

股票风险预警模型有哪些，财务风险评价模型有哪些?-股识吧

一、深交所对其股票实行警示风险提示的情形有哪些。

连续三年报亏损，信息披露违规，等。

二、财务风险评价模型有哪些？

财务风险评价模型主要有单变量模型,多变量模型. 一、单变量模型 单变量模型是指使用单一财务变量对企业财务失败分险进行预测e79fa5e98193e78988e69d8331333337386539的模型。

主要有威廉·比弗(William Beaver)于1966年提出的单变量预警模型。

他通过对1954~1964年期间的大量失败企业和成功企业比较研究，对14种财务比率进行取舍，最终得出可以有效预测财务失败的比率依次为：

1. 债务保障率=现金流量 ÷ 债务总额 2. 资产负债率=负债总额 ÷ 资产总额
3. 资产收益率=净收益 ÷ 资产总额 4. 资产安全率=资产变现率-资产负债率 Beaver认为债务保障率能够最好地判定企业的财务状况(误判率最低);其次是资产负债率，且离失败日越近，误判率越低。

但各比率判断准确率在不同的情况下会有所差异，所以在实际应用中往往使用一组财务比率，而不是一个比率，这样才能取得良好的预测效果。

二、多变量模型

多变量模型是指使用多个变量组成的鉴别函数来预测企业财务失败的模型。

较早使用多变量预测的是美国纽约大学的教授爱德华·阿尔曼(Edwardi.altman)，他是第一个使用鉴别分析(discriminant analysis)研究企业失败预警的人。

他选取了1946~1965年间的33家破产的和正常经营的公司，使用了22个财务比率来分析公司潜在的失败危机。

他利用逐步多元鉴别分析(MDA)逐步粹取5种最具共同预测能力的财务比率，建立起了一个类似回归方程式的鉴别函数--Z计分法模式。

该模型是通过五个变量(五种财务比率)将反映企业偿债能力的指标、获利能力指标和营运能力指标有机联系起来，综合分析预测企业财务失败或破产的可能性。

三、财务预警模型主要有哪几种？

1、单变量模型单变量模型是指使用单一财务变量对企业财务失败风险进行预测的模型。

主要有威廉·比弗(William Beaver)于1966年提出的单变量预警模型。

2、多变量模型多变量模型是指使用多个变量组成的鉴别函数来预测企业财务失败的模型。

较早使用多变量预测的是美国纽约大学的教授爱德华·阿尔曼(Edwardi.altman)，他是第一个使用鉴别分析(discriminant analysis)研究企业失败预警的人。

扩展资料财务预警模型的重要性：建立财务预警模型最根本的是要选择一个合适的分析模式，也就是要首先分析判断所研究的对象是适合选用单变量模型还是多变量模型。

如果对企业的财务运行有深刻的认识，并且具有丰富的实践经验，能够清楚地了解企业财务指标变化的规律。

同时也认为企业的重要变化基本可用一属个指标组合来体现，或企业的财务体系比较简单，就不妨考虑选择单变量模型。

反之，如企业的财务体系比较复杂，财务变动难以用一个指标来体现，就应考虑使用多变量模型。

参考资料来源：百度百科-财务预警

四、股票风险的度量主要有哪些

在用于度量证券组合投资风险的协方差矩阵为非正定时，研究允许卖空且存在无风险证券的证券组合投资决策模型，给出了最优投资比例系数的计算方法及有效边界。

在投资活动中，收益和风险是投资者关心的两个基本问题。

现代投资理论创始人 Markowitz假定投资风险可视为投资收益的不确定性，这种不确定性可用统计学中的方差或标准差来度量

，而投资收益可用统计学中的均值或期望来度量。

理性的投资者在进行投资决策时追求的是收益

五、

六、风险警示股票有哪些

风险警示板是上海证券交易所（以下简称上交所），保障上市公司退市制度的切实执行，保护投资者的合法权益，拟设立的，对被予以退市风险警示的公司及其他重大风险公司实行另板交易。

2013年1月4日，风险警示板正式运行，首批入板43只股票。

2013年1月30日，ST博元获上交所批准撤销“特别处理”，更名博元投资，成为第一只离开风险警示板的股票。

2013年3月29日，A股迎来史上最大市值的ST公司——*ST远洋。

*ST远洋进入风险警示板时市值高达400亿元。

风险警示板独立于主板，买卖该板股票需要申请开通购买风险警示板股票权限。

七、宏观销售风险的预警先行指标有哪些

先行指标：1) 宏观经济政策调整；

2) 物价上涨；

3) 石油、煤炭、电力、交通、农产品等基础产业产品价格的大幅度变动；

4) 外汇市场；

5) 产品销价骤降；

6) 需求骤降；

7) 竞争关系。

参考文档

[下载：股票风险预警模型有哪些.pdf](#)

[《股票出现xd后什么时候卖》](#)

[《股票收益超过20什么时候可以止盈》](#)

[《拉升股票的标准是什么》](#)

[下载：股票风险预警模型有哪些.doc](#)

[更多关于《股票风险预警模型有哪些》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/article/5961343.html>