



● 首页

关于我们

分类

- 学院简介
- 院长致词
- 学术机构
- 学术顾问委员会
- 教学支撑平台
- 计量经济学研究中心
- 金融研究中心
- 中国劳动经济学与社会
- 现代统计学研究中心
- 中国宏观经济与金融研
- 政治经济学研究中心
- SAS计量经济学合作中
- 行政机构
- 院长办公室
- 高性能计算与数据中心
- 图书资料室
- 高级培训与咨询中心

● 学院人员

● 人才培养

- 专业介绍
  - 劳动经济学
  - 统计学
  - 西方经济学
  - 金融学
  - 数量经济学
- 课程介绍
- 博士后流动站
- 博士研究生
  - 06级博士生
  - 07级博士生
  - 08级博士生
  - 09级博士生
  - 10级博士生
- 硕士研究生
  - 05级硕士生
  - 06级硕士生
  - 07级硕士生
  - 08级硕士生
  - 09级硕士生
  - 10级硕士生
- 本科双学位
- 留学生
  - 08级留学生

● 学生就业

- 2008届毕业生
- 2009届毕业生
- 2010届毕业生

● 学术研究

- 工作论文
- 发表论文
- 研究项目

● 讲座系列

- 本学期讲座日程表
- IZA劳动经济学讲座
  - 本学期
  - 2009秋季
  - 2009春季
  - 2008秋季



首页 - 资源库

## 人民币汇率的半参数预测模型研究

作者: 蔡宗武, 陈琳娜, 方颖 编号: 20100928 被浏览: 1647次

本文已被《系统工程理论与实践》接受, 即将刊出。

摘要: 本文利用从2006年1月4日到2008年7月18日人民币对美元汇率中间价的日均数据, 同时运用非参数函数系数模型和IGARCH模型来分析人民币对美元汇率收益率与波动率的非线性时间序列特征。实证结果表明, 半参数组合模型具有较好的拟合以及预测效果, 而且汇率管制政策变动的虚拟变量的估计系数显著不为0。跨度为25天的样本外预测显示: 96%的收益率真实值都落在2.5%以及97.5%的非参数分位数回归预测线区间之间; 参数GARCH (1,1) 模型拟合的波动率所显示出的汇率震荡与实际情况一致。

关键字: 汇率; GARCH模型; 函数系数模型; 非参数分位数回归

[点击进入下载](#)

上一条: Semiparametric Quant 下一条: A Panel Data Approac

联系方式:

通讯地址: 厦门大学王亚南经济研究院经济楼A308

邮政编码: 361005

联系电话: 86-592-2188827

传 真: 86-592-2187708

电子邮件: wise@xmu.edu.cn

- 2008春季
- 2007秋季
- 高级经济学讲座
  - 本学期
  - 2009秋季
  - 2009春季
  - 2008秋季
  - 2008春季
  - 2007秋季
  - 2007春季
  - 2006
  - 2005
- 青年学者论坛
  - 本学期
  - 2009秋季
  - 2009春季
  - 2008秋季
  - 2008春季
  - 2007秋季
  - 2007春季
- 职业发展讲座
  - 2011春季
  - 2010秋季
  - 2010春季
  - 2009秋季
  - 2009春季
  - 2008秋季
- 午餐学术讲座
- SMU-MAF讲座
  - 本学期
  - 2008秋季
  - 2008春季
- 会议活动
  - 即将举办
  - 已经举办
    - 2010
    - 2009
    - 2008
    - 2007
    - 2006
    - 2005
- 资源库
  - 学生事务表单下载
  - 学术研究网
  - 教学支撑平台
  - 讲座资源平台
  - 教务管理平台
  - 科研管理平台
  - 协同办公平台
  - WISE论坛
  - WISE考研网
  - WISE院刊
  - 厦门风光
- 校企合作
- 人文地理
  - 厦大风光
  - 厦门风光
  - 武夷山
  - 泉州（开元寺、市区、闽台博物馆）
  - 湄洲湾（妈祖庙）
  - 客家土楼
  - 古田会议