

# 如何求ab两只股票的相关系数...如何分析两只股票的涨幅的相关系数？-股识吧

## 一、如何计算两个股票的相关系数(correlation) (急)

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。

## 二、如何计算两个股票的相关系数(correlation) (急)

您的数据不够，无法计算。

需要有A股跟市场的相关系数0.1，B股跟市场的相关系数0.5，以及AB股之间的相关系数（未提供），才能算出AB组合跟市场的相关系数。

## 三、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。

## 四、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，相关系数的负的，协方差一定是负的。

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。

## 五、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。

## 六、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： $225w^2 - 300w + 100 = 0$ 或 $(15w - 10)^2 = 0$ 则 $w = 2/3$ 则，该投资组合的收益率为： $2\% * (2/3) + 5\% * (1/3) = 9\%/3 = 3\%$

## 七、在一个完全有效的市场上，两只股票间的相关系数怎样确定？为多少？

这问题可以做成硕士论文了，现实中就没有完全有效的股票市场，特别在当下，利好不涨利空不跌，两只股票的相关系数只能去问庄家如何操作了，这跟他的操作手法他对未来的判断有密不可分的关系。

## 八、如何求股票的相关系数和协方差

给概率，股票收益率，期望收益率，方差，标准差，求相关系数，协方差

## 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》](#)

[《股票抛股要多久》](#)

[《小盘股票中签后多久上市》](#)

[《股票开户一般多久到账》](#)

[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/3997411.html>