

两只股票的相关系数多少才好，在一个完全有效的市场上，两只股票间的相关系数怎样确定？为多少？-股识吧

一、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

二、刻画两个证券相关性参数是什么？

相关系数：等于0，表示两个证券独立；

等于1，表示两个证券完全正相关（变化趋势和幅度相同）；

等于-1，表示完全负相关；

大于0小于1，表示正相关，仅变化趋势一致；

大于-1小于0，表示变化趋势相反。

三、在一个完全有效的市场上，两只股票间的相关系数怎样确定？为多少？

这问题可以做成硕士论文了，现实中就没有完全有效的股票市场，特别在当下，利好不涨利空不跌，两只股票的相关系数只能去问庄家如何操作了，这跟他的操作手法他对未来的判断有密不可分的关系。

四、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： $2%*(2/3)+5%*(1/3)=9%/3=3%$

五、求甲乙两种股票系统性风险大小，求甲乙股票与市场组合的相关系数

没看懂什么意思？

六、

七、相关系数多大才算相关性比较好啊

大于0.8

八、对一个两只股票的资产组合，它们之间的相关系数是多少为最好

-1，实现完全对冲，最大化分散化的好处

参考文档

[下载：两只股票的相关系数多少才好.pdf](#)

[《健身房上市公司有哪些》](#)

[《股票是根据什么走高走低的呢》](#)

[《股票当天买的不可以当天卖吗为什么》](#)

[《股票马赫数是什么》](#)

[下载：两只股票的相关系数多少才好.doc](#)
[更多关于《两只股票的相关系数多少才好》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/7766338.html>