

金融危机背景下的人民币汇率预测

孙,柏,谢赤

收稿日期 修回日期 网络版发布日期 接受日期

摘要 在为金融危机期间人民币汇率的波动提供一种有效的预测方法.在利用替代数据方法检验和判别汇率系统具有非线性结构的基础上,识别了各具体汇率序列的最优滞后期组合,并分别采用了多层感知机(MLP)和层反馈网络(RNN2)结构构建同质神经网络模型,从三个方面对比分析了模型群在不同参数条件下的预测效果.研究发现,根据不同序列的具体特征,各神经网络模型在不同自由度下的4个预测期限内的预测性能存在较明显的差异.同时,包含层反馈过程的RNN2模型在描述与预测人民币汇率的波动方面表现出很强的能力.此外,还分析并解释了产生上述结果的原因,并为4种人民币汇率波动序列甄选出了相应的最优预测模型.

关键词 [最优滞后期](#) [同质神经网络](#) [替代数据方法](#) [RNN2模型](#)

分类号

DOI:

对应的英文版文章: [2009120053](#)

通讯作者:

作者个人主页: 孙,柏,谢赤

扩展功能

本文信息

- ▶ [Supporting info](#)
- ▶ [PDF\(2227KB\)](#)
- ▶ [\[HTML全文\]\(0KB\)](#)
- ▶ [参考文献\[PDF\]](#)
- ▶ [参考文献](#)

服务与反馈

- ▶ [把本文推荐给朋友](#)
- ▶ [加入我的书架](#)
- ▶ [加入引用管理器](#)
- ▶ [引用本文](#)
- ▶ [Email Alert](#)

相关信息

- ▶ [本刊中 包含“最优滞后期”的 相关文章](#)
- ▶ 本文作者相关文章

· [孙](#)
· [柏](#)
· [谢赤](#)