

如何计算两只股票的相关系数—两支股票的协方差怎么算啊-股识吧

一、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。

二、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、要分清两者的关系 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。

三、两支股票的协方差怎么算啊

首先用简单的语言来说说什么叫做协方差，方差用来描述一组数据的波动或者分散程度；

方差实际上是方差的一种特殊情况，即主要变量为两个相同变量时。

协方差衡量两个变量的总体误差，具体计算公式可以百度.....利用公式可以计算出股票A的期望收益率为4.67%，B股票的期望收益率为22.33%，进一步能够计算能够得到协方差为1%。

这种知识类的在百度上搜一下，按照公式算就可以了。

对于公司有问题可以进一步提问。

四、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++

五、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： $225w^2-300w+100=0$ $(15w-10)^2=0$ 则 $w=2/3$ 则，该投资组合的收益率为： $2\%*(2/3)+5\%*(1/3)=9\%/3=3\%$

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、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。

八、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 $(-1,0) \cup (0,1)$ 时，两种证券之间不完全相关。

九、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： $225w^2 - 300w + 100 = 0$ $(15w - 10)^2 = 0$ 则 $w = 2/3$ 则，该投资组合的收益率为： $2\% * (2/3) + 5\% * (1/3) = 9\%/3 = 3\%$

参考文档

[下载：如何计算两只股票的相关系数.pdf](#)

[《股票退市多久退3板》](#)

[《一只股票多久才能涨》](#)

[《股票通常会跌多久》](#)

[《买到手股票多久可以卖》](#)

[下载：如何计算两只股票的相关系数.doc](#)

[更多关于《如何计算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/4191334.html>