之间，表示两种报酬率的增长是同向的；

相关系数在0到-1之间，表示两种报酬率的增长是反向的，所以说相关系数是变量之间相关程度的指标。

总体来说, 两项资产收益率的协方差, 反映的是收益率之间共同变动的程度; 而相关系数反映的是两项资产的收益率之间相对运动的状态。
两项资产收益率的协方差等于两项资产的相关系数乘以各自的标准差。

八、相关系数怎么算?????

相关系数介于区间 $[-1, 1]$ 内。

当相关系数为 -1 , 表示完全负相关, 表明两项资产的收益率变化方向和变化幅度完全相反。

当相关系数为 $+1$ 时, 表示完全正相关, 表明两项资产的收益率变化方向和变化幅度完全相同。

当相关系数为 0 时, 表示不相关。

参考文档

[下载: 如何求ab两只股票的相关系数.pdf](#)

[《同花顺股票多久提现》](#)

[《认缴股票股金存多久》](#)

[《股票亏钱多久能结束》](#)

[《股票开户许可证要多久》](#)

[《一只股票从增发通告到成功要多久》](#)

[下载: 如何求ab两只股票的相关系数.doc](#)

[更多关于《如何求ab两只股票的相关系数》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/book/32669182.html>