三、模型假设

为了建立更精确的数学模型，本文根据实际情况进行一些合理的假设和条件约束，具体假设如下所示：

1‘本题所引用股票数据真实有效；

2‘股票日期对其余检测指标无影响；

3‘不同股票之间互不影响。

四、符号说明

符号 说明

R 协方差矩阵

λ 矩阵R的特征值

yj  主成分

bj 贡献率

αｐ 累计贡献率

P 显著性

AIC值 衡量统计模型拟合优良性的一种标准

t T检验结果

p q ACF图中最显著的阶数

R² 时间序列的拟合程度

e 信息熵值

d 信息效用值

D+ 正理想解距离

D- 负理想解距离

A+或A- 评价对象与最优或最劣解

C值 综合度得分