

中日股价序列相似性的比较分析

崔婧,赵秀娟,宋吟秋

收稿日期 修回日期 网络版发布日期 接受日期

摘要 将时间序列数据挖掘的方法应用到两国证券市场比较问题中,并在聚类分析中定义新的函数以判别最优的分类数. 我们发现:在指数收盘价时间序列比较方面,中日两个证券市场的确存在一定的相似性,但中国市场的短期波动要大于日本市场. 因此,如果将日本证券市场的发展历史作为中国证券市场的事件库,不足以描述和预测中国证券市场的走势. 同时,在中国证券市场上,深证成指比上证综指的短期波动幅度更大,具有更多的高频噪声.

关键词 [相似性](#) [时间序列](#) [数据挖掘](#) [证券市场](#)

分类号

DOI:

对应的英文版文章: [2009120125](#)

通讯作者:

作者个人主页: 崔婧;赵秀娟;宋吟秋

扩展功能

本文信息

▶ [Supporting info](#)

▶ [PDF](#) (980KB)

▶ [\[HTML全文\]](#) (0KB)

▶ [参考文献\[PDF\]](#)

▶ [参考文献](#)

服务与反馈

▶ [把本文推荐给朋友](#)

▶ [加入我的书架](#)

▶ [加入引用管理器](#)

▶ [引用本文](#)

▶ [Email Alert](#)

相关信息

▶ [本刊中 包含“相似性”的 相关文章](#)

▶ 本文作者相关文章

· [崔婧](#)

· [赵秀娟](#)

· [宋吟秋](#)