

基于相空间重构的同业拆借利率混沌特性研究

李玉锁, 齐中英

哈尔滨工业大学管理学院, 黑龙江, 哈尔滨, 150001

A Study on the Chaotic Characteristics for Interbank Rate Based on Phrase Space Reconstruction

LI Yu-suo, QI Zhong-ying

School of Management, Harbin Institute of Technology, Harbin 150001, China

- [摘要](#)
- [参考文献](#)
- [相关文章](#)

Download: [PDF \(954KB\)](#) | [HTML \(KB\)](#) | Export: [BibTeX](#) or [EndNote \(RIS\)](#) | [Supporting Info](#)

摘要 同业拆借利率在整个金融市场的利率结构中具有导向作用,因此对同业拆借利率波动的研究具有重要意义.本文基于相空间重构技术对我国银行间同业拆借利率进行了实证研究,通过关联维数和Kolmogorov熵这两个指数来研究我国银行间同业拆借利率的混沌特征.计算结果表明,银行间同业拆借利率具有混沌特性,这使得对同业拆借利率的长期预测成为不可能.

关键词: [同业拆借利率](#) [混沌](#) [关联维数](#) [相空间重构](#)

Abstract: Interbank rates have important effects on other interest rates in the financial market, and therefore it is very important to research the fluctuation of interbank rate. Based on phrase space reconstruction, the paper gives empirical analysis on chaos in China interbank offered rate. The paper analyzes chaotic characteristics of China interbank offered rate by correlation dimension and Kolmogorov entropy. The results demonstrate that interbank rate has chaotic properties, which make the long term forecast impossible.

收稿日期: 2005-11-14;

引用本文:
李玉锁, 齐中英. 基于相空间重构的同业拆借利率混沌特性研究[J] 中国管理科学, 2006, V(6): 140-143

Service
把本文推荐给朋友
加入我的书架
加入引用管理器
Email Alert
RSS
作者相关文章
李玉锁
齐中英

没有本文参考文献

没有找到本文相关文章