



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

□ 您的位置: 首页 → 数技经济研究杂志 → 现实经济问题研究

## 股票市场收益率波动长记忆性的分解及实证研究

**【摘要】**目前股票市场长记忆性检验和建模方法,不能很好地消除短期记忆的影响,针对这一问题,本文提出寻找序列的突变点,通过将序列分解为只包含长记忆性部分和不包含长记忆性部分的序列分解技术,来排除短期记忆的影响。对上证指数和深圳成分指数收益率波动的长记忆性进行实证研究发现,将序列分解以后进行长记忆性检验,不仅可以得出长记忆性检验更为精确的结论,同时可以检验序列分解过程的效果。

关键词 序列分解 结构转换 修正R/S分析

Search the Web

Find It

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