

怎么构建一支股票的ARMA模型~怎么做股票模型？-股识吧

一、简述如何选择合适的arma模型来拟合一个观测到的平稳时间序列

这个是不可以的。

因为ARMA建模的前提是要求数据平稳，如果是非平稳的就会造成预测不准或者得到错误的结果。

可以对数据进行差分处理后再用ARMA模型建模

二、arma模型 SPSS做

写了这么多，50分给我吧，2nd表示对二阶差分作图，lags表示最大滞后阶数。

如果p和q的取值不明确，可以多尝试几个p和q的可能组合，看看相关检验的显著性。

这里有几个参数：level=0，表示对原序列作图，就要动用sarima模型了。

麻烦的地方是，partial correlation偏自相关图，所以只能尽量详细了，1st difference=1表示对一阶差分作图，图上有显著性检验的临界值界线。

怎么用自相关图和偏自相关图分别判断ma和ar的滞后阶数，相信你是知道的吧，关键比较结果中的AIC和sc，越小越好，OK就可以看到基本的模型了。

有时候可能会出现near singular matrix的错误。

搞定，你可以随意调整lags的取值，直到OK就行，假设你根据这两个图判断出的ma，autocorrelation自相关图。

使用默认参数就可以，在里面输入x ar(1) ar(2) ma(1) ma(2)

ma(3)，其他参数默认，可不容易讲清楚啦。

你只要求arma模型，估计是不需要用arima和sarima模型的吧。

不知道你对eviews会到什么程度：

要是你的序列不平稳，需要建立arima模型，这时就要看1st difference甚至2nd difference的图形。

要是涉及12阶滞后自相关或偏自相关显著、ar滞后阶数分别是q=2,p=3

所以要建立的模型是ar(2)ma(3) 主窗口的工具栏里，注意是主窗口哦，做起来容易，看到两个图，注意上面输入的变量之间是空格，没有分隔符号，还有疑问么。

好了，假设是x，点这个变量窗口工具栏里的view-

correlogram50分的问题.....果然好麻烦的说，因为涉及很多检验

没用SPSS做过时序，说Eviews吧 打开你要建模的序列，点击quick-estimate equation

三、eviews怎么建立arma模型

把ar1, 2, 3。

和ma1, 2, 3。

放进去试 然后看aic的值 选最小的就是你要的model

四、如何设计股票模型？

股票模型 百科名片 股票模型就是对于现实中的个股，为了达到盈利目的，作出一些必要的简化和假设，运用适当的数学分析，得到一个数学结构。

目录概念 股票建模 建模过程 股票模型的作用编辑本段概念 在这里引用数学模型的定义，也可以说，股票建模是利用数学语言（符号、式子与图象）模拟现实的模型。

把现实模型抽象、简化为某种数学结构是数学模型的基本特征。

它或者能解释特定现象的现实状态，或者能预测到对象的未来状况，或者能提供处理对象的最优决策或控制。

编辑本段股票建模 把个股的实际问题加以提炼，抽象为数学模型，求出模型的解，验证模型的合理性，并用该数学模型所提供的解答来解释现实问题，我们把这一应用过程称为股票建模。

编辑本段建模过程 模型准备

：了解个股的实际背景，明确其实际意义，掌握对象的各种信息。

用数学语言来描述问题。

模型假设：根据实际对象的特征和建模的目的，对问题进行必要的简化，并用精确的语言提出一些恰当的假设。

模型建立：在假设的基础上，利用适当的数学工具来刻画各变量之间的数学关系，建立相应的数学结构。

（尽量用简单的数学工具）模型求解

：利用获取的数据资料，对模型的所有参数做出计算（估计）。

模型分析：对所得的结果进行数学上的分析。

模型检验：将模型分析结果与实际情形进行比较，以此来验证模型的准确性、合理性和适用性。

如果模型与实际较吻合，则要对计算结果给出其实际含义，并进行解释。

如果模型与实际吻合较差，则应该修改假设，在次重复建模过程。

模型应用：应用方式因问题的性质和建模的目的而异。

编辑本段股票模型的作用

第一，能让分析过程简化，并让复杂的分析过程通过数据表达出来。

第二，通过对模型的反复修正，能起到对个股的未来走势起到预测效果。

第三，便于掌握股市行情。

五、如何利用eviews做arma

很简单的，先做单位根，作图，然后建立模型

六、怎么做股票模型？

我也曾今也想到过这个问题。

但是，告诉你一个不幸的消息，股票不可以用模型制作，我以前试过用指数模型和高斯分布做过，但后来去给一个博士谈到这个问题的时候。

最终达成一致共识，股票不能建立模型。

只能在股票和其他衍生工具之间建立交易模型，例如capm，b-s模型。

如果是老师布置的作业，你就给她说不，不能建立模型。

七、如何用eviews建立ar模型和arma模型

分别加入ar项和ma项即可

参考文档

[下载：怎么构建一支股票的ARMA模型.pdf](#)

[《一只刚买的股票多久能卖》](#)

[《股票卖的钱多久到》](#)

[《股票违规停牌一般多久》](#)

[《法院裁定合并重组后股票多久停牌》](#)

[下载：怎么构建一支股票的ARMA模型.doc](#)

[更多关于《怎么构建一支股票的ARMA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/article/12477425.html>