

《汇率预测》

图书基本信息

书名：《汇率预测》

13位ISBN编号：9787509612132

10位ISBN编号：7509612136

出版时间：2011-1

出版社：经济管理出版社

作者：艾玛·A.穆萨

页数：365

译者：刘君

版权说明：本站所提供下载的PDF图书仅提供预览和简介以及在线试读，请支持正版图书。

更多资源请访问：www.tushu000.com

《汇率预测》

内容概要

《汇率预测:技术与应用》包含了和汇率预测相关的方方面面，作者艾玛试图达到以下两个方面的平衡：一个是内容上的技术与应用方面的平衡；另一个是风格上的严肃性与通俗性方面的平衡。因此《汇率预测:技术与应用》的写作风格各处不一，既有非常简洁的新闻体风格，也有教科书般的严谨风格。

书籍目录

第一章 预期和预测综述	1.1 一个旅游者的故事	1.2 一个商业经理的故事	1.3 预测的重要性	1.4 汇率的重要性	1.5 汇率预测的基础知识	1.6 哪种汇率？	1.7 预期的形成机制	1.8 汇率变化的特有规律	1.9 总结							
第二章 作为决策制定变量的汇率预测	2.1 引言	2.2 即期投机	2.3 非抛补套利	2.4 即期—远期投机	2.5 远期投机	2.6 期权投机	2.7 交易敞口的套期保值	2.8 开放经济中的套期风险及其测量	2.9 转换货币敞口的套期保值	2.10 短期融资和投资决策	2.11 长期融资和投资决策	2.12 国外直接投资	2.13 定价和战略规划	2.14 中央银行干预和宏观经济政策	2.15 不需要汇率预测的决策准则	2.16 总结评价
第三章 单变量时间序列技术	3.1 引言	3.2 预测模型的建立	3.3 平均法	3.4 平滑法	3.5 时间序列的分解	3.6 BOX-Jenkins方法：ARIMA模型	3.7 时间序列分析：HARVEY的结构时间序列模型	3.8 计算机软件	3.9 深入阅读							
第四章 多变量时间序列模型	4.1 综述	4.2 单方程经济模型：说明与预测	4.3 单方程模型的问题	4.4 理论基础：购买力平价（Purchasing Power Parity）	4.5 理论基础：抛补的和非抛补的利率平价（Covered and Uncovered Interest Parity）	4.6 理论基础：流量模型（The Flow Model）	4.7 理论基础：弹性价格货币模型（The Flexible-Price Monetary Model）	4.8 理论基础：弹性价格货币模型的扩展	4.9 理论基础：粘性价格货币模型（The Sticky-Price Monetary Model）	4.10 理论基础：汇率决定的其他模型	4.11 单方程模型：一些经济计量学上的问题	4.12 单方程结构时间序列模型	4.13 多方程经济模型	4.14 实证证据	4.15 计算机软件	4.16 深入阅读
第五章 基于市场的预测：即期和远期汇率	5.1 引言	5.2 以即期汇率作为预测依据：随机漫步模型	5.3 一些修正	5.4 以远期汇率作为预测依据：无偏有效假说	5.5 经验证据及合理性	5.6 市场有效的其他概念	5.7 截面效率和协积化（Cross-Sectional Efficiency And Cointegration）									
第六章 判断性和合成性的预测	6.1 判断性预测综述	6.2 作为决策过程一部分的判断性预测	6.3 预测的判断性处理	6.4 判断性预测在情景描述中的作用	6.5 判断性预测：最后评价	6.6 合成性预测：一个综述	6.7 合成预测的方法	6.8 一致性的预测								
第七章 技术分析	7.1 定义与基本原则	7.2 道氏理论和艾略特波浪理论	7.3 图表的种类	7.4 图表格式：趋势线和通道	7.5 支撑、阻力、回调和速度阻力线	7.6 反转形态	7.7 整理形态	7.8 用K线图表示的牛市反转形态	7.9 用K线图表示的熊市反转形态	7.10 用K线图表示的整理形态	7.11 数量技术指标	7.12 技术分析经济学	7.13 电脑软件和深入阅读			
第八章 交易规则	8.1 引言	8.2 简单滤波规则	8.3 引入买卖差价和利率的滤波规则	8.4 基于数量技术指标的交易规则	8.5 基本交易规则	8.6 对交易规则盈利性的测量	8.7 关于交易规则盈利性的经验证据									
第九章 最新动态：混沌和神经网络理论	9.1 引言	9.2 混沌理论：背景	9.3 确定的和随机的模型	9.4 非线性和混沌模型	9.5 混沌和随机过程的比较	9.6 非线性的根源	9.7 混沌对于预测的意义	9.8 检验与经验证明	9.9 人工神经网络：一个回顾	9.10 人工神经网络的结构	9.11 人工神经网络的功能	9.12 汇率上的应用：方法论与实证证明	9.13 计算机软件和进一步阅读的材料			
第十章 对预测精度的测量	10.1 引言	10.2 一些总体的思考	10.3 对汇率实际值和预测值之间差异的显著性检验	10.4 测量和监控预测精度的几何方法	10.5 对预测精度的定量测度方法											
第十一章 预测的选择、实施和监控	11.1 两个汇率预测员的故事	11.2 预测员之间为什么出现分歧？	11.3 内部预测还是外部预测？	11.4 选择一个外部预测员	11.5 预测的实施	11.6 预测的监控										
附录：现实中的外汇预测服务																
第十二章 案例研究	12.1 案例研究1：ABC家具有限公司	12.2 案例研究2：DEF办公设备有限公司	12.3 案例研究3：GHI金融服务有限公司	12.4 案例研究4：JKL电子有限公司	12.5 案例研究5：MNP贸易有限公司											
第十三章 总评	13.1 摘要论述	13.2 最重要的问题	13.3 我们要从这走向哪里？	术语表参考文献												

到目前为止，我们交换地使用着预期与预测两个词。因此，自然有人会问这两个词是同一个意思吗？其实这两个词并不是同一个东西：它们之间的联系是，预测是形成预期的一个规范的方法。然而问题就在于如何定义“规范”这个词。当然，如果预测是基于某些数据分析程序作出的话，那么这个预测过程就是规范的。而基于直觉和判断的预期又是什么呢？如果直觉和判断在没有运用准确的方程或严密的模型的对事件做了实际分析，这也是一个预测。但是这种情况下的预测是判断的，而不是数量的或科学的预测。另一方面，假如预期是基于某种预感的话，那么它就不是规范的，并且也不构成预测。预测是重要的、必须的，因为我们是在一个不确定的世界中生活工作和作出决策的。预测的一个功能就是把不确定性转变成风险。我们不知道未来会发生什么，这就是不确定性。而当未来的结果有一个概率分布时，风险就出现了。当我们按照这个概率分布决策时，决策的好坏就决定于未来实际上将发生什么，而这恰恰超出了决策者的控制。因而风险的存在是源于预测的概率分布在实际行动时可能发生损失。预测可能以一定的概率采取以下形式中的一种：它可能是只考虑了一种可能性的简单预测，也可能是考虑了所有各种可能性的预测。它还有可能是一个范围值，而汇率就可能会在这个范围内变化。尽管预测作为一种职业正在加速繁荣着，但是它经常受到同时来自圈内和圈外人士的质疑，也即是来自那些可能是用户或旁观者的经济学家和非经济学家的质疑。这些怀疑者通常认为预测由于其必然的不准确性因而没有什么价值，因此决策者做得好还是坏就像按照掷硬币决定一样。……

《汇率预测》

精彩书评

1、这种书强调汇率预测在商业决策制定过程中的应用，而在此种情况下被用来预测的经济计量学和统计分析方面的特征则被放在了次要的地位。本书包含了和汇率预测相关的方方面面，而最后三章介绍的几个模型尤为精妙，我将他们用现代计算机技术实现，并放到我的网站上<http://www.xuncui.info>，有兴趣的读者可以看看。

《汇率预测》

版权说明

本站所提供下载的PDF图书仅提供预览和简介，请支持正版图书。

更多资源请访问:www.tushu000.com