

基于时间偏序切割与压强反馈的样本空间生成方案

- 作者: GaoZheng
- 日期: 2025-03-19
- 版本: v1.0.0

一、建模动机与总体目标

目标:

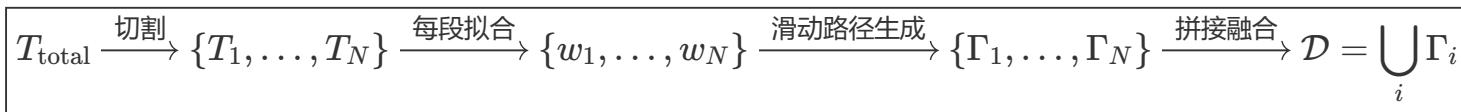
构建一个**结构性样本空间**, 用于训练或推导解析解AI、策略演化系统或金融路径预测引擎, 确保:

- 样本空间具备**动态稳定性**;
- 局部结构具备**压强一致性**;
- 支持对**非平稳系统**进行**段落建模**与演化拟合。

二、方案概述

给定一个总历史区间 T_{total} (如三年市场历史), 将其划分为多个局部演化段, 每段进行超参数优化, 再从每段中提取滑动路径, 形成多段压强张量支持下的路径样本空间。

该方案可表达为四步:



三、步骤详解

Step 1: 切割总周期为局部演化段

设总历史时间为 $T_{\text{total}} = [t_0, t_f]$, 长度为3年, 选择基本切割单位为1季度(3个月), 则:

$$T_{\text{total}} = \bigcup_{i=1}^{12} T_i, \quad T_i = [t_{i-1}, t_i]$$

每个 T_i 对应一个局部市场状态段。

Step 2：在每段 T_i 上进行超参数拟合

对每个 T_i , 构建状态路径数据 Γ_i^{raw} , 并执行权重拟合:

$$w_i = \arg \min_w \sum_{\gamma \in \Gamma_i^{\text{raw}}} (L(\gamma; w) - y(\gamma))^2$$

其中:

- $L(\gamma; w) := \sum \tanh(\mu(\sigma_k, \sigma_{k+1}; w))$
- $y(\gamma)$: 观测逻辑值或目标策略评分;
- $w_i \in \mathbb{R}^d$: 该周期下的压强张量权重。

目的: 在每个局部状态段上拟合出反映该时段市场结构的“微分动力系统”。

Step 3：滑动窗口提取样本路径

设每段轨迹为时间序列 $\mathcal{S}_i = (\sigma_1, \sigma_2, \dots, \sigma_{n_i})$, 使用窗口大小 w (如5), 滑动步长 s (如1), 构造:

$$\Gamma_i := \{(\sigma_k, \dots, \sigma_{k+w-1}) \mid k = 1, \dots, n_i - w + 1\}$$

- 每条路径都在权重 w_i 下具有良好的压强积累结构;
 - 每段样本集 Γ_i 共享同一个压强张量 w_i , 确保路径之间的逻辑一致性;
 - 多段样本集构成异构压强空间。
-

Step 4：拼接所有段生成最终样本空间

最终样本空间构造为:

$$\mathcal{D} := \bigcup_{i=1}^{12} \Gamma_i$$

可用于:

- 推导泛属性状态演化的D结构；
 - 构建压强预测模型；
 - 训练解析解路径推理引擎；
 - 输入至O3路径积分系统用于路径自然性对齐与演化预测。
-

四、数学结构表达形式

1. 路径积分模型：

$$L(\gamma; w_i) = \sum_{k=1}^{n-1} \tanh(w_i \cdot (P(\sigma_{k+1}) - P(\sigma_k)))$$

2. 样本空间表示：

$$\mathcal{D} = \{\gamma \in \mathcal{S}_i^w \mid i \in \{1, \dots, N\}, \gamma \text{ 合法路径}\}$$

五、合理性与优势分析

维度	分析结论
合法性	所有优化过程具有凸性与可导性，样本生成过程确定，数学上成立
稳定性	每段采用拟合后的 w_i ，在该段内部压强路径稳定性强
泛化性	多段拼接结构可应对非平稳性，生成跨期路径时提供张量场切换机制
可解释性	每条路径都有对应的局部压强结构，可用于溯源解释
模块性	各阶段解耦，可独立调参与训练，易嵌入AI引擎或O3建模框架

六、可扩展方向建议

1. **高频微结构扩展**：将每季度再切为月、周、日级，形成主纤维结构的多层次滑移系统；
 2. **权重平滑机制**：定义跨段权重变换为联络张量 $\mathcal{A}_{i,i+1} = w_{i+1} - w_i$ ，形成“演化连接张量”；
 3. **D结构反馈**：将每段压强逻辑性 $L(\gamma; w_i)$ 回注至D结构中，优化演化路径推荐；
 4. **GLDKG/量子机制映射**：以 Γ_i 为微观扰动传播的路径场，评估系统对策略扰动的弹性或脆弱性。
-

许可声明 (License)

Copyright (C) 2025 GaoZheng

本文档采用[知识共享-署名-非商业性使用-禁止演绎 4.0 国际许可协议 \(CC BY-NC-ND 4.0\)](#)进行许可。