如何用r语言分析股票数据分析—如何用R软件处理高频数 据,建立已实现波动率模型-股识吧

一、如何用R软件处理高频数据,建立已实现波动率模型

1、打开一个空白Excel工作表,打开VBA编辑器(点击菜单:工具->宏-> Visual Basic编辑器):2、插入模块(点击VBA编辑器菜单:插入-> 模块): 3、将以下代码复制/粘贴到代码窗口中: Function CallOpt(stock, exercise, maturity, rate, volatility) As Double D1 = (Log(stock / exercise) + (rate + (volatility ^ 2) / 2) * maturity) / (volatility * Sqr(maturity)) D2 = D1 - volatility * Sqr(maturity) CallOpt = stock * Application.NormSDist(D1) - exercise * Exp(-rate * maturity) * Application. NormSDist(D2) End FunctionFunction PutOpt(stock, exercise, maturity, rate, volatility) As Double D1 = (Log(stock / exercise) + (rate + (volatility ^ 2) / 2) * maturity) / (volatility * Sqr(maturity)) D2 = D1 - volatility * Sqr(maturity) PutOpt = exercise * Exp(-rate * maturity) * Application.NormSDist(-D2) - stock * Application.NormSDist(-D1)End Function粘贴完成后如下图: 3、关闭"Visual Basic 编辑器"窗口,回到工作表。 此时若查看函数列表,可看到在"用户定义"类别中增加了两个函数,CallOpt和P utOpt : = CallOpt(stock,exercise,maturity,rate,volatility) 用于计算认购权证的理论价格; =PutOpt(stock,exercise,maturity,rate,volatility) 用于计算认沽权证的理论价格。 两个函数都是需要5个变量,依次为:stock-正股现价; exercise - 权证行权价; maturity - 权证剩余期限(折算成年,在Excel中=(到期日-当前日)/365); rate - 无风险利率(一般取国债的年收益率); volatility - 波动率(一般取正股最近3个月的历史波动率); 现在只需要在单元格中输入函数名并依顺序输入各变量,就可轻而易举的算出权证 理论价格了。

若还有不明白的,请将下表复制/粘贴到工作表 " A1 " 单元格中试试看。

最后将该Excel文件保存起来。

记住,以后每次打开该文件,都会出现以下的安全警告,记得一定要点选"启用宏 ",否则自定义函数将不能使用。

二、如何用rsl指示选股票

rsi指标指标的快线运行在20之下的时间就代表炒卖 , 从统计而言

,这个时间抄底进场的准确率是百分之78 ,而rsi指标的快线运行到80以上的时间,代表超买,有调整的要求,一旦指标从80上方跌回到80之内,一般就代表调整展开了rsi的指标准确率看似较高,但是只能作为辅助指标来使用,弱势股持续运行在20之下也是正常的,而强势股可能持续运行在80以上

, 超卖有些时间也代表强势希望我的回答能够帮助到您

三、R语言怎么做Meta分析

R中rmeta程序包是R语言专门进行meta分析的一个程序包,当然类似的meta分析程序包在R语言中非常多,比如 meta, metafor等网页链接。

cochrane是rmeta程序包里面自带的一个用于meta分析的演示数据库。

该数 据库是7个随机对照实验的数据,该数据库拥有5个变量(name,ev.trt,n.trt,ev.ctrl,n.ctrl),7个观察值(对应7个随机 对照实验)网页链接

四、怎么分析股票数据

所需步骤:1.了解该公司。

多花时间,弄清楚这间公司的经营状况。

以下是一些获得资料的途径: *公司网站*

财经网站和股票经纪提供的公司年度报告*图书馆*

新闻报道——有关技术革新和其它方面的发展情况 2. 美好的前景。

你是否认同这家公司日后会有上佳的表现?3.

发展潜力、无形资产、实物资产和生产能力。

这时,你必须象一个老板一样看待这些问题。

该公司在这些方面表现如何?*发展潜力——新的产品、拓展计划、利润增长点?*无形资产——知识版权、专利、知名品牌?*

实物资产——有价值的房地产、存货和设备?*

生产能力——能否应用先进技术提高生产效率?4.比较。

与竞争对手相比,该公司的经营策略、市场份额如何?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:*资产的账面价值*市盈率*净资产收益率*销售增长率6.观察股价走势图。

公司的股价起伏不定还是稳步上扬?这是判断短线风险的工具。

7. 专业的分析。

F10为个股资料,里面的业内点评清楚地评价了公司的行业地位及发展前景,可以作为参考,还有淘股吧论坛,里面不乏有高人分析个股的技术面与题材面。

技巧提示: 1、潜在的行业龙头,要重点关注。

比如中国南车,刚上市就跌到了3元,作为动车组的龙头股,肯定是低估了,中线持有必赚;

2、低价是永恒的题材。

这里所说的低价,是绝对低价,历史上从来没有大幅炒作过的品种,一旦有热门的 题材引发主升,往往成为黑马。

注意事项: 每个投资者都经历过股票套牢的滋味。

这时应该保持冷静,分析公司的基本面,确定该股票是否还值得长期持有。

五、如何利用r语言代码进行主成分分析

princomp(x, cor = FALSE, scores = TRUE, covmat = NULL, subset = rep_len(TRUE, nrow(as.matrix(x))),)当cor = TRUE是使用相关系数矩阵计算 当cor = FALSE是使用协方差矩阵计算

用相关系数矩阵计算就相当于先标准化,在进行主成分分析用。

六、R语言怎么做Meta分析

R中rmeta程序包是R语言专门进行meta分析的一个程序包,当然类似的meta分析程序包在R语言中非常多,比如 meta, metafor等网页链接。

cochrane是rmeta程序包里面自带的一个用于meta分析的演示数据库。

该数 据库是7个随机对照实验的数据,该数据库拥有5个变量(name,ev.trt,n.trt,ev.ctrl,n.ctrl),7个观察值(对应7个随机 对照实验)网页链接

七、求问R 语言数据处理的操作

使用R语言的时候,如果是少量数据,不妨使用c()或其他函数进行创建; 但是对于大量数据,最好还是先通过其他更方便的软件创建数据文件,然后使用R 读入这个文件。 .csv是非常好的数据文件格式,跨平台支持非常好。

我在Excel或者SPSS中创建的数据,只要存为csv格式,就可以使用几乎任何数据处理软件对这些数据进行处理了。

使用通用格式在多人合作、不同版本兼容等常见行为中, 优势十分明显。

另外,之所以使用不同的数据处理软件,第一,可以取长补短。

比如有些工作SPSS很复杂的,可以用R语言几行命令搞定。

第二,可以进行软件间处理结果对照,发现问题。

R语言中读取外部文件的最基本函数是read.table(),还有用来读csv的read.csv(),

.csv是非常好的数据文件格式,跨平台支持非常好。

输入help(read.table)命令,就看到了关于数据输入函数的说明。

八、求问R 语言数据处理的操作

使用R语言的时候,如果是少量数据,不妨使用c()或其他函数进行创建; 但是对于大量数据,最好还是先通过其他更方便的软件创建数据文件,然后使用R 读入这个文件。

.csv是非常好的数据文件格式,跨平台支持非常好。

我在Excel或者SPSS中创建的数据,只要存为csv格式,就可以使用几乎任何数据处理软件对这些数据进行处理了。

使用通用格式在多人合作、不同版本兼容等常见行为中, 优势十分明显。

另外,之所以使用不同的数据处理软件,第一,可以取长补短。

比如有些工作SPSS很复杂的,可以用R语言几行命令搞定。

第二,可以进行软件间处理结果对照,发现问题。

R语言中读取外部文件的最基本函数是read.table(),还有用来读csv的read.csv(),

.csv是非常好的数据文件格式,跨平台支持非常好。

输入help(read.table)命令,就看到了关于数据输入函数的说明。

九、如何用rsl指示选股票

rsi指标指标的快线运行在20之下的时间就代表炒卖 , 从统计而言 , 这个时间抄底进场的准确率是百分之78 , 而rsi指标的快线运行到80以上的时间 , 代表超买,有调整的要求,一旦指标从80上方跌回到80之内,一般就代表调整展开了rsi的指标准确率看似较高,但是只能作为辅助指标来使用,弱势股持续运行在20之下也是正常的,而强势股可能持续运行在80以上

, 超卖有些时间也代表强势希望我的回答能够帮助到您

参考文档

下载:如何用r语言分析股票数据分析.pdf

《转账到股票信用账户上要多久》

《股票开户最快多久能到账》

下载:如何用r语言分析股票数据分析.doc

更多关于《如何用r语言分析股票数据分析》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/4861439.html