

两只股票间的相关系数怎样确定 - - 如何快速比较股票间的相关性-股识吧

一、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。

二、在计算出股票之间的相关性之后，这样一个相关系数对于股民来讲有什么用，我们可以根据这个数字得到什么？

简单通俗解释：每个股票组合投资都是风险敞口的，而如果你股票之间相关性较大，则等于把鸡蛋放在一个篮子里，那么一旦你投资相关性非常强的股票组合不是市场热点（甚至是市场重灾区，比如，现在日本福岛核爆炸，那么核电以及核电配套设备公司相关性高，但是目前在市场受到核电利空打击，你的组合反而面临较大风险）的话，难以达到市场收益甚至亏损。

即便你找的都是贝塔系数较高的股票，但是由于自身相关，很可能是大盘强他们弱，仅仅由于其相关性高，而同时受到一个因素干扰。

三、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。

四、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

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。

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

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、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、知道两种股票的历史收盘价怎么算两者之间的相关系数

协方差与期望值有如下关系： $Cov(X, Y) = E(XY) - E(X)E(Y)$ 。

$D(X) = E(X^2) - [E(X)]^2$ 三个公式在了，自己根据数字算吧

九、如何快速比较股票间的相关性

-
-
-
-
-

这个问题嘿嘿我的毕设就是这个，你可以先去期刊网去找找其他人怎么做的，我记得我在01年做的时候，样本剔除后只有300多支股票，分析来分析去，做了很多调整相关性做到了90%以上，可是以前知名学者的全面分析下来只有50%多，当时没有wind之类的东西，全手工excel，现在用wind方便多了。

但是由于我国证券市场从初始到现在因政策5次重大变动产生了较大的变化，我建议你不妨从时间和市场两个角度缩小样本选取（可以选中小板为样本），针对性更强。

参考文档

[下载：两只股票间的相关系数怎样确定.pdf](#)

[《一只股票被低估有什么原因》](#)

[《同花顺如何设置10分钟k线》](#)

[《多少岁可以购买基金》](#)

[《手机mt4怎么挂单交易》](#)

[下载：两只股票间的相关系数怎样确定.doc](#)

[更多关于《两只股票间的相关系数怎样确定》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/read/31584088.html>