

## 两只股票之间的相关系数怎么求, 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、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 $10\% * 15\% * \text{相关系数} = 100$

### 二、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。

### 三、如何分析两只股票的涨幅的相关系数?

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。

### 四、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

## 五、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++

## 六、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： $2\% * (2/3) + 5\% * (1/3) = 9\%/3 = 3\%$

## 七、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

## 参考文档

[下载：两只股票之间的相关系数怎么求.pdf](#)

[《换手率0.78代表什么》](#)

[《左江科技股票是干什么的》](#)

[《炒股票x祥什么米》](#)

[下载：两只股票之间的相关系数怎么求.doc](#)

[更多关于《两只股票之间的相关系数怎么求》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/68545496.html>