



首页
概况
研究机构
学者介绍
成果文库
文献数据
培训教育
对外交流

Search the Web

Find It

您的位置： 首页 → 数技经济研究杂志 → 理论与方法研究

在线单方向外汇兑换问题与风险补偿收益模型

摘要 外汇兑换是现实中的一个典型在线决策问题。在前人研究的基础上，本文针对风险补偿收益模型，考虑预期一旦汇率高过，则在余下的阶段汇率一直不会低于情况下的最优在线兑换策略。文章分析给出了新的在线交易策略和最优的约束竞争比，而后的数值结果表明在新的预期下，最优约束竞争比平均改善程度在70%左右，且发现参数是影响最优约束竞争比的最主要因素。

关键词 单方向外汇兑换 在线算法 竞争分析 预期

地址：北京市建国门内大街5号 邮政编码：100732 电话及传真：010-65125895、010-65137561

版权所有 (c) 中国社会科学院数量经济与技术经济研究所

联系我们 E-mail to: iqte@cass.org.cn