

# 股票收益率怎么求相关系数 - 股票收益率这个股票收益率是如何计算出来的？ - 股识吧

## 一、相关系数的计算公式是怎样得来的

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。

## 二、某只股票要求的收益率为15%，收益率的标准差为25%，与市场投资组合收益率的相关系数为0.2，市场投资组合要

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

## 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、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

## 五、股票收益率这个股票收益率是如何计算出来的？

有两种，一种是净资产收益率，净利润/净资产一种是每股收益率，（净利润/总股本）/股价

## 六、某只股票要求的收益率为15%，收益率的标准差为25%，与市场投资组合收益率的相关系数为0.2，市场投资组合要

答：（1）计算甲、乙股票的必要收益率：由于市场达到均衡，则期望收益率 = 必要收益率甲股票的必要收益率 = 甲股票的期望收益率 = 12%乙股票的必要收益率 = 乙股票的期望收益率 = 15%（2）计算甲、乙股票的β值：根据资产定价模型：甲股票： $12\% = 4\% + \beta \times (10\% - 4\%)$ ，则  $\beta = 1.33$ 乙股票： $15\% = 4\% + \beta \times (10\% - 4\%)$ ，则  $\beta = 1.83$ （3）甲、乙股票的收益率与市场组合收益率的相关系数：根据甲股票的收益率与市场组合收益率的相关系数 =  $1.33 \times 0.2 = 0.266$ 乙股票的收益率与市场组合收益率的相关系数 =  $1.83 \times 0.2 = 0.366$ （4）组合的β系数、组合的风险收益率和组合的必要收益率：组合的β系数 =  $60\% \times 1.33 + 40\% \times 1.83 = 1.53$ 组合的风险收益率 =  $1.53 \times (10\% - 4\%) = 9.18\%$ 组合的必然收益率 =  $4\% + 9.18\% = 13.18\%$

## 七、股票收益率的计算公式是什么？

股票收益率=收益额/原始投资额当股票未出卖时，收益额即为股利。  
衡量股票投资收益水平指标主要有股利收益率、持有期收益率与拆股后持有期收益率等。

股票收益率是反映股票收益水平的指标。

投资者购买股票或债券最关心的是能获得多少收益，衡量一项证券投资收益大小以收益率来表示。

股票持有期收益率持有期收益率指投资者持有股票期间股息收入和买卖差价之和与股票买入价的比率。

股票还没有到期日，投资者持有股票时间短则几天、长则数年，持有期收益率是反映投资者在一定的持有期内的全部股利收入与资本利得占投资本金的比重。

持有期收益率为投资者最关心的指标，但如果要把它与债券收益率及银行利率等其他金融资产的收益率作比较，必须注意时间的可比性，即要把持有期收益率转化为年率。

扩展资料：反映股票收益率的高低，一般有三个指标：本期股利收益率。是以现行价格购买股票的预期收益率。

持有期收益率。

股票没有到期，投资者持有股票的时间有长有短，股票在持有期间的收益率为持有期收益率。

折股后的持有期收益率。

股份公司进行折股后，出现股份增加和股价下降的情况，因此，折股后股票的价格必须调整。

参考资料：百科-股票收益率

## 八、股票收益率怎么求

你想知道谁的收益率？如果是数据中每天的收益率，就是最后一项的涨跌幅。如果是买卖收益率，就是： $\text{卖出获得的钱} \div \text{买入花的钱} - 1 = \text{股票买卖的收益率}$ 以此类推谢谢你的提问

## 参考文档

[下载：股票收益率怎么求相关系数.pdf](#)

[《股票转营业部需多久》](#)

[《股票你们多久看一次》](#)

[《股票停牌复查要多久》](#)

[《董事买卖股票需要多久预披露》](#)

[《股票账户多久不用会失效》](#)

[下载：股票收益率怎么求相关系数.doc](#)

[更多关于《股票收益率怎么求相关系数》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/subject/26817739.html>