# 变量定义

**X：**

1. **Vp** 当前交易日的波动率V\_past：
2. **dVp** 当前交易日的波动率相比于第t-n个交易日的涨跌额dV\_past：
3. **rVp** 当前交易日的波动率相比于第t-n个交易日的涨跌幅（%）rV\_past：
4. **dVpm** 当前交易日的波动率相比于过去n个交易日移动均值的差值dV\_past\_mean：
5. **rVpm** 当前交易日的波动率相比于过去n个交易日移动均值的差值百分比（%）rV\_past\_mean：
6. **dVps** 当前交易日的波动率相比于过去n个交易日移动均值的差值（移动标准差个数）dV\_past\_std：
7. **dVpmin、dVpmax** 当前交易日的波动率相比于过去n个交易日移动最值的差值dV\_past\_min、dV\_past\_max：、
8. **rVpmin、rVpmax** 当前交易日的波动率相比于过去n个交易日移动最值的差值百分比（%）rV\_past\_min、rV\_past\_max：
9. **Dpdhs** 当前交易日的波动率超过过去n个交易日移动均值的k个移动标准差（哑元变量）dummy\_past\_diff\_higher\_std：

**Dpdls** 当前交易日的波动率低于过去n个交易日移动均值的k个移动标准差（哑元变量）dummy\_past\_diff\_lower\_std：

**Y：**

1. **Vf** 未来第个交易日的波动率V\_future：
2. **dVf** 未来第个交易日的波动率相比于当前交易日的涨跌额dV\_future：
3. **rVf** 未来第个交易日的波动率相比于当前交易日的涨跌幅（%）rV\_future：
4. **dVfm** 未来第个交易日的波动率相比于未来m个交易日移动均值的差值dV\_future\_mean：
5. **rVfm** 未来第个交易日的波动率相比于未来m个交易日移动均值的差值百分比（%）rV\_future\_mean：
6. **dVfs** 未来第个交易日的波动率相比于未来m个交易日移动均值的差值（移动标准差个数）dV\_future\_std：
7. **dVfmin、dVfmax** 未来第个交易日的波动率相比于未来m个交易日的差值dV\_future\_min、dV\_future\_max：
8. **rVfmin**、**rVfmax** 未来第个交易日的波动率相比于未来m个交易日移动最值的差值百分比（%）rV\_future\_min、rV\_future\_max：
9. **Dhfs** 未来第个交易日的波动率高于未来m个交易日移动均值的k个移动标准差（哑元变量）dummy\_higher\_future\_std：

**Dlfs** 未来第个交易日的波动率低于未来m个交易日移动均值的J个移动标准差（哑元变量）dummy\_lower\_future\_std：

1. **Dfdhu** 未来第个交易日的波动率相比于交易日t上涨额超过u（哑元变量）dummy\_future\_diff\_higher\_up：

**Dfdhd**未来第个交易日的波动率相比于交易日t下跌值低于d（哑元变量） dummy\_future\_diff\_lower\_down：

1. **Dfrhu** 未来第个交易日的波动率相比于交易日t上涨幅度（%）超过ru（哑元变量）dummy\_future\_return\_higher\_up：

[**Dfrhd**](代码项目框架.docx)未来第个交易日的波动率相比于交易日t下跌幅度（%）低于rd（哑元变量） dummy\_future\_return\_lower\_down：