

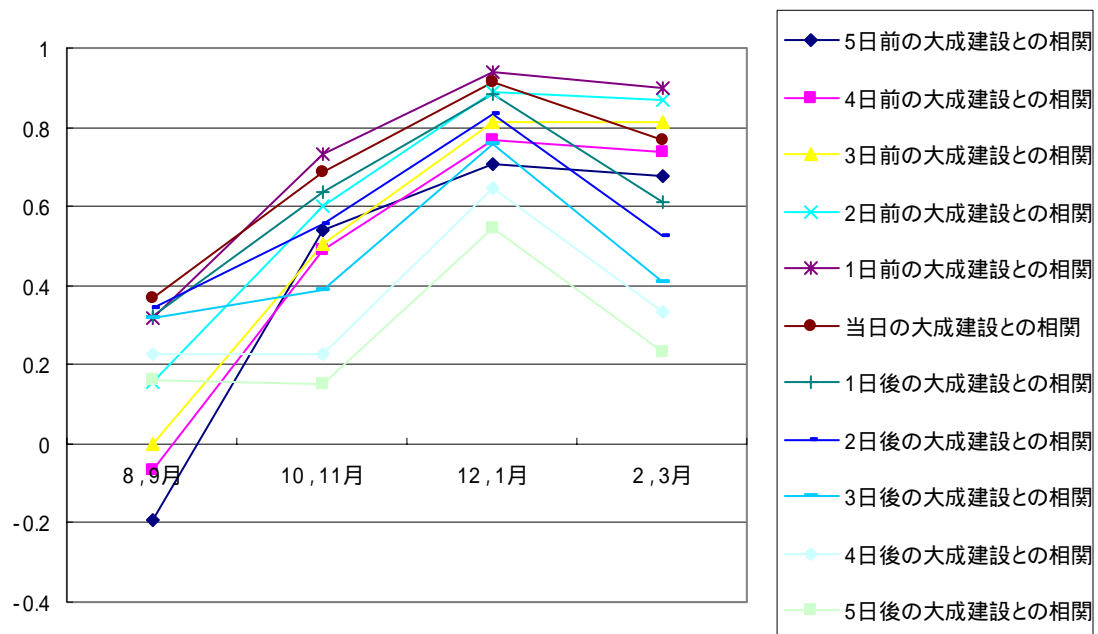
## 大林組(1802)と大成建設(1801)の相関係数の計算

本稿では,大林組(1802)の株価と,その前後の大成建設(1801)の株価の相関関数を計算した.

相関係数とは,2組のデータが関連性が高いか,それとも関係があまりないかという尺度である.大林組と大成建設の株価データの関連性が高い場合には,どちらかの値動きで,もう一方の値動きがある程度推定できることになる.

相関係数は, $-1$  から  $1$  で, $1$  の場合がもっとも相関が高く, $0$  の場合は無相関, $-1$  の場合は逆の相関がもっとも高い.したがって,大林組の株価と大成建設の株価の相関係数が  $1$  に近ければ,大林組の株が上昇すれば,大成建設の株価も上昇することになる.逆に  $-1$  に近ければ大林組の株が上昇すれば,大成建設の株価も下降することになる.相関係数が  $0$  であれば,大林組の株が上昇しても,大成建設の株価は上昇するか下降するかはわからない.

相関係数の計算は,当日の大林組の株価(終値)と,その前後5日の大成建設の株価(終値)について行った.計算期間は,(1)2001年8,9月,(2)2001年10,11月,(3)2001年12月,2002年1月,(4)2002年2,3月の4つの期間に分けて行った.計算の結果を図に示す.



結果、当日の大林組の株価と、その 1 日前の大成建設の株価の相関係数が他のものより、高い傾向にあることがわかった。したがって、大成建設の株の値動きは、大林組の株の値動きより、1 日早い傾向にあるといえ、大成建設の株が上がれば、翌日の大林組の株も上昇する可能性が大きいといえる。

以上

情報の内容に関しては万全を期しておりますが、その内容の正確性および安全性を保証するものではありません

投資はご自身の判断でお願いいたします。

当方は、この情報を用いて行う判断の一切について責任を負いません。

**かぶまる** 2002 年 5 月 26 日作成