第一图书网, tushu007.com

<<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

出版时间：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，请支持正版图书。

更多资源请访问：http://www.tushu007.com

内容概要

《汇率预测技术应用》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 导言2.2 即期投机2.3 非抛补套利2.4 即期一远期投机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 导言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-Jenldns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 F1exible-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 导言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 导言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 导言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 导言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

章节摘录

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条件下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。
……

第一图书网, tushu007.com

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:http://www.tushu007.com