

股票时间序列选什么—股票池设置中的时间序列参数是什么意思-股识吧

一、如何确定股指期货时间序列对股票指数时间序列影响的滞后性

一般把非平稳时间序列转化为平稳时间序列的方法是取n阶差分法。

比如举个例子，假设 x_t 本身是不平稳的时间序列，如果 $x_t \sim I(1)$

,也就是说 x 的1阶差分是平稳序列。

那么 x_t 的1阶差分 $dx_t = x(t) - x(t-1)$ 就是平稳的序列 这时 $dt = x(t-1)$ 如果 $x_t \sim I(2)$ ，就是说 x_t 的2阶差分是平稳序列的话 x_t 的1n阶差分 $dx_t = x(t) - x(t-1)$

这时 x_t 的1阶差分依然不平稳，那么

对 x_t 的1阶差分再次差分后， x_t 的2阶差分 $ddx_t = dx_t - dx_t(t-1)$ 便是平稳序列

这时 $dt = -x(t-1) - dx_t(t-1)$ n阶的话可以依次类推一下。

二、股票池设置中的时间序列参数是什么意思

不明白啊 == !

三、时间序列在股市行情预测中的应用论文怎么写？

作用没有想象中的大，你可以用股票的滞后变量来进行回归分析，滞后2~3期就够了，不过数据必须具体点，最好细分到每季度、每月的上证指数，还有时间上怎么也要十年左右吧！我以前在论文附录中做过分析，数据都是自己按季度整理的，挺麻烦的呢，如果需要的话就发给你~ 还有就是，我觉得写关于股票的预测方面的实际用处并不是很大，毕竟股票的影响因素太多，单单的凭借以前的走势而预期太不好了。

。

我自己也炒股票，就像那些macd、kdj之类的指标根本就起不到太大的作用，如果那个能预期的话，股市岂不就成了提款机了？现在你做的这个就像是那些指标一样，要知道，股市是活的，人是活的，而指标确实死的！说这么多的意思就是股市不是能简单预测的，你做的那个用处不大。

。如果你想做的话，建议换个题目，我当时的写的是对弗里德曼的货币需求理论在中国市场的分析。

你可以写写货币供应量对通货膨胀的时滞性，分析下在我国市场的滞后期大概是多少~数据在国家统计局和中国人民银行都可以找到的，样本空间一定要足够大，在对滞后变量分析时候主要考虑各自的T检验是否通过，一般从通过之后大概就是那个的滞后期！这个比较直接反而有些许用处~

要是能分析出国家的一般性政策对实体市场的影响就更好了，更有用了~
呵呵，以上只是自己的建议~有什么其他的问题就给我留言吧~

四、股票分析选用ar模型好还是ma模型好

直观判断：依据自相关图与偏自相关图，例如自相关图是递减（或震荡递减）而偏自相关是某阶后突变为零的，大体上就是AR 再者就是AIC准则咯，越小越好
沃尔特 恩德斯（Walter Enders）应用计量经济学——时间序列分析

五、时间序列分析capm需要哪些数据

做CAPM分析需要一个market

portfolio，过去人们总是选择纽约股票市场模拟这么一个market portfolio。

后来Roll1976年写了一篇文章，说这种方法未必正确，因为这样得出来的数据确实在mean-variance efficient frontier 上，但是不一定就是market portfolio。

后来人们提出了一种方法，用managed

portfolio，把时间序列中条件期望变成无条件期望，常常关注的变量就是 the market return，the D/P ratio，the term premium，market return 乘以 the D/P ratio，market return 乘以 the term premium。

这被称为五要素模型（five-factor model）。

六、非平稳时间序列可以预测股票走势吗

一般把非平稳时间序列转化为平稳时间序列的方法是取n阶差分法。

比如举个例子，假设 x_t 本身是不平稳的时间序列，如果 $x_t \sim I(1)$

,也就是说 x 的1阶差分是平稳序列。

那么 x_t 的1阶差分 $dxt=x(t)-x(t-1)$ 就是平稳的序列 这时 $dt=x(t-1)$ 如果 $x_t \sim I(2)$, 就是说 x_t 的2阶差分是平稳序列的话 x_t 的1n阶差分 $dxt=x(t)-x(t-1)$

这时 x_t 的1阶差分依然不平稳, 那么

对 x_t 的1阶差分再次差分后, x_t 的2阶差分 $ddxt=dxt-dxt(t-1)$ 便是平稳序列

这时 $dt=-x(t-1)-dxt(t-1)$ n阶的话可以依次类推一下。

七、请教, stata 如何定义时间序列 股票交

`reg y x1 x2 x3 predict e,r`就可以生成变量命为 e 的残差

八、经济时间序列是什么

事物的发展变化趋势会延续到未来, 反映在随机过程理论中就是时间序列的平稳性或准平稳性。

投入产出法, 作为一种科学的方法来说, 是研究经济体系(国民经济、

九、In practice,we take log first difference of timeseries of the stock index.

实际上, 我们对股票指数的时间序列的一阶差分取对数。

参考文档

[下载：股票时间序列选什么.pdf](#)
[《股票涨幅过大停牌核查一般要多久》](#)
[《混合性股票提现要多久到账》](#)
[《买股票从一万到一百万需要多久》](#)
[下载：股票时间序列选什么.doc](#)

[更多关于《股票时间序列选什么》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/chapter/12927247.html>