

股票方差怎么做；关于无差异曲线和生产可能性边界-股识吧

一、假设一个单因素模型，上述每个股票的剩余方差是多少

股票价格受很多影响，资本资产定价模型只能从理论上分析风险与报酬率的关系。所谓风险也就是股价偏离期望值的大小和程度。

也就是说这种模型从计算系统风险开始即采用概率论观点计算方差，进而求出股票的投资者要求的必要报酬率，这种模型根据的是股票市价的期望值和偏离期望值的程度，而并非一个确定的价格。

此外，根据公式求解出的投资者要求必要报酬率在实际中也不一定准确，因为资本市场并非完全有效，必要报酬率和风险并非完全匹配。

就算上述因素都排除，根据股权现金流和必要报酬率折现的股票价值也存在很大误差，这是因为股票的未来现金流量估计几乎是不可能完成的。

其次，资本市场并非完全有效导致股票市价并不能反映其价值。

所以，财务管理研究的资本市场定价模型、股利增长模型等都只能从一定程度上反应股票价值的变动，而且是并不十分准确的假设作出的，只具有有限的参考价值。

二、关于无差异曲线和生产可能性边界

1、无差异曲线（Indifference curve）无差异曲线是一条表示线上所有各点两种物品不同数量组合给消费者带来的满足程度相同的线。

2、股市用语。

无差异曲线是对一个特定的投资者而言，根据他对期望收益率和风险的偏好态度，按照期望收益率对风险补偿的要求，得到的一系列满意程度相同的（无差异）证券组合在均值方差（或标准差）坐标系中所形成的曲线。

3、无差异曲线的特征1)无差异曲线是一条向右下方倾斜的线，斜率是负的。

表明为实现同样的满足程度，增加一种商品的消费，必须减少另一种商品的消费。

2) 在同一个平面上可以有无数条无差异曲线。

同一条曲线代表相同的效用，不同的曲线代表不同的效用。

3) 无差异曲线不能相交。

否则无差异曲线的定义会和它的第二特征发生矛盾。

4) 无差异曲线凸向原点。

因为无差异曲线代表效用，所以凸向原点。

生产可能性边界代表不同的生产组合，所以凹。

三、关于方差计算的问题

当然是日方差了，你算的30日平均值，然后用每日价格和平均价格比较，得出的是日方差。

如果是每个月（30日）的某个股价（如没30日的股票收盘价）为基准，那才是月方差。

四、我想划分出长线、中线和短线三个板块，请问我该用什么方法啊例如方差，季节差分等 请高手指点

呵呵。

。

。

又一个钻牛角尖的人。

每只股都可以做长线、中线、短线，关键在于你自己的操作心态。

作为散户的话，短线需要超高的技术，不是一般人玩得了的。

虽然也会成功的时候，但一次失败则会将之前的成果吞噬掉，令人不得翻身。

选好股，放长线放能获大利，但这需要您高超的耐心和信心。

五、

六、已知每个月股价，求月方差和年方差

这样算是不对的，应该先算出年平均收益率，然后用年平均收益计算方差，你已经知道了每月收益，年平均收益很简单就求出来了啊

七、股票收益的期望和标准差计算。

听了我这段做股票的心得，你一定有很大的收获。

我觉得做股票吧，首先，心态要好，创造财富也得有好心情。

中国的股市，波段操作的赢利范围和可行性最大，另外，选取的个股，也必须跟随主力的动向，这样就不会让自己的资金冒险。

为了把握最理想的买卖点，必须有主力的带动和证券技术部门的老师指引去操作，这样才能达到在股市中长期的稳定赢利。

下面我给大家推荐一位在股市中比较资深的操盘老师，主要的实战操作，才能让我们信服，这位老师的操作平台资料就在我的空间里，相信自己的眼光，关注一段时间后，你会发现，做股票，这才叫实力！

参考文档

[下载：股票方差怎么做.pdf](#)

[《股票停牌复查要多久》](#)

[《核酸检测股票能涨多久》](#)

[《股票盘中临时停牌多久》](#)

[《公司上市多久后可以股票质押融资》](#)

[《高管离职多久可以转让股票》](#)

[下载：股票方差怎么做.doc](#)

[更多关于《股票方差怎么做》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/10609857.html>