

典型应用

超短期汇率的预测研究

黄巧玲¹; 谢维波¹

华侨大学 信息科学与工程学院¹

收稿日期 2006-9-27 修回日期 网络版发布日期 2007-4-2 接受日期

摘要 提出了一种适合超短期汇率预测的模型方法。实验数据通过网络获取,模型采用的是相空间重构与卡尔曼滤波计算的方法来对超短期汇率数据进行建模和预测,并与BP神经网络模型进行了比较。实验结果表明,所建立的模型方法能很好地跟踪即时汇率变化趋势,预测精度比较高,且算法运行速度比BP神经网络模型快得多。最后,给出了在.NET环境下实现了汇率在线预测的全部过程。

关键词 [超短期汇率预测](#) [数据获取](#) [相空间重构与卡尔曼滤波](#) [在线预测](#)

分类号

DOI:

对应的英文版文章: [6105996](#)

通讯作者:

黄巧玲 huangql7@hqu.edu.cn

作者个人主页: 黄巧玲 谢维波

扩展功能

本文信息

- ▶ [Supporting info](#)
- ▶ [PDF \(808KB\)](#)
- ▶ [\[HTML全文\]\(0KB\)](#)
- ▶ [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](#)
- ▶ [文章反馈](#)
- ▶ [浏览反馈信息](#)

相关信息

- ▶ [本刊中 包含“超短期汇率预测”的相关文章](#)
- ▶ 本文作者相关文章
 - [黄巧玲](#)
 - [谢维波](#)