

# 一类结合Outlier分析的单变量ARIMA模型在股票市场中的应用

曹韞建

上海理工大学商学院, 上海 200093

## A Univariate ARIMA Model with Outlier Analysis Applied in Stock Market

Cao Yunjian

College of Commerce, USST, Shanghai

- 摘要
- 参考文献
- 相关文章

**Download:** PDF (1561KB) [HTML](#) (KB) **Export:** BibTeX or EndNote (RIS) Supporting Info

**摘要** 本文通过对当前广泛使用的经济时间序列预测方法的分析比较,针对如股票价格这一类易受到大量外部因素影响且难以通过多变量建模分析的经济现象,采用了单变量ARIMA模型并结合Outlier分析的方法。实证分析表明了此方法具有良好的效果。

**关键词:** 时间序列 预测 单变量 ARIMA Outlier 分析 股票价格

**Abstract:** By the comparison with several economic forecasting methods,this paper adopts univariate ARIMA model and outlier analysis on some economic data,such as stock price,which is effected easily by outside factors and cannot be analyzed by multivariate model. The positive analysis represents its good performance.

收稿日期: 1997-11-10;

### 引用本文:

曹韞建 .一类结合Outlier分析的单变量ARIMA模型在股票市场中的应用[J] 中国管理科学, 1998,V(1): 10-15

### Service

- 把本文推荐给朋友
- 加入我的书架
- 加入引用管理器

- Email Alert
- RSS

### 作者相关文章

曹韞建

[1]



[1] 孙莹 鲍新中.一种基于方差最大化的组合赋权评价方法及其应用[J]. 中国管理科学, 2011,19(6): 141-148

[2] 赵昕东 钱国骥 .基于Kullback-Leibler信息量的最优ARMA模型组选择与组合预测研究[J]. 中国管理科学, 2011,19(5): 21-28

[3] 朱帮助 张秋菊 邹吴飞 魏一鸣 .基于OSA算法和GMDH网络集成的电子商务客户流失预测[J]. 中国管理科学, 2011,19(5): 64-70

[4] 滕文波 庄贵军 .基于电子渠道需求预测的渠道模式选择[J]. 中国管理科学, 2011,19(5): 71-78

[5] 毕功兵 冯晨鹏 丁晶晶.考虑环境属性约束的平行结构DEA模型[J]. 中国管理科学, 2011,19(5): 79-86

[6] 徐梅 黄超.基于符号时间序列方法的金融收益分析与预测[J]. 中国管理科学, 2011,19(5): 1-9

[7] 金帅 盛昭瀚 杜建国 .排污权交易系统中国政府监管策略分析[J]. 中国管理科学, 2011,19(4): 174-183

[8] 王正新 党耀国 练郑伟 .无偏GM(1,1)幂模型其及应用[J]. 中国管理科学, 2011,19(4): 144-151

[9] 蔡圣华 牟敦国 方梦祥 .二氧化碳强度减排目标下我国产业结构优化的驱动力研究[J]. 中国管理科学, 2011,19(4): 167-173

[10] 李美娟 陈国宏 林志炳 .基于漂移度的组合预测方法研究[J]. 中国管理科学, 2011,19(3): 111-117

- [11] 柴尚蕾 郭崇慧 苏木亚 .基于ICA模型的国际股指期货及股票市场对我国股市波动溢出研究  
[J]. 中国管理科学, 2011,19(3): 11-18
- [12] 程砚秋 迟国泰 .基于核主成分分析的生态评价模型及其应用研究[J]. 中国管理科学, 2011,19(3): 182-192
- [13] 程砚秋 迟国泰 .基于核主成分分析的生态评价模型及其应用研究&#61472;  
[J]. 中国管理科学, 2011,19(3): 182-192
- [14] 石琴 王楠楠 仇多洋 .粒子群优化的模糊聚类方法在车辆行驶工况中的应用  
[J]. 中国管理科学, 2011,19(2): 110-115
- [15] 张金良 谭忠富 李春杰 .短期电价预测的组合混沌方法  
[J]. 中国管理科学, 2011,19(2): 133-139