

多只股票的相关系数怎么算_已知两只股票相关系数为-1, 如何求无风险利率, 谢谢啦~~~-股识吧

一、我想请教个问题, 如果是一个投资组合里有三个资产, 就比如是三个股票, 那我们可以得到收益, 平方差等。

三个资产 要画图就是画椭圆和直线的切点, 直线代表等收益线, 椭圆代表等方差线, 同样找切点, 这个确实有点复杂, 但画出来的图很好看, 像星系一样的

二、关于概率中相关系数的计算问题

从第一列中如果能找到8个和第二列对应的数据, 就可以

三、财务管理问题: 某公司持有ABC三种股票构成的证券组合, 系数分别为2.0、1.0和0.5

这种情况不应投资。

A的期望收益率=10%+2*(14%-10%)=18%
B的期望收益率=10%+1*(14%-10%)=14%
C的期望收益率=10%+0.5*(14%-10%)=12%
该组合的期望收益率=60%*18%+30%*14%+10%*12%=16.2%
预期收益也称为期望收益, 是指如果没有意外事件发生时根据已知信息所预测能得到的收益。

通常未来的资产收益是不确定的。

不确定的收益可以用多种可能的取值及其对应的概率来表示, 这两者的加权平均, 即数学期望值, 就是资产的预期收益。

学习之前先来做一个小测试吧 [点击测试我合不合适](#) 学会计在投资理财中, 预期收益的重要性, 怎么强调都不为过。

它是进行投资决策的关键, 输入变量计算。

不对它做出估计, 什么买卖决策、投资组合一切都免谈。

它不仅对投资者重要, 对于公司管理者来说, 也同样重要, 因为公司股票的预期收益是影响公司资本成本的主要因素, 关系到公司将来选择什么样的投资项目。

学习财务知识可以到恒企教育, 恒企教育在教辅交互上, 应用大数据实践精准教育, 真正实现个性化教育, 建立有效的课前、课中、课后辅导标准体系, 积极实践社群班级管理, 让学员自觉形成自适应学习。

四、求甲乙两种股票系统性风险大小,求甲乙股票与市场组合的相关系数

没看懂什么意思？

五、相关系数的计算公式是怎样得来的

三个资产 要画图就是画椭圆和直线的切点，直线代表等收益线，椭圆代表等方差线，同样找切点，这个确实有点复杂，但画出来的图很好看，像星系一样的

六、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++

七、已知2支股票的期望报酬率 与市场的相关系数 贝塔值 标准离差，怎么求市场组合的期望报酬率

列两个CAPM的等式，求解 R_f 和 R_m 就可以了：股票的期望报酬率=无风险利率+Beta*(市场期望报酬率-无风险利率)

八、相关系数r的计算公式是什么？

相关系数定义式为：若 $Y=a+bX$ ，则有：令 $E(X) = \mu$ ， $D(X) = \sigma^2$ ，则 $E(Y) = b\mu + a$ ， $D(Y) = b^2\sigma^2$ ， $E(XY) = E(aX + bX^2) = a\mu + b(\sigma^2 + \mu^2)$ ， $Cov(X, Y) = E(XY) - E(X)E(Y) = b\sigma^2$ 。

相关系数是最早由统计学家卡尔·皮尔逊设计的统计指标，是研究变量之间线性相关程度的量，一般用字母 r 表示。

由于研究对象的不同，相关系数有多种定义方式，较为常用的是皮尔逊相关系数。

相关系数定义式为：若 $Y=a+bX$ ，则有：令 $E(X) = \mu$ ， $D(X) = \sigma^2$ ，则 $E(Y) = b\mu + a$ ， $D(Y) = b^2\sigma^2$ ， $E(XY) = E(aX + bX^2) = a\mu + b(\sigma^2 + \mu^2)$ ， $Cov(X, Y) = E(XY) - E(X)E(Y) = b\sigma^2$ 。

相关表和相关图可反映两个变量之间的相互关系及其相关方向，但无法确切地表明两个变量之间相关的程度。

相关系数是用以反映变量之间相关关系密切程度的统计指标。

相关系数是按积差方法计算，同样以两变量与各自平均值的离差为基础，通过两个离差相乘来反映两变量之间相关程度；

着重研究线性的单相关系数。

需要说明的是，皮尔逊相关系数并不是唯一的相关系数，但是最常见的相关系数。

依据相关现象之间的不同特征，其统计指标的名称有所不同。

如将反映两变量间线性相关关系的统计指标称为相关系数（相关系数的平方称为判定系数）；

将反映两变量间曲线相关关系的统计指标称为非线性相关系数、非线性判定系数；

将反映多元线性相关关系的统计指标称为复相关系数、复判定系数等。

相关关系是一种非确定性的关系，相关系数是研究变量之间线性相关程度的量。

需要指出的是，相关系数有一个明显的缺点，即它接近于1的程度与数据组数 n 相关，这容易给人一种假象。

因为，当 n 较小时，相关系数的波动较大，对有些样本相关系数的绝对值易接近于1；当 n 较大时，相关系数的绝对值容易偏小。

特别是当 $n=2$ 时，相关系数的绝对值总为1。

因此在样本容量 n 较小时，我们仅凭相关系数较大就判定变量 x 与 y 之间有密切的线性关系是不妥当的。

九、股票多日的累计涨跌幅如何计算

涨跌幅=(现价-上一个交易日收盘价)/上一个交易日收盘价*100%。

股票具有商品的属性，说白了就是一种“商品”，和别的商品一样，它的价格也受到它的内在价值（标的公司价值）的控制，而且波动在价值上下。

像普通商品一样，股票的价格波动，会受到供求关系的影响。

就像市场上的猪肉一样，当需要的猪肉越来越多，当市场上猪肉供不应求，价格上升是必然的事；

当流入市场中的猪肉多了，造成供大于求，猪肉价这个时候肯定就不会上升。

在股票上就会这样体现：10元/股的价格，50个人卖出，但市场上有100个买，那另外50个买不到的人就会以11元的价格买入，股价就会上涨，反之就会下跌（由于篇幅问题，这里将交易进行简化了）。

平日里，双方的情绪好坏受多方面影响，进而影响到供求关系的稳定，其中产生较大影响的因素有3个，接下来我将给大家进行详细说明。

在这之前，先给大家送波福利，免费领取各行业的龙头股详细信息，涵盖医疗、军工、新能源能热门产业，随时可能被删：【绝密】机构推荐的牛股名单泄露，限时速领！！一、造成股票涨跌的因素有哪些？1、政策行业或产业的发展，离不开国家政策的指导，比如说新能源，几年前我国开始对新能源进行开发，有关企业、产业都得到了政府扶持，比如补贴、减税等。

政策带来了大批的资金投入，尤其是在相关行业中，会挖掘优秀的企业或者上市公司，最终导致股票的涨跌。

2、基本面用长期的目光看，市场的走势和基本面相同，基本面向好，市场整体就向好，比如说疫情后我国经济有所回升，企业盈利增加，股市也就一起回升了。

3、行业景气度这个是十分重要的，股票的变化一般都与行业走势相关，这类公司的股票价格普遍上涨的原因是行业景气度好，比如上面说到的新能源。

为了让大家及时了解到最新资讯，我特地掏出了压箱底的宝贝--股市播报，能及时掌握企业信息、趋势拐点等，点击链接就能免费获取：【股市晴雨表】金融市场一手资讯播报二、股票涨了就一定要买吗？很多新手刚刚接触到股票，一看某支股票涨势大好，立马买了几万块，结果一直往下跌，被套的死死的。

其实股票的变化趋势可以在短期被人为操纵，只要有人持有足够多的筹码，一般来说占据市场流通盘的40%，就可以完全控制股价。

如果你现在是刚入门的股票新手，优先采用长期持有龙头股进行价值投资的方法，避免在短线投资中赔了本。

吐血整理！各大行业龙头股票一览表，建议收藏！应答时间：2022-09-23，最新业务变化以文中链接内展示的数据为准，请点击查看

参考文档

[下载：多只股票的相关系数怎么算.pdf](#)

[《上市公司离职多久可以卖股票》](#)

[《大股东股票锁仓期是多久》](#)

[《股票开户一般多久到账》](#)

[下载：多只股票的相关系数怎么算.doc](#)

[更多关于《多只股票的相关系数怎么算》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/article/72194934.html>