

小波分频技术和混沌时间序列在国际石油价格预测中的应用

葛根,王洪礼,许佳

收稿日期 修回日期 网络版发布日期 接受日期

摘要

提供了一种小波分频技术结合Volterra自适应滤波器的预测石油价格趋势的方法,先对原始的石油价格时间序列进行小波分频分析,将分解后的各层尺度系数和细节系数重构各层的时间序列,然后分别计算各层时间序列的最佳延迟时间和嵌入维数来重构相空间,最终用Volterra自适应滤波器法预测各层时间序列,重构成预测油价.实验证明该方法比直接混沌时间序列全局预测和一阶局域预测的精度更高,可预测范围更大.

关键词

[小波分析](#) [混沌时间序列](#) [Volterra自适应滤波器](#) [石油价格](#) [预测](#)

分类号

DOI:

对应的英文版文章: [2009070064](#)

通讯作者:

作者个人主页: 葛根;王洪礼;许佳

## 扩展功能

本文信息

▶ [Supporting info](#)

▶ [PDF](#)(974KB)

▶ [\[HTML全文\]](#)(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 “](#)

[小波分析”](#) 的 [相关文章](#)

▶ 本文作者相关文章

· [葛根](#)

· [王洪礼](#)

· [许佳](#)