

## 2只股票相关系数如何计算！相关系数的计算公式是什么-股识吧

### 一、如何计算两个股票的相关系数(correlation) (急)

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。

### 三、相关系数的计算公式是什么

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。

### 四、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： $2\% * (2/3) + 5\% * (1/3) = 9\%/3 = 3\%$

### 五、相关系数的计算公式是什么

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。

## 六、股票收益率的方差怎么求、相关系数怎么出来的。

(1) A股票收益率的期望值 =  $(4\% - 2\% + 5\% + 6\% - 3\%) / 5 = 2\%$  A股票收益率的标准差 =  $4.18\%$  B股票收益率的期望值 =  $10\% \times 0.3 + 20\% \times 0.3 - 8\% \times 0.4 = 5.8\%$  B股票收益率的标准差 =  $11.91\%$  (2) A、B股票的协方差 = A、B股票的相关系数  $\times$  A股票收益率的标准差  $\times$  B股票收益率的标准差 =  $0.8 \times 4.18\% \times 11.91\% = 0.40\%$  (3) 投资组合的方差 =  $0.3 \times 0.3 \times 4.18\% \times 4.18\% + 2 \times 0.3 \times 0.7 \times 0.40\% + 0.7 \times 0.7 \times 11.91\% \times 11.91\% = 0.88\%$  (4) 投资组合的贝他系数 =  $0.5 \times 9.38\% / 15\% = 0.31$  假设B股票的贝他系数为b, 则:  $0.3 \times 0.4 + 0.7 \times b = 0.31$  解得:  $b = 0.27$

1、男人和女人, 决定是什么关系, 通常是三秒钟的事情。

一见钟情否, 通常只要一秒钟。

2、一段持久的爱情, 肯定是双赢的, 而且是平衡的, 一旦有天失衡了, 就是关系破裂的时候。

3、一个走向成熟的女人, 可以没有像样的衣服, 但是不能没有像样的包包, 因为它会给女人安全感。

爱情可能背叛你, 但是包包却永远不会。

4、选择一个男人的时候, 设法了解他和母亲以及初恋的情况。

男人的母亲和初恋女孩, 这两个女人已经决定了他的爱情观。

5、女人总想找一个自己欣赏的, 比自己更强大的男人。

那样的男人都在塔尖上, 大多数踮着脚尖都够不着, 够着了可能因为争抢而摔死。

6、优等男早都被占坑了, 你得赶紧占一个。

饰品 [ptisys.com/list.php?catid=1705](http://ptisys.com/list.php?catid=1705)

7、别跟有处女情结的男人耗, 这样的男人, 不是自大就是自卑。

## 七、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%, 进一步能够计算出协方差为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。

## 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。

## 参考文档

[下载：2只股票相关系数如何计算.pdf](#)

[《股票除权除息日多久》](#)

[《股票回购多久才能涨回》](#)

[《股票基金回笼一般时间多久》](#)

[《买股票从一万到一百万需要多久》](#)

[下载：2只股票相关系数如何计算.doc](#)

[更多关于《2只股票相关系数如何计算》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/book/5018727.html>