

股票研报怎么分析特征因子因子分析后，如何分析各因子对目标变量的贡献？-股识吧

一、因子分析后，如何分析各因子对目标变量的贡献？

不知道对于你的因子分析是分析什么东西的对于因子分析，如果不用逐步回归法的话，主成分回归法也可以，这样既可以确定了你的因子数目，还可以看出各个因子之间的重要性，如果权重大的话，则这个变量贡献就大.....对于自变量对于因变量的贡献大小可以采用F检验来进行.....对于第二个问题，这个也是化学计量学的一个瓶颈问题，采用数学方法多大程度上表现了我的这个体系的真实情景，研究到现在还没有完全解决。

其实你采用了各种因子分析法之后，还是可以在一定程度上代表了我的这个体系，究竟在多大程度上，就不好说了，需要实验来证明。

目前用的比较多的方法就是各种因子分析法，这些因子分析方法还是有一定置信水平的，所以可以采用.....论文中应该如何规避，呵呵，这个比较难以说清，应该根据你的实际情况来，还有就是看看你算出来的东西和你实验结果有多大的差距，如果差距很小，那说明你的这个体系比较好，可以采用，这个就是一般所说的残差，论文中需要提供这些数据来.....第三个问题我在上面其实已经回答了一部分了，数学体系还是完全代替不了真实体系，但是因子分析得到的结果可以代表你这个体系的主要部分，即主要的影响因素有哪些，对体系有主要贡献的变量有哪些，这些变量其实就是你的实验中的各个因素。

既然得到了具有主要影响的因素，那我们在实验过程中就可以根据这些因素来最优化我们的实验条件，从这个方面来讲，还是有很大的意义的..... 建议楼主看下因子分析这本书，讲得很详细.....特别是美国的化学计量学家B.R.Kowalski写的因子分析绝对经典，可以弄到的话建议认真看下。

以上是我的个人见解，如有不妥，敬请指正.....

二、如何分析股票？股票分析之公司分析

如何分析股票？个人投资者在决定购买某个公司的股票之前，有必要先对该公司的经营状况进行分析。

影响股价的最根本的因素是公司的经营情况、盈利能力、管理水平和发展前景等。

本期财库股票网（caikuu*）与股民分享股票的四大方法。

一：对公司财务报表的分析 上市公司按规定必须定期向社会公布经社会会计事务所审核的财务报表，通过对财务报表的分析能够简单的看出企业的经营成果、经营

效益、资金来源、资金外均和占有情况等。

一般情况下可分析其资产负债表、公司的自有资本、损益表等。

二：对公司盈利能力的判断 公司盈利能力的大小，直接影响到股东的收益。

不仅股利收入受其影响，资本利得也即买卖差价也与公司盈利呈正向关系，通常可用资产报酬率来分析公司的盈利能力。

资产报酬率，指一定时期内企业资产总额平均每天所创造的税后纯利润，它反映的是企业运用资金的效益。

三：对公司派息政策的分析 公司经营利润多，只表明股利有可能多，而事实上股利是否增加还要看公司的派息政策。

人们发明了衡量公司派息分红政策的指标，即股息支付率。

一般来说，股东倾向于多分红，公司倾向于多留利。

但留利过多，股利很少，必然挫伤股东积极性，进而影响公司声誉和投票价格；

留利过少，股利很多，又必然影响公司发展后劲，从而降低企业的竞争能力，长远看来，也不符合股东利益。

四、对公司在同行业中的地位的分析 每个公司的经营范围一般都是有限的，最起码要有主营方向，这就客观上把公司列入某个特定的产业、行业。

不同的产业在国民经济总体中都是有机的组成部分，因此，从根本上说，不存在什么优秀产业或落后产业之分，尽管在某个阶段上，某个产业可能更受到国民经济计划部门和政府的重视，享受到更多的优惠政策。

对公司的分析，重点放在对该公司在本行业中的地位和发展前景上。

公司的发展代表了股票的发展，公司好则股票发展好，在一定程度上来看分析股价涨跌就是分析公司发展。

更多股票投资资讯可访问财库股票网（caikuu*）获取最新资讯。

三、股票如何分析

关于技术分析，您首先听说的可能会是下面这句箴言："趋势是您的朋友"。

找到主导趋势将帮助您统观市场全局导向，并且能赋予您更加敏锐的洞察力 - - 特别是当更短期的市场波动搅乱市场全局时。

每周和每月的图表分析最适合用于识别较长期的趋势。

一旦发现整体趋势，您就能在希望交易的时间跨度中选择走势。

这样，您能够在涨势中买跌，并且在跌势中卖涨。

四、股票的基本面如何分析，研究

5. 财务状况。

在报纸的金融版或者财经网站可以找到有关的信息。

比较该公司和竞争对手的财务比率： \ast 资产的账面价值 \ast 市盈率 \ast 净资产收益率 \ast 销售增长率

五、股票分析应该从那方面分析呢~怎么分析？

一般情况是先看公司的基本面加上行情的技术面，还有大盘牛市，熊市你像现在就是熊市，不过熊市也有投资的机会，还可以抄底，哈哈

六、[研究报告]如何从微观角度用概率统计方法进行量化技术分析

琼斯工业平均指数诞生算起，技术分析到今天已经有100多年了。

这100多年里，科技取得了巨大的发展和进步。

比如，人类第一次登上了月球，破译了基因密码，个人计算机的出现等等，但遗憾的是，证券投资领域的理论发展水平明显滞后于科技的发展水平。

一方面，在微观世界我们已经可以对原子进行操作，另一方面，我们大部分投资者还是在用铅笔和直尺做工具，用波浪理论或江恩理论分析股票的走势。

时代在进步，科技在进步，但我们在投资领域却似乎没有什么大的进展。

波浪理论、江恩理论、K线理论目前还是很多投资者的主要工具，这明显滞后于目前的科技发展水平。

交易的核心问题可以说都要涉及到概率问题。

下面，笔者就如何从微观角度用概率统计的方法进行量化技术分析谈一下大概的思路。

在此之前，我们先向大家介绍一个新的交易方法——区间交易法。

所谓区间交易法，就是把价格空间用对积线分成很多相同百分比的区间，然后制定出一系列的交易规则，根据这些交易规则确定出各个对积线上的交易预案。

当价格到达哪一个价格节点就按照那一条对积线上的交易预案进行操作。

这样，所有的操作指令都进行了量化，各种可能情况都有交易预案，杜绝了操作的随意性，增加了盈利的稳定性。

理论上可以对区间进行无限的细分，实际交易时由于手续费的存在，设置区间大小时必须考虑到这一点。

传统的波浪理论、江恩理论、K线分析等等都只是在一个大尺度的范围对价格走势进行模糊、近似的观察，就好比用一把米尺测量一根头发的直径，得出的结果有太大的误差是难免的，无法克服的。

对积理论的思路是用微分的方法提炼出决定价格状态的三个因子：特征因子、能量因子、速率因子。

“特征因子”是成交量在一定集合范围内，按时间序列变化特征模板的重复次数。特征模板指对价格指数运动的最微小的变化进行离散采样总结的特征。

“能量因子”是一定时间范围内，成交量变化条件下，能量模板的重复次数。能量模板指对成交量的最微小变化进行离散采样总结的特征。

“速率因子”是描述一定时间内特征模重复的频次或一定成交量变化范围内能量模板重复的频次。

对积理论在进行技术分析时，抛开了传统技术分析用到的指标、均线、形态，取而代之的是“特征因子”、“能量因子”、“速率因子”三个因素。

我们经过长时间的研究发现，根据一个价格节点前一段时间内“特征因子”、“能量因子”、“速率因子”的统计数据，经过分析后可以确定下一个价格节点（价格节点就是价格和对积线的交点）的上涨概率和下跌概率，根据这个概率可以制定相应的资金分配方案和风险控制方案。

这样就可以通过分析行情数据为资金管理和风险控制提供可靠的依据。

由于这些依据是计算机根据一定的规则经过海量运算挖掘出数据背后肉眼不能分辨的规律，这样得出的结论更客观、更可靠，制定的交易计划更具操作性。

对积理论认为：投资者只有根据行情特征的客观情况进行交易才有可能实现长期的稳定盈利。

投资者要想做到这一点，只有在充分利用计算机的海量运算能力的前提下，努力成长为客观的系统交易者才能做到。

七、请问股票基本资料该如何分析？

每股收益分析 1、 每股收益=净利润/年末普通股股份总数每股收益是衡量上市公司盈利能力较重要的财务指标。

它反映普通股股东的获利水平。

在分析时可进行公司间的比较，了解公司相对获利能力，可以进行不同时期比较，了解该公司盈利能力的变化趋势。

2、 使用该指标注意的问题：(1)、每股收益不反映该股票所含的风险。

(行业不同)(2)、每股收益多，不一定意味着分红多。

也并不意味现金多。

扣折旧、坏帐等。

股净资产是指股东权益与股本总额的比率。

其计算公式为：每股净资产= 股东权益 ÷ 股本总额。

这一指标反映每股股票所拥有的资产现值。

每股净资产越高，股东拥有的资产现值越多；

每股净资产越少，股东拥有的资产现值越少。

通常每股净资产越高越好。

公司净资产代表公司本身拥有的财产，也是股东们在公司中的权益。

因此，又叫作股东权益。

在会计计算上，相当于资产负债表中的总资产减去全部债务后的余额。

公司净资产除以发行总股数，即得到每股净资产。

例如，上述公司净资产为15亿元，它的每股净资产值为1.5元（即15亿元/10亿股）

。

净资产收益率又称股东权益收益率，是净利润与平均股东权益的百分比。

该指标反映股东权益的收益水平，指标值越高，说明投资带来的收益越高。

八、在研报中往往会看到，B类关于沪深300指数的beta值，请问该数值什么用，如何测出来的~谢谢

Beta是衡量市场风险或者系统风险的，上市公司和市场回报率的协方差除以市场回报率的方差，即 $COV[R(a), R(\text{Market})]/VAR[R(\text{market})]$

它是用来分析股票回报率的，所以如果不是上市公司，就没有意义。

除了私募基金，其他的基金仓位都会自己公布出来。

参考文档

[下载：股票研报怎么分析特征因子.pdf](#)

[《社保基金打新股票多久上市》](#)

[《股票流通股多久可以卖》](#)

[下载：股票研报怎么分析特征因子.doc](#)

[更多关于《股票研报怎么分析特征因子》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/read/37782361.html>