

两个股票相关系数怎么计算出来...已知两只股票相关系数为-1, 如何求无风险利率, 谢谢啦~~~-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、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。

列两个方程组, 可以参考无风险套利推导公式++

四、已知两只股票相关系数为-1, 如何求无风险利率, 谢谢啦~~~

列两个方程组, 可以参考无风险套利推导公式++

五、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

六、在计算出股票之间的相关性之后，这样一个相关系数对于股民来讲有什么用，我们可以根据这个数字得到什么？

简单通俗解释：每个股票组合投资都是风险敞口的，而如果你股票之间相关性较大，则等于把鸡蛋放在一个篮子里，那么一旦你投资相关性非常强的股票组合不是市场热点（甚至是市场重灾区，比如，现在日本福岛核爆炸，那么核电以及核电配套设备公司相关性强，但是目前在市场受到核电利空打击，你的组合反而面临较大风险）的话，难以达到市场收益甚至亏损。

即便你找的都是贝塔系数较高的股票，但是由于自身相关，很可能是大盘强他们弱，仅仅由于其相关性强，而同时受到一个因素干扰。

参考文档

[下载：两个股票相关系数怎么计算出来.pdf](#)

[《股票大盘多久调一次》](#)

[《股票卖出多久继续买进》](#)

[《股票停止交易多久》](#)

[《一个股票在手里最多能呆多久》](#)

[下载：两个股票相关系数怎么计算出来.doc](#)

[更多关于《两个股票相关系数怎么计算出来》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/35172694.html>