**2019年MATLAB期末实验报告**

**文件名称：完整姓名\_完整学号.doc**

**收件邮箱：**[**zhongwan23@qq.com**](mailto:zhongwan23@qq.com)

**邮件标题：完整姓名\_完整学号《实验报告》**

**截止时间：2019年6月20日**

**文档形式：word97电子版**

**题目名称：XXXX数据分析**

**报告内容：**

**选择一只沪深A股，要求其代码后3位与自己学号后3位相同或相近，使用选择股票的日线数据作为实验报告数据。**

1. **数据处理**
2. **ascii2fts导入数据，要求数据大于100期，必须显示前五期时间序列数据；**
3. **利用fts2mat转换成矩阵，并提取收盘序列，展示价格序列；**
4. **利用price2ret转换成收益率序列，展示并分析收益率序列；**
5. **单位根检验，分析检验结果。**
6. **时间序列模型分析**
7. **用autocorr进行自相关分析，给出运行结果图；**
8. **用parcor进行偏相关分析，给出运行结果图；**
9. **分析运行结果，进行定阶，如果不能直接定阶，则利用最终预报误差定阶；**
10. **估计模型(ar、ma或arma)参数，写出最终的模型。**
11. **GARCH模型分析**
12. **GARCH(1,1)模型估计与分析；**
13. **GARCH仿真，原始价格序列与仿真价格序列对比及分析；**
14. **GARCH预测，预测结果展示和分析。**