

博士论坛

区间计量方法及其在油价预测中的应用研究

李红权^{1, 2}

1.湖南师范大学 商学院 金融系, 长沙 410081

2.中国科学院 数学与系统科学研究院, 北京 100190

收稿日期 2009-11-10 修回日期 2009-12-29 网络版发布日期 2010-2-23 接受日期

摘要 经典的计量经济学建模与预测方法是基于点数据的, 忽略了区间内价格波动的大量信息, 因而预测效果欠佳。引入区间计算与区间计量方法, 应用于国际原油期货价格的预测, 研究结果表明: 相对于经典AR-GARCH模型的置信区间预测结果, 区间计量方法的预测结果具有更高的准确度与更小的预测误差。研究证实了区间计算与区间计量方法的优越性, 并揭示了在经济领域的重要应用价值。

关键词 [区间计算](#) [区间计量](#) [区间预测](#) [原油期货价格](#)

分类号 [TP391](#)

Application of interval econometrics for crude oil price forecasting

LI Hong-quan^{1, 2}

1.School of Business, Hunan Normal University, Changsha 410081, China

2.Academy of Mathematics and Systems Science, Chinese Academy of Sciences, Beijing 100190, China

Abstract

The classical econometrics models and forecasting methods based on point data have poor forecasting quality because those models might neglect the important interval information of the price movement. A new interval method based on interval computing and interval econometrics to predict crude oil prices is applied. Compared with the confidence interval forecasts based AR-GARCH model, the interval econometrics method yields more accuracy ratio and much less forecast error. This study validates the interval econometrics method, and uncovers the important application to economic issues.

Key words [interval computing](#) [interval econometrics](#) [interval forecasting](#) [crude oil future's prices](#)

DOI: 10.3778/j.issn.1002-8331.2010.06.007

通讯作者 李红权

扩展功能

本文信息

▶ [Supporting info](#)

▶ [PDF\(753KB\)](#)

▶ [\[HTML全文\]\(0KB\)](#)

▶ [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](#)

▶ [复制索引](#)

▶ [Email Alert](#)

▶ [文章反馈](#)

▶ [浏览反馈信息](#)

相关信息

▶ 本刊中 包含“[区间计算](#)”的
[相关文章](#)

▶ 本文作者相关文章

· [李红权](#)

·