

图书基本信息

书名：<<人民币汇率行为描述与风险管理（全4册）>>

13位ISBN编号：9787543860674

10位ISBN编号：7543860678

出版时间：2010-7

出版时间：湖南人民出版社

作者：谢赤 等著

页数：921

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

《人民币汇率行为描述与风险管理(套装共4册)》为套装书,分别包括:《人民币汇率行为描述与风险管理:基于微观结构理论与混沌分析的汇率研究》、《人民币汇率行为描述与风险管理:汇率风险套期保值研究》、《基本神经网络模型的人民币汇率预测研究》、《人民币汇率行为描述与风险管理:汇率非线性动力学特征及组合预测》。

随着经济全球化和金融自由化进程的加快,世界经济在获得更高效率的同时,也不断地受到金融风险和金融危机的威胁。

尤其是自20世纪90年代以来,频繁发生的金融危机引起国际社会和理论界对金融安全问题更深层次的关注。

汇率作为两种货币的相对价格,是一国经济最重要的变量之一,它在影响宏观经济运行的同时,也对微观经济层面上的资源配置起着重要作用。

同时,汇率波动的不确定性还能直接、敏感地反映一国经济波动的程度和金融风险的大小。

书籍目录

《人民币汇率行为描述与风险管理:基于微观结构理论与混沌分析的汇率研究》 第1章 绪论 1.1 研究背景与意义 1.2 研究动机 1.3 研究问题与相关理论 1.3.1 汇率行为描述 1.3.2 汇率预测 1.3.3 微观市场结构理论 1.3.4 混沌理论 1.4 研究路线与结构安排 1.4.1 技术路线 1.4.2 结构安排 第2章 汇率行为研究的理论基础与方法 2.1 现代汇率理论与汇率制度 2.1.1 汇率理论 2.1.2 汇率制度及其分类 2.2 协整理论与技术 2.2.1 传统计量经济方法的不足与协整技术的产生 2.2.2 协整理论的基本概念 《人民币汇率行为描述与风险管理:汇率风险套期保值研究》 《基本神经网络模型的人民币汇率预测研究》 《人民币汇率行为描述与风险管理:汇率非线性动力学特征及组合预测》

章节摘录

插图：其特征可以用三个以往从未被重视过的经济学概念加以描述：一是私人信息，二是市场参加者的异质性，三是交易系统。

这一理论指出，当市场非完全有效的时候，一部分知情交易者便利用他们的信息优势向做市商们发出外汇交易的订单指令以达到自己利润最大化的目的。

相反，做市商只能通过观察他们的订单，揣测他们手中的私人信息，以此来不断的调整买人和卖出的报价，促使交易成立。

而非知情交易者分为相机抉择流动性交易者与非相机抉择流动性交易者，他们处于流动性的需要，只能接受价格，最多能选择时机参与交易。

因此，在这样的交易体系中，市场中的信息是通过一个个外汇买卖的交易订单，来直接驱使汇率上下波动。

本书力图在对国际最新的外汇理论及其模型分析的基础上。

从外汇市场的微观结构角度出发，如：市场参与者的信息传递、订单流的重要性以及市场主体的预期异质性及其对交易量的影响。

采用交易者的订单流数据，引入信息分散下的无限回归货币均衡模型研究外汇市场的异质性，来解释汇率波动行为从而研究汇率的中短期波动。

后记

这本书的出版是不容易的。

本书作者谢赤为吴晓的研究生阶段指导教师，从1998年起，吴晓师从谢赤教授攻读学位。

2000年后我们合作发表了汇率风险与套期保值领域的学术论文10多篇，吴晓先后取得了经济学硕士和管理学博士学位，论文选题也均与汇率风险套期保值相关。

我们早就想把这些论文整理成著作出版，拖延至今，终于付印，如释重负。

写作从来不是轻而易举的事，种种苦处，对作者而言，自是理当承受，不必细述。

在此要感谢的是那些为本书付出辛劳的人们。

感谢湖南大学的陈收教授、马超群教授、许康教授、曾德明教授和单汨源教授等，他们提出的宝贵修改意见，使得本书得以完善。

还要感谢国防科技大学的汪浩教授和中南大学的王国顺教授等专家的热心指点。

编辑推荐

《人民币汇率行为描述与风险管理(套装共4册)》由湖南人民出版社出版。

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>