

# 两只股票相关系数怎么确定！如何求股票的相关系数和协方差-股识吧

## 一、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

## 二、两种完全正相关的股票的相关系数为

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 $\beta$ 系数还是比较靠谱的，依据这个 $\beta$ 系数你再相互比较应该就可以得出这几只股票间的

## 三、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++

## 四、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  $\beta$  系数还是比较靠谱的，依据这个  $\beta$  系数你再相互比较应该就可以得出这几只股票间的

## 五、股票指数、债券指数、基金指数之间的相关系数怎么算

各指数分类都不一样，不具可比性，还怎么算其相关性。

不过，可以针对具体的股票指数、债券指数、基金指数，通过历史数据运用数理统计进行相关分析。

## 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： $225w^2 - 300w + 100 = 0$  $(15w - 10)^2 = 0$ 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、两种完全正相关的股票的相关系数为

正相关的意思是变动的方向一致意思是一个股票涨

另外一个股票也涨这样的投资组合 其实就是博命的组合 要涨两个都涨 要跌两个都跌 当然这样就起不到所谓的风险分散的作用了

## 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：两只股票相关系数怎么确定.pdf](#)

[《股票为什么出现跳空》](#)

[《服装股票什么时候会涨》](#)

[下载：两只股票相关系数怎么确定.doc](#)

[更多关于《两只股票相关系数怎么确定》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/chapter/22829701.html>