

两只股票相关系数怎么算...求两只股票权重？-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。

指数的加权市盈率为加权市值/加权利润=8.16 所以股票B的市盈是5.4应该没错吧?//
@守株待兔的夹头:回复@守株待兔的夹头:指数100%权重计算总盈利

二、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： $\text{cov}(A, B) = \text{std}A * \text{std}B * \text{cor}(A, B)$ 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 $10\% * 15\% * \text{相关系数} = 100$

三、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： $2\% * (2/3) + 5\% * (1/3) = 9\%/3 = 3\%$

四、求两只股票权重？

指数的加权市盈率为加权市值/加权利润=8.16 所以股票B的市盈是5.4应该没错吧?//
@守株待兔的夹头:回复@守株待兔的夹头:指数100%权重计算总盈利

五、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： $\text{Cov}(X, Y) = E(XY) - E(X)E(Y)$ 。
 $D(X) = E(X^2) - [E(X)]^2$ 三个公式在了，自己根据数字算吧

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、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

八、如何分析两只股票的涨幅的相关系数？

首先你需要选择两只股票的涨跌数据，比如可以是向前为其三个月的数据，或者是一年的数据，然后把两只股票每天的涨跌数据一一对应收集起来。
然后就可以采用简单的相关分析，甚至其他的统计分析方法分析两只股票的关系。
不过说实话
中国的股票数据反映的并不是经济规律的真相，更多的是政策和市场信息的影响。

九、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

参考文档

[下载：两只股票相关系数怎么算.pdf](#)

[《中信证券卖出股票多久能提现》](#)

[《股票买入委托通知要多久》](#)

[《新的股票账户多久可以交易》](#)

[《退市股票确权申请要多久》](#)

[下载：两只股票相关系数怎么算.doc](#)

[更多关于《两只股票相关系数怎么算》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/store/10324772.html>