

## 怎么做两只股票的相关系数股票相关性计算-股识吧

### 一、怎么算两组数据的 Pearson 相关系数以及对应的 P value

你是问通过手算怎么得到吗？首先通过计算pearson相关系数公式计算出相关系数，再根据显著性Z检验公式计算Z统计值（这两个公式都可以在网上找到，你在百度里搜索pearson相关系数计算公式，应该可以找到），再根据Z值查表得到概率值P

### 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强，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，仅仅由于其相关性强，而同时受到一个因素干扰。

### 三、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

### 四、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

## 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。

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

## 六、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。

## 七、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

## 参考文档

[下载：怎么做两只股票的相关系数.pdf](#)

[《股票为什么要编制股价指数》](#)

[《2021年7月份买什么股票》](#)

[《公司必须每年支付优先股股息吗》](#)

[《同花顺海通证券怎么选》](#)

[下载：怎么做两只股票的相关系数.doc](#)

[更多关于《怎么做两只股票的相关系数》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/author/23349655.html>