



首页
概况
研究机构
学者介绍
成果文库
文献数据
培训教育
对外交流

Search the Web

Find It

□ 您的位置： 首页 → 数技经济研究杂志 → 理论与方法研究

基于熵的股票市场长期风险度量研究

摘要：研究股票市场混沌时间序列的长期演化规律。借助最大信息熵原理推导了弱时间关联性时间序列波动强度的定态概率分布；在介绍了时间序列联合概率和条件概率含义的基础上，借助最大定标原理，讨论了具有弱时间关联性的股票市场长期行为的联合概率分布与条件概率分布；研究了两类再生概率分布，并给出四种系统风险度量评价指标。对中国沪市股票市场进行了实证研究。

关键词：混沌经济时间序列 波动强度 长期行为 风险度量

地址：北京市建国门内大街5号 邮政编码：100732 电话及传真：010-65125895、010-65137561

版权所有 (c) 中国社会科学院数量经济与技术经济研究所

联系我们 E-mail to: iqte@cass.org.cn