

## 两只股票相关系数怎么算-已知2支股票的期望报酬率 与市场的相关系数 贝塔值 标准离差 ，怎么求市场组合的期望报酬率-股识吧

### 一、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

### 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： $cov(A, B) = stdA * stdB * cor(A, B)$ 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 $10\% * 15\% * \text{相关系数} = 100$

### 三、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

### 四、已知2支股票的期望报酬率 与市场的相关系数 贝塔值 标准离差 ，怎么求市场组合的期望报酬率

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

## 五、已知2支股票的期望报酬率 与市场的相关系数 贝塔值 标准离差 ，怎么求市场组合的期望报酬率

列两个CAPM的等式，求解 $R_f$ 和 $R_m$ 就可以了：股票的期望报酬率=无风险利率+Beta\*(市场期望报酬率-无风险利率)

## 六、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

## 七、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。

## 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、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

### 参考文档

[下载：两只股票相关系数怎么算.pdf](#)

[《中原银行股票什么时候转a股》](#)

[《你怎么知道哪只股票能赚一倍的钱》](#)

[《怎么提前知道股票的热门板块》](#)

[《油价是什么股票》](#)

[《期货多单和空单数量一样吗》](#)

[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/10324912.html>