

2只股票相关系数如何计算_两证券协方差和相关系数的计算-股识吧

一、知道两只股票的收益率求相关系数

超额收益一般指超过市场平均水平的收益，相关系数是2个股票超额收益变动的一致性、同步性，一般用线性回归方法来求解。

二、相关系数的计算公式是什么

相关系数介于区间 $[-1, 1]$ 内。

当相关系数为 -1 ，表示完全负相关，表明两项资产的收益率变化方向和变化幅度完全相反。

当相关系数为 $+1$ 时，表示完全正相关，表明两项资产的收益率变化方向和变化幅度完全相同。

当相关系数为 0 时，表示不相关。

三、相关系数的计算公式是什么

相关系数介于区间 $[-1, 1]$ 内。

当相关系数为 -1 ，表示完全负相关，表明两项资产的收益率变化方向和变化幅度完全相反。

当相关系数为 $+1$ 时，表示完全正相关，表明两项资产的收益率变化方向和变化幅度完全相同。

当相关系数为 0 时，表示不相关。

四、两证券协方差和相关系数的计算

一、首先要明白这2个的定义 1、相关系数是协方差与两个投资方案投资收益标准差之积的比值，其计算公式为：相关系数总是在-1到+1之间的范围内变动，-1代表完全负相关，+1代表完全正相关，0则表示不相关。

2、协方差是一个用于测量投资组合中某一具体投资项目相对于另一投资项目风险的统计指标。

其计算公式为：当协方差为正值时，表示两种资产的收益率呈同方向变动；协方差为负值时，表示两种资产的收益率呈反方向变动。

二、要辨清两者的关系 1、相关系数与协方差一定是在投资组合中出现的，只有组合才有相关系数和协方差。

单个资产是没有相关系数和协方差之说的。

2、相关系数和协方差的变动方向是一致的，相关系数的负的，协方差一定是负的。

3、（1）协方差表示两种证券之间共同变动的程度：相关系数是变量之间相关程度的指标根据协方差的公式可知，协方差与相关系数的正负号相同，但是协方差是相关系数和两证券的标准差的乘积，所以协方差表示两种证券之间共同变动的程度。

（2）相关系数是变量之间相关程度的指标，相关系数在0到1之间，表示两种报酬率的增长是同向的；

相关系数在0到-1之间，表示两种报酬率的增长是反向的，所以说相关系数是变量之间相关程度的指标。

总体来说，两项资产收益率的协方差，反映的是收益率之间共同变动的程度；而相关系数反映的是两项资产的收益率之间相对运动的状态。

两项资产收益率的协方差等于两项资产的相关系数乘以各自的标准差。

五、如何计算两个股票的相关系数(correlation)（急）

您的数据不够，无法计算。

需要有A股跟市场的相关系数0.1，B股跟市场的相关系数0.5，以及AB股之间的相关系数（未提供），才能算出AB组合跟市场的相关系数。

六、如何计算两个股票的相关系数(correlation)（急）

您的数据不够，无法计算。

需要有A股跟市场的相关系数0.1，B股跟市场的相关系数0.5，以及AB股之间的相关

系数（未提供），才能算出AB组合跟市场的相关系数。

七、两支股票的协方差怎么算啊

首先用简单的语言来说说什么叫做协方差，方差用来描述一组数据的波动或者分散程度；

协方差实际上是方差的一种特殊情况，即主要变量为两个相同变量时。

协方差衡量两个变量的总体误差，具体计算公式可以百度.....利用公式可以计算出股票A的期望收益率为4.67%，B股票的期望收益率为22.33%，进一步能够计算出协方差为1%。

这种知识类的在百度上搜一下，按照公式算就可以了。

对于公司有问题可以进一步提问。

参考文档

[下载：2只股票相关系数如何计算.pdf](#)

[《股票正式发布业绩跟预告差多久》](#)

[《科创板股票申购中签后多久卖》](#)

[《法院裁定合并重组后股票多久停牌》](#)

[下载：2只股票相关系数如何计算.doc](#)

[更多关于《2只股票相关系数如何计算》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/5019292.html>