

股票的相关系数怎么算！如何求股票的相关系数和协方差-股识吧

一、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： $2\% * (2/3) + 5\% * (1/3) = 9\%/3 = 3\%$

二、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。

三、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

四、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

五、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

六、一只股票的自相关性怎么算

在自相关图中，自相关系数始终控制在两倍标准差范围内，并且在零轴附近波动，这是纯随机性非常强的平稳时间序列。

有单调趋势的一般为非平稳系列，有正弦波动规律或者周期变化规律的也是非平稳系列平稳性你也可以用时序图来检验

七、知道两种股票的历史收盘价怎么算两者之间的相关系数

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：股票的相关系数怎么算.pdf](#)

[《股票型基金需要多久》](#)

[《买一支股票多久可以成交》](#)

[《股票停止交易多久》](#)

[下载：股票的相关系数怎么算.doc](#)

[更多关于《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/book/23479304.html>