

# 股票相关性怎么算出来的|影响股票的各种因素和相关计算公式-股识吧

## 一、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 $10\% * 15\% * \text{相关系数} = 100$

## 二、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

## 三、影响股票的各种因素和相关计算公式

50元；

所失"。

如一家公司股票股权登记日收盘价为10元，其每股派红利0.50元。

但经过除息之后，该公司的股价变成了9，相反还是&amp;

quot买入成本=买入股数\*当时股价\*(千分之三的手续费+千分之一的印花税)+过

户费卖出成本=卖出股数\*当时股价\*(千分之三的手续费+千分之一的印花税)+

过户费每股买入成本价=当前价格+(当前价格\*(千分之三的手续费+千分之一

的印花税)+过户费) / 买入股数股票当前成本价=(买入股票支付的所有资金-卖

出股票得到的所有资金) ÷ 当前持有数量现行的除息制度与红利税征收政策将上市

公司的分红化为乌有，分红不仅不是投资者的"所得"，而投资者实际得到的红利只

有0.45元；

另有0.05元被征收了红利税

## 四、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。

## 五、股票相关性计算

相关性分析比较书面化，因为实际中同时影响多只股票的因素很多，不好剔除。但是如果你要简单性进行数据分析的话，那么就设立一个时间段，把这个时间段两只或者多只股票的涨跌幅变化进行对比就可以了。

这是最简单但最不精确的方法。

如果你想严谨一些，那么选定时间段，选取两只或多只股票所在的行业，把这几只股票和行业整体情况作对比，再将整个行业和大盘作对比，只要你选取的时间段足够长，那么得出的整个行业的 $\beta$ 系数还是比较靠谱的，依据这个 $\beta$ 系数你再相互比较应该就可以得出这几只股票间的

## 参考文档

[下载：股票相关性怎么算出来的.pdf](#)

[《买股票买多久可以赎回》](#)

[《股票k线看多久》](#)

[下载：股票相关性怎么算出来的.doc](#)

[更多关于《股票相关性怎么算出来的》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/64373017.html>