

论文

基于小波神经网络的非线性误差校正模型及其预测

[刘丹红](#) [张世英](#)

(天津大学理学院 300072)

Abstract 针对非线性系统的预测问题,在线性和非线性协整理论涵义的基础上,提出利用小波神经网络进行非线性协整系统的非线性误差校正模型的研究,并给出该模型的建模方法.对沪深股市进行实证研究,与线性向量自回归模型进行比较.研究证明,小波神经网络所建立的非线性误差校正模型有较好的预测效果,能够有效地预测非线性经济系统.

Keywords [协整](#) [非线性协整](#) [小波神经网络](#) [非线性误差校正模型](#) [VAR模型](#)

收稿日期 2005-6-27 修回日期 2005-10-21

通讯作者 刘丹红 liudanhong@eyou.com

DOI 分类号 F830