

# 如何用correl求股票的相关系数请教一道关于计算股票相关系数的题。-股识吧

## 一、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。

## 二、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

## 三、请教一道关于计算股票相关系数的题。

实际上协方差的公式是这样表达的： $cov(A, B) = stdA * stdB * cor(A, B)$ 其中stdA为资产组合A的标准差，stdB为资产组合B的标准差，cor(A, B)为资产组合A和B之间的相关系数。

简单的算就是 $10\% * 15\% * \text{相关系数} = 100$

## 四、在EXCEL中用“CORREL”函数求两列的相关系数为什么是等于1？

因为正负号表示的是正相关还是负相关，数值表示的是相关程度。

一、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。

二、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。

三、如果数组或引用参数中包含文本、逻辑值或空白单元格，这些值将被忽略，但包含零值的单元格将被计算在内。

如果 array1 和 array2 的数据点个数不同，则返回错误值「#N/A」。

如果 array1 或 array2 为空，则其数值的标准差为 0

，函数返回错误值「DIV/0！」。

四、CORREL 函数计算两组数值的相关系数，CORREL

函数的表达式为：CORREL(array1, array2)。

其中，array1 表示第一组数值单元格区域，array2 表示第二组数值单元格区域。

五、在 Excel 2022 工作表中选择 D16 单元格，输入公式「

=CORREL(C3 : C14, D3 : D14)」，回车后即可得出衬衣销量和温度的相关系数为正数，表明衬衣销量和温度成一定的正比关系，即温度越高衬衣的销量越高。

六、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。

简单相关系数：又叫相关系数或线性相关系数，一般用字母  $r$

表示，用来度量两个变量间的线性关系。

七、复相关系数：又叫多重相关系数。

复相关是指因变量与多个自变量之间的相关关系。

八、典型相关系数：是先对原来各组变量进行主成分分析，得到新的线性关系的综合指标，再通过综合指标之间的线性相关系数来研究原各组变量间相关关系。

## 五、excel相关系数函数correl函数的嵌套

```
=CORREL(indirect("return ! C"& ;  
min($A : $A)& ;  
" : C"& ;  
max($A : $A)) , indirect("index ! G"& ;  
min($A : $A)& ;  
" : G"& ;  
max($A : $A)))
```

## 参考文档

[下载：如何用correl求股票的相关系数.pdf](#)  
[《股票增发预案到实施多久》](#)  
[《买一支股票多久可以成交》](#)  
[《股票腰斩后多久回本》](#)  
[《科创板股票申购中签后多久卖》](#)  
[下载：如何用correl求股票的相关系数.doc](#)  
[更多关于《如何用correl求股票的相关系数》的文档...](#)  
#!NwL!#

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/chapter/36011149.html>