

# 股票时间序列是白噪声怎么办！请问大家，在时间序列模型中，模型的高斯白噪声的方差怎么确定？-股识吧

## 一、股票指数与资金是怎么换算的？

您收盘后看到上证指数为2999.48点，旁边显示一个向下绿色的箭头是显示（比昨天收盘时）下跌33.79点，再旁边显示1555.3亿是今天的成交金额。

指数是表示交易所全部股票的涨跌情况，成交金额是表示今天买卖了多少钱的股票，它们之间没有换算关系。

## 二、以下哪个时间序列模型不属于平稳时间序列模型

楼主提取趋势的原因是想让趋势序列平稳化吧？你说要提取时间序列的周期，那就说明去趋势序列还含有周期变动，这样的话它肯定就不是白噪声序列了。

如果这样，则首先要对提取趋势后的序列做单位根检验，检验提取趋势后的序列是否平稳。

单位根检验的步骤为（eviews）：打开序列，点击view，unit root test，使用默认选项即可，看输出的p-

value，h0为：序列有单位根（不平稳），h1为：没有单位根（平稳）。

根据p值做出判断。

若去趋势序列平稳了，那就可以对平稳序列建模了，例如arma模型，存在周期的话也可以用周期函数拟合，或者使用季节差分的arma模型。

当这些都完成后，再应该对残差序列做白噪声检验，通过白噪声检验就说明建模完成。

白噪声检验的步骤为：打开resid序列，view，correlogram，差分阶数选择level，确定，看q统计量的伴随p值是不是很大就行了。

## 三、图中的序列是白噪声吗？白噪声序列怎么检验，检验原理是什么？

acf和pacf的值都不够明显抄，一阶滞后值衰比较小，可以认定为白噪声2113.每隔一段

滞后,acf出现5261一个波峰,我怀疑这4102个序列存1653在自回归形式为 $e(t)=a_1*e(t-4)+a_2*e(t-5)+a_3*e(t-6)+a_4*e(t-7)$

## 四、时间序列建模前是不是都要去除通货膨胀因素

- 1、在不存在通货膨胀的情况下，利率的组成因素包括（abcd）。  
A、纯利率B、违约风险报酬率C、流动性风险报酬率D、期限风险报酬率2、递延年金的特点是(acd)。  
A、第一期没有支付额B、计算现值的方法与普通年金相同C、计算终值的方法与普通年金相同D、终值大小与递延期长短有关3、若甲的期望值高于乙的期望值，且甲的标准离差小于乙的标准离差，3、下列表述不正确的是（d）。  
A、甲的风险小B、乙的风险小C、甲的风险与乙的风险相同来衡量风险D、难以确定，因期望值不同，需进一步计算标准离差率来衡量风险4、下列各项中，属于“吸收直接投资”与“发行普通股”筹资方式所共有缺点的有(cd)。  
A、限制条件多B、财务风险大C、控制权分散D、资金成本高5、下列指标中，考虑到资金时间价值的是(abc)。  
A、净现值B、现值系数C、内部报酬率D、投资回收期6、下列表述正确的是（acd）。  
A、复利终值系数和复利现值系数互为倒数B、普通年金终值系数和普通年金现值系数互为倒数C、普通年金终值系数和偿债基金系数互为倒数D、普通年金现值系数和资本回收系数互为倒数7、原始总投资是指（abd）。  
A、反映项目所需现实资金的价值指标B、它等于项目总投资扣除资本化利息C、它包括固定资产投资、无形资产投资、其他资产投资和流动资产投资D、它等于企业为使项目完全达到设计生产能力、开展正常生产经营而投入的全部现实资金8、在计算个别资金成本时，不需考虑所得税影响的是(c)。  
A、债券成本B、银行成本C、普通股成本D、吸收直接投资9、当一年内复利m次时，其名义利率r与实际利率i之间的关系下列表述不正确的是(abcd)A、 $-1$ B、 $i=(1+r/m)^m-1$ C、 $i=(1+r/m)-m-1$ D、 $i=(1+r/m)-m$ 10、下列各项中，影响财务杠杆系数的因素有(abc)。  
A、产品边际贡献总额B、固定成本C、所得税率D、财务费用、判断题（24分）1、从财务管理的角度看，企业价值所体现的资产的价值既不是其成本价值，也不是其现实的会计收益。  
（错）2、根据财务管理的理论，必要投资收益等于期望投资收益、无风险收益和风险收益之和。  
（）3、在没有通货膨胀时，无风险收益率等于资金时间价值；  
在存在通货膨胀时，无风险收益率小于资金时间价值。  
（错）4、如果企业的资金来源全部为自有资金，且没有优先股存在，则企业财务

杠杆系数等于1。

(对)5、在项目投资决策中，净现金流量是指经营期内每年现金流入量与同年现金流出量之间的差额所形成的序列指标。

6、信贷额度是银行从法律上承诺向企业提供不超过某一最高限额的贷款。

7、资金成本即用资费用，是指企业为筹集和使用资金而付出的代价。

(错)8、在各种资金来源中，普通股筹资的成本最高。

(错)9、已知甲方案投资收益率的期望值为15%，乙方案投资收益率的期望值为12%，两个方案都存在投资风险，比较甲、乙方案风险大小应采用的指标是标准差。

(错)10、两种正相关的股票组成的证券组合，不能抵销任何风险。

(对)11、风险与收益是对等的，风险越大，投资人要求的投资收益率就越高。

(对)12、两种正相关的股票组成的证券组合，不能抵销任何风险。

(对)

## 五、什么是鞅？什么是白噪音？他们有什么用途？

鞅是指去了毛的兽皮，就是指套在马颈或马腹上的皮带。

泛指牲口拉车时的器具。

白噪音是一种功率频谱密度为常数的随机信号或随机过程。

在一段声音中的频率分量的功率在整个可听范围（0~20KHZ）内都是均匀的。

由于人耳对高频敏感，这种声音听上去是很吵耳的沙沙声。

鞅的用途是通过套在马颈或马腹上，固定拉车的马匹。

白噪音的用途利用白噪音来停止婴儿的哭泣；

帮助些经常受到环境噪音污染的人群恢复工作效率。

扩展资料：白噪声信号在各个频段上的功率是一样的，由于白光是由各种频率（颜色）的单色光混合而成，因而此信号的这种具有平坦功率谱的性质被称作是“白色的”。

理想的白噪声具有无限带宽，因而其能量是无限大，这在现实世界是不可能存在的。

实际上，人们常常将有限带宽的平整讯号视为白噪音，因为这让人们在认知分析上更加方便。

参考资料来源：股票百科——鞅股票百科——白噪音

## 六、时间序列经一阶季节差分处理后仍有季节性怎么办

ARIMA模型，可以再差分降阶

## 七、请问股票交易中的限价是指什么

限价就是限制买入和卖出的最低价，就是你买卖股票时，必需给出一个委托价格，而且价格在限价范围内。

1、只有证券交易商才被允许以其规定的最高价格或者低于最高价格进行交易。当出售股票时，他限制最低价格。

只有证券交易商才被允许以其规定的最低价格或者高于最低价格进行交易。

2、限价交易最大的特点是股票可以按照投资者希望的价格或者更好的价格进行交易，这有利于实现预期的投资计划。

当你了解了委托交易中的限价的规则和意义后，下次在股票交易的时候就不会纳闷自己提交的单子为什么有限价的现象了，实际上为了保障投资者权益，股市里也会有涨跌幅限制，这样对新股民来说也是一种好的方法。

拓展资料：限定的价格交易的好处如下：[1] 不要总是盯盘 第一次交易原则就迫使投资者提前持有订单，因为“时间优先”和“T+1”的交易规则规定了谁先以同样的价格委托；

反正都是在等。

还规定交易日只能有一次卖出或买入的机会，与其在交易日等待，不如在交易日之前做好计划。

交易日前少委托不会浪费时间，所以这对没有时间的股民比较友好。

[2] 减少主观判断

虽然不一定是最高价或最低价，也减少了主观判断，但至少是计算准确的价格。

要知道最高价或最低价这两个价格，两个极端价格把握的可能性几乎为零。

相反，即使达到最高价或最低价，由于不需要执行交易指令，只有放弃最高价和最低价，才有可能尽可能接近最高价和最低价。

与极端情况相比，相对面积要容易得多。

即使放弃小市场，但是更容易把握大市场，这样就不会有其他极端的股票出现。

[3] 避免日内交易 委托挂单最大的好处是不受价格影响，可以减少交易次数。

一旦确定了目标价格，唯一需要做的就是耐心等待，有可能到了附近记得去看看，或者下单，可以在余时间跟踪基本面。

在毕竟的A股交易系统下，价格不可能一步到位，通过限价就是一个不错的选择。

## 八、请问大家，在时间序列模型中，模型的高斯白噪声的方差

## 怎么确定？

进行参数估计，用矩估计或区间估计。

## 九、在时间序列的处理中什么叫截尾和拖尾

在sas软件中，我们可以通过得到的自相关函数图和偏相关函数图来判断设显著水平取 $\alpha=5\%$ 。

如果样本自相关系数和样本偏自相关系数在最初的阶明显大于2倍标准差，而后几乎95%的系数都落在2倍标准差的范围内，且非零系数衰减为小值波动的过程非常突然，通常视为k阶截尾；

如果有超过5%的样本相关系数大于2倍标准差，或者非零系数衰减为小值波动的过程比较缓慢或连续，通常视为拖尾。

## 参考文档

[下载：股票时间序列是白噪声怎么办.pdf](#)

[《股票重组多久会停牌》](#)

[《买股票买多久盈利大》](#)

[《一般股票买进委托需要多久》](#)

[下载：股票时间序列是白噪声怎么办.doc](#)

[更多关于《股票时间序列是白噪声怎么办》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/28899076.html>