

# 如何用eviews计算股票波动率、如何计算股票年收益波动率-股识吧

## 一、如何在eviews中用garch计算股票波动率

我教你怎么看。

最上面的公式看见了吗？ $GARCH=C(1)+C(2)*RESID(-1)^2+C(3)*GARCH(-1)$ 这个就是波动率方程。

下面的输出结果中写出了C(1)、C(2)、C(3)的估计值。

## 二、如何计算股票年收益波动率

建议你用股票年收益波动率，具体计算步骤是：1.从finance.yahoo\*上面找到你要的公司的股票资料，将其每天的历史价格下载下来，然后选用Adjusted Close Price；2.把它们复制到Excel Spreadsheet里，然后用STDEV计算标准差，就OK了。这是你要的答案么？

## 三、股票日波动率的标准差怎么算？急！急！急！！！！

具体看你用什么方式来算，我接触到用garch的多.此外，那个不是乘以根号52，是乘以根号一年的交易日数.

## 四、如何在eviews中用garch计算股票波动率

view里面找到garch模型

## 五、用GARCH(1, 1)模型对股票收盘价收益率序列建模，如何在eviews软件中得出收益率序列的波动性方差？

接分啦。

。  
。

找到一篇不错的文章楼主看下，参考资料：2.关联规则挖掘过程、分类及其相关算法  
2.1关联规则挖掘的过程关联规则挖掘过程主要包含两个阶段：第一阶段必须先从资料集合中找出所有的高频项目组(Frequent Itemsets)，第二阶段再由这些高频项目组中产生关联规则(Association Rules)。关联规则挖掘的第一阶段必须从原始资料集合中，找出所有高频项目组(Large Itemsets)。

高频的意思是指某一项目组出现的频率相对于所有记录而言，必须达到某一水平。一项目组出现的频率称为支持度(Support)，以一个包含A与B两个项目的2-itemset为例，我们可以经由公式(1)求得包含项目组的支持度，若支持度大于等于所设定的最小支持度(Minimum Support)门槛值时，则称为高频项目组。

一个满足最小支持度的k-itemset，则称为高频k-项目组(Frequent k-itemset)，一般表示为Large k或Frequent k。

算法并从Large k的项目组中再产生Large k+1，直到无法再找到更长的高频项目组为止。

关联规则挖掘的第二阶段是要产生关联规则(Association Rules)。

从高频项目组产生关联规则，是利用前一步骤的高频k-项目组来产生规则，在最小信赖度(Minimum Confidence)的条件门槛下，若一规则所求得的信赖度满足最小信赖度，称此规则为关联规则。

例如：经由高频k-项目组所产生的规则AB，其信赖度可经由公式(2)求得，若信赖度大于等于最小信赖度，则称AB为关联规则。

就沃尔玛案例而言，使用关联规则挖掘技术，对交易资料库中的纪录进行资料挖掘，首先必须要设定最小支持度与最小信赖度两个门槛值，在此假设最小支持度min\_support=5%且最小信赖度min\_confidence=70%。

因此符合此该超市需求的关联规则将必须同时满足以上两个条件。

若经过挖掘过程所找到的关联规则「尿布，啤酒」，满足下列条件，将可接受「尿布，啤酒」的关联规则。

用公式可以描述Support(尿布，啤酒) $\geq$  5%且Confidence(尿布，啤酒) $\geq$  70%。

其中，Support(尿布，啤酒) $\geq$  5%

于此应用范例中的意义为：在所有的交易纪录资料中，至少有5%的交易呈现尿布与啤酒这两项商品被同时购买的交易行为。

Confidence(尿布，啤酒) $\geq$  70%

于此应用范例中的意义为：在所有包含尿布的交易所记录资料中，至少有70%的交易会同时购买啤酒。

因此，今后若有某消费者出现购买尿布的行为，超市将可推荐该消费者同时购买啤

酒。

这个商品推荐的行为则是根据「尿布，啤酒」关联规则，因为就该超市过去的交易纪录而言，支持了“大部份购买尿布的交易，会同时购买啤酒”的消费行为。

从上面的介绍还可以看出，关联规则挖掘通常比较适用与记录中的指标取离散值的情况。

如果原始数据库中的指标值是取连续的数据，则在关联规则挖掘之前应该进行适当的数据离散化（实际上就是将某个区间的值对应于某个值），数据的离散化是数据挖掘前的重要环节，离散化的过程是否合理将直接影响关联规则的挖掘结果。

2.2关联规则的分类按照不同情况，关联规则可以进行分类如下：1.基于规则中处理的变量的类别，关联规则可以分为布尔型和数值型。

布尔型关联规则处理的值都是离散的、种类化的，它显示了这些变量之间的关系；而数值型关联规则可以和多维关联或多层关联规则结合起来，对数值型字段进行处理，将其进行动态的分割，或者直接对原始的数据进行处理，当然

## 六、利用eviews软件中的garch（1.1）模型来计算汇率的波动率，用方差替代，请问下在eviews里能直接提取方差吗

展开全部里面有软件包，直接在估计方法上面，estimates里面选择arch估计，在option里面就可以设置了

## 七、eviews中如何用garch（1，1）计算股票波动率

打开Eviews然后点击Quick然后点击Equation Estimation，然后选择ARCH方法，然后估计就行了

## 八、如何计算股票历史波动率 详细 0 3

财富创业板技巧：下面以计算股票的历史波动率为例加以说明。

- 1、从市场上获得标的股票在固定时间间隔(如每天、每周或每月等)上的价格。
- 2、对于每个时间段，求出该时间段末的股价不该时段初的股价之比的自然对数。
- 3、求出这些对数值的标准差，再乘以一年中包含的时段数量的平方根(如，选取时间间隔为每天，则若扣除闭市，每年中有 250 个交易日，应乘以根号250)，得到的即为历史波动率。

历史波动率是基于过去的统计分析得出的，假定未来是过去的延伸，利用历史方法估计波动率类似于估计标的资产收益系列的标准差。

在股票市场中，历史波动率反映标的股价过去的波动。

然而，由于股价波动难以预测，利用历史波动率对权证价格进行预测一般都不能保证准确，但是由于目前我国内地没有权证市场，因而无法获得权证价格，也就无法计算隐含波动率。

因此权证发行商不投资者在权证发行初期只能利用历史波动率作参考。

## 参考文档

[下载：如何用eviews计算股票波动率.pdf](#)

[《股票开户最快多久能到账》](#)

[《中泰齐富股票卖了多久可以提现》](#)

[《股票上升趋势多久比较稳固》](#)

[《场内股票赎回需要多久》](#)

[下载：如何用eviews计算股票波动率.doc](#)

[更多关于《如何用eviews计算股票波动率》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/44732244.html>