



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

□ 您的位置： 首页 → 数技经济研究杂志 → 现实经济问题研究

汇率预测：一个新的非参数支持向量回归方法

【摘要】 本文利用一个新的非参数支持向量回归（SVR）方法来预测基于非线性ARI模型的汇率时序变量，并且与最大似然法（MLE）和人工神经网络（ANN）的预测结果进行比较。从理论上讲，MLE和ANN方法仅侧重于样本内拟合，而SVR方法则同时考虑了拟合和预测，因此，其预测能力在现有方法中最强大。本文选择中国、韩国、印度和瑞士四种货币的日汇率来进行预测检验，实证结果支持SVR方法具有最强的预测能力。

关键词 支持向量回归 ARI模型 汇率预测 预测精度 嵌套检验

Search the Web

Find It

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