

如何利用回归分析法分析股票--怎样用计量的方法分析股票?-股识吧

一、求谁能帮帮我，如何用EVIEWWS软件，分析股票指数。用最小二乘法和自回归条件异方差用CAPM模型算风险

不好意思，我不知道是你的表达有问题，还是我没学精。

如果说你要分析股指，我想到的不是capm，而是影响证券市场的各因素。

因为capm考虑的就是市场上不能被分散的系统性风险.....如果你说你要用capm我想到的是，你可能要求的是股票指数的收益率，但是我不明白的是，如果股指的波动是你要测算的，而我们一般都把股指的波动看作是系统性风险，那么capm中很重要的市场风险你用啥度量？另外，你说你用最小二乘法，我直接理解就是你的自变量是（市场风险-无风险利率），因变量是股指的波动。

你想做的事就是单变量的线形规划.....去确定beta。

最后，自回归是检验和对模型的修正.....如果你不介意，你可以把问题说得再清楚点.....否则真的很难揣测.....

二、如何严格利用经济学去分析一只股票

以Excel2022为例。

1、“开发工具”选项卡

中单击“加载项”组中的“加载项”按钮，打开“加载宏”对话框。

如下图。

勾选“分析工具库”。

2、“数据”选项卡中“分析”组中的“数据分析”按钮，打开“数据分析”对话框。

如下图。

单击“回归”选项。

三、如何严格利用经济学去分析一只股票

作为新手进入股市，一定要牢记“股市有风险”这句话。

股市并不是遍地是黄金，你能随便赚钱。

相反。

股市输钱的机会也高。

股市上有句俗话：十个炒股七个输两个平一个赢。

这句话有可能不准确，但这句话确实很有道理的。

这句话至少能告诉你股市孕育的风险也是非常大的。

防范风险，就需要你选择好个股。

1公司所处的行业具体分析一只股票，第一是要看这支股票所处的行业。

如果公司所处的行业是国家垄断的行业，且在行业中占据领导地位，或者说在行业中占有相当的份额，那么，这类股票就值得关注。

当然，如果公司所处的行业是竞争非常激烈的行业，且在行业中不那么令人注意，同时在行业里市场份额也不大，那么这类股票不碰为好。

2公司的流通股本具体分析一只股票，第二是要看该股票的流通股本有多少。

流通股本在几千万的都应该算小盘股了，而流通股本在10来亿的应该算中盘股。

而流通股本在几千亿的应该算超级大盘股了。

通常情况下，中盘股、小盘股拉升远远比大盘股来的快的多。

所以，通常情况下，选择中小盘股票。

3公司的控股股东具体分析一只股票，第三是要看这支股票的控股股东。

公司的第一大股东及其关联企业在公司中控股是否超过50%以上？如果超过50%，那么，第一大股东对该公司绝对控股。

第一大股东的绝对控股标志着公司能持续发展。

如果第一大股东不能绝对控股，有可能导致被其他公司趁虚而入，从而导致股票在市场上动荡不已。

在公司股东中，前10大股东你需留意。

4公司的高级管理人员具体分析一只股票，第三是要看这支股票的高级管理人员的素质。

特别是董事长。

作为公司的掌门人，董事长自身素质是非常重要的。

这就需要你在平时的新闻、报刊、杂志里去收集董事长的点点滴滴的事迹。

在这里，需要特别指出的是那种肯做慈善事业的董事长，通常具有良好的品德，既然肯做好事，那么，管理自己的公司也不会差到哪里去。

5公司的业绩具体分析一只股票，第四就是要看股票的业绩。

业绩是衡量公司是否优秀的最为重要的标准。

一个优秀的公司，应该有良好的业绩，有创造净利润的能力。

公司的业绩是通过良好的管理，严格的财务，优质的服务创造出的。

那些把公司吹上了天，但业绩却非常差的公司的股票尽量不要去碰。

6公司的股东权益具体分析一只股票，第五就是要看股票的股东权益。

通常情况下，股东权益越高的股票，意味着公司的分红会很好。

要了解股票往年的分红派息情况。

如果一只股票，年年分红派息仍保持较高的股东权益，那么，这种股票值得你拥有。

毕竟，市场通常对那种高送配的股票比较追捧。

7公司的公告具体分析一只股票，第六就是要看该股票在消息面上的各种公告。

要用去伪存真的思维去分析。

记得以前有个报社的人写了篇文章叫“鱼塘里放卫星”。

这篇文章就是对某公司的业绩提出严重质问，认为一个养鱼的公司不可能有这么好的业绩。

当时这篇文章一发表，立刻在市场上引起欣然大波，那公司股价立刻大跌。

结果的事实还真叫这位报社的人说准了，那公司在造假账。

这件事情说明了，我们需要用自己的思维去分析公司的公告，而不能听别人的。

四、什么是回归分析？回归分析有什么用？主要解决什么问题？

回归分析，也有称曲线拟合.当在实验中获得自变量与因变量的一系列对应数据， $(x_1, y_1), (x_2, y_2), (x_3, y_3), \dots, (x_n, y_n)$ 时，要找出一个已知类型的函数， $y=f(x)$ ，与之拟合，使得实际数据和理论曲线的离差平方和： $\sum [y_i -$

$f(x_i)]^2$ （从 $i=1$ 到 $i=n$ 相加）为最小.这种求 $f(x)$ 的方法，叫做最小二乘法。

求得的函数 $y=f(x)$ 常称为经验公式，在工程技术和科学研究的数据处理中广泛使用.

最普遍的是直线(一次曲线)拟合，在现代质量管理上，对散布图的相关分析上也用

此法.当然，以上仅介绍了回归分析的一部分简要内容，要详细了解，应读大学，

或自学到这个程度.我是自学的，我想你只要坚持不懈的努力，也是会成功的.

五、请问怎么用回归分析对财务风险进行评价？

只要您确定模型的变量，即可做回归分析了。

六、如何用Eviews6，通过某只股票以前的价格数据，分析未来的价格走势，用Eviews什么分析可以做到。

做一下时间序列模型分析

七、用技术分析法分析一支股票

不能！只用技术分析法甚至会让你大亏！因为主力可以做骗线。

10多年的枪林弹雨让我最终抛弃了指标！做股票应首先分析宏观经济、政策、行业，然后分析股票的形态位置，技术分析仅做介入时的参考，KDJ CCI 等意义不大，我根本不看（没用！）在指标中较有参考价值的是MACD、成交量、均线系统及形态，最重要的是盘口！但要能看出点门道至少也要10年以上的实战经验！但初入市总是会从技术分析入手，这也是最基本的，是学前班。

用心学吧路还很漫长，但愿10年后你能明白这些话。

建议：少投点钱

八、怎样用计量的方法分析股票？

1、股票的行情不是算出来的。

2、如果你真想通过计量的方法来预测接下来的走势，你要弄明白一些问题：趋势的问题、波浪折线的问题、成本均线的问题；

3、还需要懂得一些经典常用的指标，作为参考；

4、懂得黄金分割线的用法；

5、上述问题都熟悉后，你可以参考徐小明写的 数字定量化分析 这本书，里面介绍怎么通过计算去预测后期的趋势。

为什么要求熟悉那么多呢？就是因为找点的问题相当重要，找点不准计算出来的结果天差地别，同时要注意，只能作为预测参考，不能作为操作标准，一切都以行情以市场作为基准。

参考文档

[下载：如何利用回归分析法分析股票.pdf](#)

[《证券转股票多久到账》](#)

[《委托股票多久时间会不成功》](#)

[《董事买卖股票需要多久预披露》](#)

[《股票流通股多久可以卖》](#)

[下载：如何利用回归分析法分析股票.doc](#)
[更多关于《如何利用回归分析法分析股票》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/author/34299960.html>