

# 股票时间序列选什么\_非平稳时间序列可以预测股票走势吗-股识吧

## 一、时间序列分析capm需要哪些数据

做CAPM分析需要一个market portfolio，过去人们总是选择纽约股票市场模拟这么一个market portfolio。后来Roll1976年写了一篇文章，说这种方法未必正确，因为这样得出来的数据确实在mean-variance efficient frontier 上，但是不一定是market portfolio。后来人们提出了一种方法，用managed portfolio，把时间序列中条件期望变成无条件期望，常常关注的变量就是 the market return，the D/P ratio，the term premium，market return 乘以 the D/P ratio，market return 乘以 the term premium。这被称为五要素模型（five-factor model）。

## 二、股票分析选用ar模型好还是ma模型好

直观判断：依据自相关图与偏自相关图，例如自相关图是递减（或震荡递减）而偏自相关是某阶后突变为零的，大体上就是AR 再者就是AIC准则咯，越小越好  
沃尔特 恩德斯（Walter Enders）应用计量经济学——时间序列分析

## 三、经济时间序列是什么

事物的发展变化趋势会延续到未来，反映在随机过程理论中就是时间序列的平稳性或准平稳性。

投入产出法，作为一种科学的方法来说，是研究经济体系（国民经济、

## 四、时间序列在股市行情预测中的应用论文怎么写？

直观判断：依据自相关图与偏自相关图，例如自相关图是递减（或震荡递减）而偏

自相关是某阶后突变为零的，大体上就是AR 再者就是AIC准则咯，越小越好  
沃尔特 恩德斯 (Walter Enders) 应用计量经济学——时间序列分析

## 五、非平稳时间序列可以预测股票走势吗

一般把非平稳时间序列转化为平稳时间序列的方法是取n阶差分法。

比如举个例子，假设 $x_t$ 本身是不平稳的时间序列，如果 $x_t \sim I(1)$

,也就是说 $x$ 的1阶差分是平稳序列。

那么  $x_t$ 的1阶差分 $dx_t=x(t)-x(t-1)$  就是平稳的序列 这时 $dx_t=x(t-1)$ 如果 $x_t \sim I(2)$ ，就是说 $x_t$ 的2阶差分是平稳序列的话 $x_t$ 的1n阶差分 $dx_t=x(t)-x(t-1)$

这时 $x_t$ 的1阶差分依然不平稳，那么

对 $x_t$ 的1阶差分再次差分后， $x_t$ 的2阶差分 $ddx_t=dx_t-dx_t(t-1)$  便是平稳序列

这时 $dx_t=-x(t-1)-dx_t(t-1)$  n阶的话可以依次类推一下。

## 参考文档

[下载：股票时间序列选什么.pdf](#)

[《st股票摘帽最短多久》](#)

[《股票涨30%需要多久》](#)

[《股票多久才能反弹》](#)

[下载：股票时间序列选什么.doc](#)

[更多关于《股票时间序列选什么》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/chapter/12927256.html>