

什么软件可以计算股票相关系数的公式 - 什么股票软件可以按自己设定的板块计算指数？-股识吧

一、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。

二、股票的 系数

目录 · 贝塔系数() · 系数计算方式 · Beta的含义 · Beta的一般用途 贝塔系数()

贝塔系数衡量股票收益相对于业绩评价基准收益的总体波动性，是一个相对指标。越高，意味着股票相对于业绩评价基准的波动性越大。大于1，则股票的波动性大于业绩评价基准的波动性。

反之亦然。

如果 为1，则市场上涨10%，股票上涨10%；

市场下滑10%，股票相应下滑10%。

如果 为1.1，市场上涨10%时，股票上涨11%，；

市场下滑10%时，股票下滑11%。

如果 为0.9，市场上涨10%时，股票上涨9%；

市场下滑10%时，股票下滑9%。

系数计算方式(注：杠杆主要用于计量非系统性风险)(一)单项资产的 系数 单项资产系统风险用 系数来计量，通过以整个市场作为参照物，用单项资产的风险收益率与整个市场的平均风险收益率作比较，即：

$$= \frac{\text{单项资产的风险收益率}}{\text{市场组合平均风险收益率}}$$
 另外，还可按协方差公式计算

值，即
$$= \frac{\text{协方差}}{\text{市场组合方差}}$$

注意：掌握 值的含义 $=1$ ，表示该单项资产的风险收益率与市场组合平均风险收益率呈同比例变化，其风险情况与市场投资组合的风险情况一致；

$>$ ；

1，说明该单项资产的风险收益率高于市场组合平均风险收益率，则该单项资产的风险大于整个市场投资组合的风险；

$<$ ；

1, 说明该单项资产的风险收益率小于市场组合平均风险收益率, 则该单项资产的风险程度小于整个市场投资组合的风险。

小结: 1) 值是衡量系统性风险, 2) 系数计算的两种方式。

Beta的含义 Beta系数起源于资本资产定价模型(CAPM模型), 它的真实含义就是特定资产(或资产组合)的系统风险度量。

所谓系统风险, 是指资产受宏观经济、市场情绪等整体性因素影响而发生的价格波动, 换句话说, 就是股票与大盘之间的连动性, 系统风险比例越高, 连动性越强。与系统风险相对的就是个别风险, 即由公司自身因素所导致的价格波动。

总风险=系统风险+个别风险 而Beta则体现了特定资产的价格对整体经济波动的敏感性, 即, 市场组合价值变动1个百分点, 该资产的价值变动了几个百分点——或者用更通俗的说法: 大盘上涨1个百分点, 该股票的价格变动了几个百分点。

用公式表示就是: 实际中, 一般用单个股票资产的历史收益率对同期指数(大盘)收益率进行回归, 回归系数就是Beta系数。

Beta的一般用途 一般的说, Beta的用途有以下几个:

- 1) 计算资本成本, 做出投资决策(只有回报率高于资本成本的项目才应投资);
- 2) 计算资本成本, 制定业绩考核及激励标准;
- 3) 计算资本成本, 进行资产估值(Beta是现金流贴现模型的基础);
- 4) 确定单个资产或组合的系统风险, 用于资产组合的投资管理, 特别是股指期货或其他金融衍生品的避险(或投机)。

对Beta第四种用途的讨论将是本文的重点。

组合Beta Beta系数有一个非常好的线性性质, 即, 资产组合的Beta就等于单个资产的Beta系数按其在组合中的权重进行加权求和的结果。

三、什么股票软件可以按自己设定的板块计算指数?

我所知道的, 大智慧L2软件可以。

大智慧软件官方下载地址: 大智慧新一代(Level2) 下载地址: *://level2.gw*.cn/ 安装完了以后打开软件, 选择免费登陆。

0号指数的建立方法: 1、鼠标点击大智慧新一代的左边线(屏幕的最左边);

2、右键点击“板块指数”选“新建板块指数”

3、指数代码选AA00, 或者是其他的您任选的名字, 指数名称改为“0号指数”

4、点“流通市值曲线” 5、点“新增”

6、点“上海A股”然后Ctrl+A(全选), 确定;

7、点“深圳A股”然后Ctrl+A(全选), 确定;

8、在板块指数窗口按确定。

最后输入你刚给指数取的名字回车就可以了。

四、股票的 系数

目录 · 贝塔系数() · 系数计算方式 · Beta的含义 · Beta的一般用途 贝塔系数()

贝塔系数衡量股票收益相对于业绩评价基准收益的总体波动性，是一个相对指标。

越高，意味着股票相对于业绩评价基准的波动性越大。

大于1，则股票的波动性大于业绩评价基准的波动性。

反之亦然。

如果 为1，则市场上涨10%，股票上涨10%；

市场下滑10%，股票相应下滑10%。

如果 为1.1，市场上涨10%时，股票上涨11%，；

市场下滑10%时，股票下滑11%。

如果 为0.9，市场上涨10%时，股票上涨9%；

市场下滑10%时，股票下滑9%。

系数计算方式(注：杠杆主要用于计量非系统性风险)(一)单项资产的 系数 单项资产系统风险用 系数来计量，通过以整个市场作为参照物，用单项资产的风险收益率与整个市场的平均风险收益率作比较，即：

=*：//szacc*/Files/BeyondPic/20051214202206830.gif 另外，还可按协方差公式计算

值，即 =*：//szacc*/Files/BeyondPic/20051214202207148.gif

注意：掌握 值的含义 =1，表示该单项资产的风险收益率与市场组合平均风险收益率呈同比例变化，其风险情况与市场投资组合的风险情况一致；

>

1，说明该单项资产的风险收益率高于市场组合平均风险收益率，则该单项资产的风险大于整个市场投资组合的风险；

<

1，说明该单项资产的风险收益率小于市场组合平均风险收益率，则该单项资产的风险程度小于整个市场投资组合的风险。

小结：1) 值是衡量系统性风险，2) 系数计算的两种方式。

Beta的含义 Beta系数起源于资本资产定价模型(CAPM模型)，它的真实含义就是特定资产(或资产组合)的系统风险度量。

所谓系统风险，是指资产受宏观经济、市场情绪等整体性因素影响而发生的价格波动，换句话说，就是股票与大盘之间的连动性，系统风险比例越高，连动性越强。与系统风险相对的就是个别风险，即由公司自身因素所导致的价格波动。

总风险=系统风险+个别风险 而Beta则体现了特定资产的价格对整体经济波动的敏感性，即，市场组合价值变动1个百分点，该资产的价值变动了几个百分点——或

者用更通俗的说法：大盘上涨1个百分点，该股票的价格变动了几个百分点。
用公式表示就是：实际中，一般用单个股票资产的历史收益率对同期指数(大盘)收益率进行回归，回归系数就是Beta系数。

Beta的一般用途 一般的说，Beta的用途有以下几个：

- 1)计算资本成本，做出投资决策(只有回报率高于资本成本的项目才应投资)；
- 2)计算资本成本，制定业绩考核及激励标准；
- 3)计算资本成本，进行资产估值(Beta是现金流贴现模型的基础)；
- 4)确定单个资产或组合的系统风险，用于资产组合的投资管理，特别是股指期货或其他金融衍生品的避险(或投机)。

对Beta第四种用途的讨论将是本文的重点。

组合Beta Beta系数有一个非常好的线性性质，即，资产组合的Beta就等于单个资产的Beta系数按其在组合中的权重进行加权求和的结果。

五、单独个股 系数在哪里可以查到？或者如何简单计算？在线等。

实际中，一般用单个股票资产的历史收益率对同期指数（大盘）收益率进行回归，回归系数就是Beta系数。

使用大盘的收益率和你选择的个股的收益率，在同花顺中可以导出excel中，然后再用数据分析进行回归分析，得到的斜率就是Beta系数。

六、股票指标公式都有哪些?越全越好！谢谢！

目前，证券市场上的各种技术指标数不胜数。

能够熟习应用和综合分析几种就行了。

强弱指标(RSI)、随机指标(KD)、趋向指标(DMI)、平滑异同平均线(MACD)、能量潮(OBV)、心理线、乖离率等。

这些都是很著名的技术指标，在股市应用中长盛不衰。

而且，随着时间的推移，新的技术指标还在不断涌现。

包括：MACD（平滑异同移动平均线）DMI趋向指标（趋向指标）DMA

EXPMA（指数平均数）TRIX（三重指数平滑移动平均）

TRIX（三重指数平滑移动平均）BRAR CR VR（成交量变异率）OBV（能量潮）

ASI（振动升降指标）EMV（简易波动指标）WVAD（威廉变异离散量）

SAR（停损点）CCI（顺势指标）ROC（变动率指标）BOLL（布林线）

WR (威廉指标) KDJ (随机指标) RSI (相对强弱指标) MIKE (麦克指标).

七、您好请问股票 值怎样统计。还有听说国泰君安软件可以查到，您知道吗，谢谢。

值源于资本资产定价模型(CAPM)，它代表着特定资本市场上任意资产的风险与收益的均衡关系，其在数值上等于投资组合收益率相对于市场收益率的协方差与市场收益率方差的比值。

国君软件不知道，不过你可以在下面网站找到 值*：[//share.jrj*.cn/cominfo/AllStock.asp](http://share.jrj*.cn/cominfo/AllStock.asp)这个网址.所有的股票信息.包括BETA系数，只要点击你要查询的股票即可.

八、股票指标公式都有哪些?越全越好！谢谢！

股票价格=股息/利息率 至于为什么是这个看我以前提过的问题：

：[//wenwen.soso/z/q6265955.htm](http://wenwen.soso*/z/q6265955.htm)

九、用分析家股票公式的股票软件有哪些

东方财富通里有此功能

参考文档

[下载：什么软件可以计算股票相关系数的公式.pdf](#)

[《股票成交的手续费怎么计算》](#)

[《股票委比什么意思》](#)

[《为什么上午量的血压比下午的高》](#)

[《期货如何交易与股票有什么区别》](#)

[下载：什么软件可以计算股票相关系数的公式.doc](#)

[更多关于《什么软件可以计算股票相关系数的公式》的文档...](#)

#!NwL!#

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/read/30501771.html>