如何检测时间序列的动量模式？

1. 时间序列动量模式项下的一系列价格意味着**过去与未来**的收益回报呈正相关性。

* 正是由于影响一个变量的因素有多个，才造成了它们间关系的不确定性。变量之间这种不确定的关系称为**相关关系**（correlation）。

1. 那么接下来，我们就可以计算出相应收益率的相关系数，

* **相关系数**（correlationcoefficient）是度量两个变量之间线性关系强度的统计量。样本相关系数记为r，计算公式为：按式（8.1）计算的相关系数也称为Pearson相关

1. 同时确定一个假定的p值（其所代表的是不相关之零假设的概率）。