

模拟股票指数可以用什么模型，求谁能帮帮我，如何用E VIEWS软件，分析股票指数。用最小二乘法 and 自回归条件异方差用CAPM模型算风险-股识吧

一、麻烦告诉我CAPM模型和APT模型的区别？

随便说说，楼主自己参考 1、CAPM是单因素模型，APT是CAPM的特例，如果影响证券系统性风险可以市场组合衡量，并且市场组合可以用股票指数代替的话，两者是一致的。

2、CAPM是建立在效用函数的基础上，假设投资者永不满足，风险厌恶。

APT是建立在套利的基础上，对风险偏好无限制。

3、CAPM之考虑系统性风险，APT考虑了很多风险，解释力更强。

4、CAPM的市场组合难以观测，而APT只要一个充分分散的证券组合，不需要市场组合。

5、CAPM详细指明了风险因素，而APT没有详细指明，具有主观性。

6、APT的得出是一个动态过程，CAPM的得出是一个静态的过程，在市场有效组合的基础上最小化风险或者最大化收益。

二、求谁能帮帮我，如何用E VIEWS软件，分析股票指数。用最小二乘法 and 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.....

三、东方财富通有模拟交易股指的功能吗?

我现在用的是中升国际的股指平台，服务挺全面的，不过要是想赚钱还要看自己的眼力了

四、东方财富通有模拟交易股指的功能吗?

有的

五、东方财富通有模拟交易股指的功能吗?

有的

参考文档

[下载：模拟股票指数可以用什么模型.pdf](#)

[《投资人为什么要提前多久买股票》](#)

[《股票跌停多久退市》](#)

[《新的股票账户多久可以交易》](#)

[《股票要多久才能学会》](#)

[《股票放多久才能过期》](#)

[下载：模拟股票指数可以用什么模型.doc](#)

[更多关于《模拟股票指数可以用什么模型》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/store/61772258.html>