

股票收益率怎么做回归-什么是回归理论？-股识吧

一、如何使用EXCEL计算股票的贝塔值

可以直接设计一个有截距值的线性回归来计算。

把股票收益率设为因变量，市场收益率设为自变量。

在Excel的“工具”中，选择“加载宏”，选中“分析数据库”，然后就可以在“工具”中找到“数据分析”，点击那个，选中“回归”，在弹出的界面中按要求选取自变量区域和因变量区域就可以了。

回归得出的斜率值就是贝塔系数了。

二、已知某股票近三年的收益率，市场组合收益率，市场组合标准差，无风险收益率，如何求股票的期望报酬率？？

甲股票的期望收益率为 $(10\%+6\%+8\%)/3=8\%$

乙股票的期望收益率为 $(7\%+13\%+10\%)/3=10\%$

三、价格的回归方法

基于向量自回归(VAR)方法的股票价格与经济增长关系的研究 目前，国内对经济发展和股票价格的关系的研究主要在定性和理论分析层面，运用计量经济建模方法进行实证研究并不多，且大多集中于研究货币政策与股票市场及收益的关系.基于已有的研究结果，本文拟采用VAR模型分析方法，研究我国经济发展与股票价格之间的关系，利用脉冲响应函数分析我国目前经济增长与股票价格的相互影响程度，冲击的持续性，通过Granger检验说明二者的因果关系，并据此提出对推进我国股票市场发展的相关建议.

四、如何获取金融数据 来做回归分析

可以去数据库里下载数据，如果数据库需要付费账号才能下载的话，可以推荐去上

海证券交易所和深圳证券交易所的官网上下载股票相关数据。

五、什么是回归理论？

回归理论 1简介 编辑 [英] The average value regression theory 股票收益率远非是不可预测的，从长期来看，它们应该呈负自相关，即股票价格应该呈回归均值的特征。均值回归理论在一定程度上或一定范围内对股票价格进行预测.对于长线投资者具有重要指导意义。

2特点 必然性 1. 均值回归从理论上讲应具有必然性。

因为有一点是肯定的，股票价格不能总是上涨或下跌，一种趋势不管其持续的时间多长都不能永远持续下去。

在一个趋势内，股票价格呈持续上升或下降，我们称之为均值回避(Mean Aversion)。

当出现相反趋势时就呈均值回归(Mean Reversion)。

到目前为止，均值回归理论仍不能解决的或者说不能预测的是回归的时间间隔，即回归的周期呈“随机漫步”。

不同的股票市场，回归的周期会不一样，就是对同一个股票市场来说，每次回归的周期也不一样。

如果能够发现均值回归的时间周期或者回归时间周期的分布范围，股票收益的可预测性就会很强。

否则，仅仅是证明某一股票市场是否存在均值回归仍然是没有意义的。

现在看来，均值回归理论的研究仅仅是刚刚起步，未来需要做的事情一定很多。

不对称性 2. 均值回归必然具有不对称性。

正的收益与负的收益回归的幅度与速度不可能一样。

因为它们之间并没有必然的联系，回归的幅度与速度也具有随机性。

对称的均值回归才是不正常的、偶然的，这一点也被实证检验所证实。

3与政府行为 均值回归理论与政府行为。

股票收益率均值回归证明市场不会偏离价值中枢时间太久，市场的内在力量会促使其向内在价值回归。

从这一点上讲，市场在没有政府利多或利空政策的作用下也会实现有效的目标，即股票价格会在市场机制的作用下自然的向均值回归。

但这并不否定政府行为对促进市场有效性的作用，因为市场偏离内在价值后并不等于立即就会向内在价值回归，很可能出现持续地均值回避。

政府行为会起到抑制市场无效和促进市场有效的作用。

在促进市场有效方面政府行为是必不可少的因素之一，市场失灵是政府参与调控的直接理由。

 ;

参考文档

[下载：股票收益率怎么做回归.pdf](#)

[《股票打新多久可以申购成功》](#)

[《股票锁仓后时间是多久》](#)

[《股票能提前多久下单》](#)

[《股票跌停板后多久可以买入》](#)

[《混合性股票提现要多久到账》](#)

[下载：股票收益率怎么做回归.doc](#)

[更多关于《股票收益率怎么做回归》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/64910767.html>