

基于漂移度的组合预测方法研究

李美娟, 陈国宏, 林志炳

福州大学管理学院, 福建福州350108

A Combination Forecasting Model based on Drift

LI Mei-juan, CHEN Guo-hong, LIN Zhi-bing

School of Management, Fuzhou University, Fuzhou 350108, China

- [摘要](#)
- [参考文献](#)
- [相关文章](#)

Download: [PDF \(0KB\)](#) | [HTML \(1KB\)](#) | Export: [BibTeX](#) or [EndNote \(RIS\)](#) | [Supporting Info](#)

摘要 由于不同的预测方法能够提供不同的有用信息,其预测精度往往也存在差异,为了分散预测的风险,采用组合预测方法。本文首先提出相容方法集和互补模型集,然后在对不同单一预测模型的漂移性和互补性研究的基础上提出了基于漂移度的组合预测模型,为组合预测模型研究提供一种新的思路。最后通过实例来说明基于漂移度的组合预测模型能够提高样本期预测精度和外推预测精度及实际应用的有效性。

关键词: [组合](#) [预测](#) [漂移性](#) [互补性](#) [相容性](#)

Abstract: As different methods diverse in providing information and forecast precision, the combined forecasting model is employed. Combination forecasting model based on drift is proposed on basis of the study on drift and complementarity of different single forecasting models. A new thought of combination forecasting model is given. Finally some practical examples are given to show that combination forecasting model based on drift can improve forecasting precision and is effective in practice.

收稿日期: 2010-04-14;

基金资助:

教育部人文社会科学研究青年基金(10YJC630120, 10YJC630139); 国家软科学研究项目(2006GXQ3D108); 福建省软科学研究重点项目(2009R0054, 2010R0065); 福州大学科技发展基金(10SKQ02)

作者简介: 李美娟(1979-), 女(汉族), 福建古田人, 福州大学管理学院讲师, 博士, 研究方向: 评价与预测。

引用本文:

李美娟, 陈国宏, 林志炳. 基于漂移度的组合预测方法研究[J]. 中国管理科学, 2011, 19(3): 111-117

没有本文参考文献

- [1] 李美娟, 陈国宏, 陈勃, 徐林明. 基于方法集化的动态组合评价方法研究[J]. 中国管理科学, 2013, (2): 132-137
- [2] 刘汉, 刘金全. 中国宏观经济情境设计与路径预测[J]. 中国管理科学, 2013, (1): 47-56
- [3] 李珠瑞, 马溪骏, 彭张林. 基于离差最大化的组合评价方法研究[J]. 中国管理科学, 2013, (1): 174-179
- [4] 谈正达, 霍良安. 无套利Nelson-Siegel模型在中国国债市场的实证分析[J]. 中国管理科学, 2012, 20(6): 18-27
- [5] 魏宇. 基于多分形理论的动态VaR预测模型研究[J]. 中国管理科学, 2012, 20(5): 7-15
- [6] 姚升保, 徐敏. 群组决策中三角模糊数互补判断矩阵的相容性及方案排序研究[J]. 中国管理科学, 2012, 20(5): 152-156
- [7] 蒋春福, 杨宇宽. 证券组合有效子集的统计检验及实证研究[J]. 中国管理科学, 2012, (4): 52-59

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

[李美娟](#)
[陈国宏](#)
[林志炳](#)

- [8] 王鹏飞, 李畅. 不确定多属性决策双目标组合赋权模型研究[J]. 中国管理科学, 2012,(4): 104-108
- [9] 史会峰, 牛东晓, 卢艳霞. 基于贝叶斯神经网络短期负荷预测模型[J]. 中国管理科学, 2012,(4): 118-124
- [10] 阮连法, 包洪洁. 基于经验模态分解的房价周期波动实证分析 [J]. 中国管理科学, 2012,(3): 41-46