

几只股票的相关系数怎么求--如何分析两只股票的涨幅的相关系数？-股识吧

一、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： $2\% * (2/3) + 5\% * (1/3) = 9\%/3 = 3\%$

二、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。

三、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： $2\% * (2/3) + 5\% * (1/3) = 9\%/3 = 3\%$

四、一只股票的自相关性怎么算

在自相关图中，自相关系数始终控制在两倍标准差范围内，并且在零轴附近波动，这是纯随机性非常强的平稳时间序列。

有单调趋势的一般为非平稳系列，有正弦波动规律或者周期变化规律的也是非平稳系列平稳性你也可以用时序图来检验

五、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。

参考文档

[下载：几只股票的相关系数怎么求.pdf](#)

[《中泰齐富股票卖了多久可以提现》](#)

[《股票涨30%需要多久》](#)

[《股票亏钱多久能结束》](#)

[《股票发债时间多久》](#)

[下载：几只股票的相关系数怎么求.doc](#)

[更多关于《几只股票的相关系数怎么求》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/64410039.html>