

# 汇率预测与外汇干预研究



[汇率预测与外汇干预研究 下载链接1](#)

著者:谢赤

出版者:科学出版社

出版时间:2013-3

装帧:

isbn:9787030369505

《汇率预测与外汇干预研究》广泛地探讨了跨学科的组合预测模型和前沿的非线性分析范式在汇率预测与外汇干预研究中的应用，深入解析了选择科学的方法准确描述汇率行为，提高汇率预测的精度与合理性，帮助度量与控制外汇市场风险，并据此合理利用外汇干预手段对市场进行调节，将有助于提高对外汇市场进行监督和管理准确性、科学性和有效性，对加强风险管理，提高金融监管有效性，提高宏观调控水平，保持经济平稳较快发展具有重要意义。

作者介绍:

## 目录: 第1章 汇率系统的动态复杂性与汇率预测方法

- 1.1 汇率时间序列的非线性特征与检验方法
- 1.2 汇率预测的基本分析与技术分析
- 1.3 汇率预测的非线性非参数方法
- 1.4 汇率预测效果的评价

## 第2章 基于空间聚类和神经网络的汇率预测

- 2.1 基于聚类的神经网络模型及其预测研究现状
- 2.2 汇率预测与时间序列聚类分析技术
- 2.3 空间聚类与神经网络组合的汇率预测
- 2.4 汇率时间序列的UKW聚类分析
- 2.5 基于汇率聚类簇的反馈神经网络预测
- 2.6 基于UKW聚类与反馈神经网络的汇率预测结论

## 第3章 基于时频分析和神经网络的汇率预测

- 3.1 Elman反馈神经网络模型
- 3.2 基于Hilbert-Huang变换的汇率时间序列时频分析
- 3.3 基于反馈神经网络的汇率预测
- 3.4 基于Hilbert-Huang变换和Elman网络的汇率预测结论

## 第4章 基于GARCH模型和神经网络的汇率预测

- 4.1 研究基础与分析框架的提出
- 4.2 GARCH-GRNN组合预测模型参数选择
- 4.3 基于GARCH-GRNN模型的汇率预测实证研究
- 4.4 本章小结

## 第5章 基于小波变换和支持向量机的汇率预测

- 5.1 支持向量回归组合预测模型构建
- 5.2 小波母函数及分解尺度的选择
- 5.3 汇率序列滞后阶的识别和确定
- 5.4 支持向量机的回归模型的参数选取
- 5.5 基于支持向量组合模型的汇率预测
- 5.6 本章小结

## 第6章 基于光顺样条滤波和支持向量机的汇率预测

- 6.1 相关研究基础与理论分析
- 6.2 基于SS滤波与RBF模型的预测方法设计
- 6.3 基于SS滤波与RBF模型的人民币汇率预测
- 6.4 本章小结

## 第7章 基于独立分量分析与支持向量机的汇率预测

- 7.1 非线性非参数汇率行为预测方法及其研究动态
- 7.2 样本选取与组合预测模型构建
- 7.3 预测效果的比较分析
- 7.4 本章小结

## 第8章 外汇干预机制与国际外汇干预实践

- 8.1 外汇干预基本概念
  - 8.2 汇率制度与外汇干预
  - 8.3 国际外汇干预机制与实践经验
- ## 第9章 外汇干预基本理论与研究方法

- 9.1 外汇干预的理论依据
- 9.2 汇率决定基础上的外汇干预理论
- 9.3 中央银行外汇干预行为描述方法
- 9.4 外汇干预有效性研究方法

## 第10章 中央银行外汇干预行为描述及实证

- 10.1 中央银行外汇干预反应函数非线性FTR模型的提出
- 10.2 外汇干预反应函数非线性FTR模型的实证
- 10.3 中央银行外汇干预行为规则的获取方法

10.4 外汇干预行为规则获取的实证

第11章 基于IV-GARCH模型的汇率干预有效性研究

11.1 汇率管理干预行为及其有效性的研究动态

11.2 样本选取与模型构建

11.3 实证结果及分析

11.4 本章小结

第12章 外汇干预传递渠道的有效性研究

12.1 外汇干预传递的资产组合渠道实证方法

12.2 资产组合渠道有效性实证研究

12.3 外汇干预传递的预期渠道实证方法

12.4 预期渠道有效性实证研究

第13章 外汇干预策略影响汇率的有效性研究

13.1 基于混沌控制的外汇干预有效性研究方法

13.2 外汇干预自适应混沌控制策略的有效性仿真

13.3 外汇干预策略影响汇率的有效性实证设计

13.4 外汇干预策略影响汇率的有效性实证结果与分析

第14章 中国外汇干预的实践与展望

14.1 人民币汇率形成机制

14.2 中国外汇干预的历程与研究状况

14.3 中国外汇干预现状分析与未来展望

14.4 中国外汇干预的对策分析

参考文献

后记

• • • • •

(收起)

[汇率预测与外汇干预研究 下载链接1](#)

标签

外汇

预购

L

1212

评论

-----  
[汇率预测与外汇干预研究\\_下载链接1](#)

书评

-----  
[汇率预测与外汇干预研究\\_下载链接1](#)