第一图书网, tushu007.com

<<汇率波动复杂性>>

图书基本信息

书名：<<汇率波动复杂性>>

13位ISBN编号：9787500484165

10位ISBN编号：750048416X

出版时间：2009-9

出版时间：中国社会科学出版社

作者：伍海华

页数：292

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

第一图书网, tushu007.com

<<汇率波动复杂性>>

内容概要

《汇率波动复杂性》是国家社会科学基金项目研究成果，是教育部人文社会研究项目成果，是新世纪优秀人才支持计划(NCET-04-0647)资助的图书。
主要内容有：均衡汇率理论研究综述、主要均衡汇率理论应用比较等。

第一图书网, tushu007.com

<<汇率波动复杂性>>

作者简介

伍海华，男，1966年8月出生，湖南新宁县人，经济学博士、博士生导师，现为青岛大学经济学院教授、青岛新宝通投资管理有限公司总经理，主要从事经济系统复杂性研究。
自2001年至今著有《经济增长、波动与调整》、《西方货币金融理论》、《资本市场复杂性》、《随机过程：金融资产定价之应用》等8部著作，发表学术论文31篇，其中被EI、ISTP等收录5篇，承担了国家社会科学基金项目、教育部新世纪优秀人才支持计划项目等科研项目6项，获得山东省社会科学优秀成果二等奖2次、三等奖2次，是山东省重点强化建设学科金融学课负责人及学科带头人、中华外国经济学说研究会理事。

第一图书网, tushu007.com

<<汇率波动复杂性>>

书籍目录

第一章 汇率波动的基本特征及其复杂性　第一节 汇率与汇率波动　第二节 汇率波动的主因分析　第三节 汇率波动的基本特征及其复杂性　第四节 本书的框架及意义第二章 经典汇率决定理论评述　第一节 20世纪70年代前的传统汇率决定理论　第二节 20世纪70年代后的现代汇率决定理论第三章 均衡汇率理论研究　第一节 均衡汇率理论研究综述　第二节 主要均衡汇率理论应用比较第四章 均衡汇率实证研究　第一节 日元均衡汇率实证研究　第二节 欧元均衡汇率实证研究　第二节 人民币均衡汇率实证研究第五章 人民币汇率风险度量的实证研究　第一节 人民币汇率风险及其度量的现状分析　第二节 VaR模型的理论述评　第三节 VaR模型对人民币汇率风险的实证度量　第四节 分析结论第六章 外汇市场EMH及非线性特征检验　第一节 有效市场假说概述　第二节 外汇市场非线性特征初探　第三节 EMH对外汇市场解释失灵原因分析第七章 复杂性理论简介：分形与混沌　第一节 复杂性理论概述　第二节 分形理论　第三节 混沌理论：复杂性科学的重要组成部分第八章 外汇市场相对效率分形研究　第一节 外汇市场相对效率及分形市场假说概述　第二节 外汇市场相对效率分形分析　第三节 人民币汇率与美元指数及人民币NDF市场相关性研究第九章 汇率波动混沌特性实证研究　第一节 系统混沌、奇异吸引子存在的判定方法　第二节 汇率波动混沌特性实证分析　第三节 本章结论第十章 遗传算法和神经网络在汇率预测中的应用　第一节 人工神经网络基本理论分析　第二节 基于实数编码遗传算法的BP神经网络的构建　第三节 汇率时间序列的CA-BP神经网络模型预测第十一章 汇率波动复杂性研究的未来发展　第一节 汇率波动复杂性研究的评价　第二节 汇率波动复杂性理论的新进展　第三节 汇率波动复杂性研究展望参考文献后记

第一图书网, tushu007.com

<<汇率波动复杂性>>

章节摘录

汇率波动是外汇市场的正常现象。
研究汇率波动的特征及其成因对于中央银行制定汇率政策、国际资产组合管理、外汇期权定价、外汇市场有效性检验等问题具有重要的理论和实践意义。

在金本位制度下，汇率由铸币平价决定，受外汇供求影响在黄金输出人点之间窄幅波动。
汇率决定的基础在于铸币平价，即不同货币间含金量的对比，外汇供求关系的变动使汇率围绕铸币平价上下波动。
当某种货币供不应求时，其汇价会上涨，但不会超过黄金输出点；当某种货币供过于求时，其汇价会下跌，但不会超过黄金输入点。

在纸币制度下，两国货币之间的汇率取决于它们各自在国内所代表的实际价值。
自布雷顿森林体系解体后，浮动汇率制成为世界上主要的汇率制度。
但是，自1973年牙买加协议使得浮动汇率制确立以来，各国间汇率变动反复无常，主要货币如美元、英镑、日元、马克之间的汇率大起大落，并且汇率波动的频率和幅度越来越大，对国际金融体系的稳定产生了巨大的冲击。

随着全球经济一体化、投资自由化的发展，又由于存在不同的决定汇率的原则，各国之间经济的相互依赖性加强，货币政策间的合作也日趋密切，特别是电讯网络的飞速发展，使汇率波动在国际间相互快速传递，更增加了汇率波动的复杂性。
尤需指出的是，浮动汇率制赋予了各国自主决定汇率的权力，因此各国都能按有利于本国经济发展的目标来干预外汇市场，使汇率确定在一个合理的水平上。

第一图书网, tushu007.com

<<汇率波动复杂性>>

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