

图书基本信息

书名：<<中国股市与债市溢出效应的数量研究>>

13位ISBN编号：9787564304935

10位ISBN编号：7564304936

出版时间：2009-12

出版时间：西南交通大学出版社

作者：王璐 著

页数：236

字数：199000

版权说明：本站所提供下载的PDF图书仅提供预览和简介，请支持正版图书。

更多资源请访问：<http://www.tushu007.com>

## 内容概要

本书是从提高金融资源配置效率的角度出发, 研究我国股票市场和债券市场的溢出效应, 探讨这两个市场价格的内在传导机制, 定量化了解它们的互动关系, 认识两个市场的相互作用机理, 探讨目前两个市场资源配置的效率现状及其成因, 为合理协调它们之间的资源配置关系提供理论支持和决策参考。

书籍目录

- 1 绪 论
  1. 1 问题的提出
  1. 2 研究意义
    1. 2. 1 理论意义
    1. 2. 2 现实意义
  1. 3 相关研究成果综述
    1. 3. 1 金融市场溢出效应的研究现状
    1. 3. 2 股市与债市溢出效应的研究现状
    1. 3. 3 国内外研究成果的评述
  1. 4 本书的研究思路及结构安排
- 2 股市与债市溢出效应的基本认识
  2. 1 金融市场溢出效应概念的界定
    2. 1. 1 金融市场溢出效应的基本定义
    2. 1. 2 金融市场溢出效应的内涵
  2. 2 股市与债市溢出效应的理论分析
    2. 2. 1 股市与债市溢出效应的基础分析
    2. 2. 2 股市与债市溢出效应的形成机理
  2. 3 股市、债市溢出效应与金融资源配置效率
    2. 3. 1 效率与金融效率
    2. 3. 2 金融资源配置效率
    2. 3. 3 股市、债市溢出效应和金融资源配置效率的关系
- 3 中国股市与债市波动的基本统计特征
  3. 1 中国股市与债市的发展规模
    3. 1. 1 股市与债市整体规模的对比
    3. 1. 2 股市与债市发行规模的对比
    3. 1. 3 股市与债市交易规模的对比
  3. 2 股市与债市波动的总体特征
    3. 2. 1 中国股市与债市波动的度量
    3. 2. 2 中国股市与债市的波动特征
  3. 3 中国股市与债市收益率的波动特征
    3. 3. 1 收益率波动的基本统计特征对比
    3. 3. 2 收益率序列的平稳性特征对比
    3. 3. 3 收益率序列的自相关性特征对比
    3. 3. 4 收益率序列的非线性特征对比
    3. 3. 5 收益率序列的稳态特征对比
- 4 中国股市与债市溢出效应的存在性研究
  4. 1 股市与债市溢出效应的检验方法
    4. 1. 1 股市与债市溢出效应的测度标准
    4. 1. 2 基于VAR模型的股市与债市的溢出效应
    4. 1. 3 模型的简要评价
  4. 2 股市与债市溢出效应存在性的实证分析
    4. 2. 1 VAR模型在刻画溢出效应存在性的建模步骤
    4. 2. 2 股市与债市溢出效应存在性的VAR检验
    4. 2. 3 对溢出效应存在性的解释分析
  4. 3 股市与债券各子市场溢出效应关系的实证分析

4. 3. 1 研究债券各子市场波动关系的必要性
4. 3. 2 样本数据及基本分析
4. 3. 3 子市场间溢出关系的检验
4. 3. 4 主要结论及分析
- 5 中国股市与债市溢出效应的影响因素研究
5. 1 股市与债市溢出效应影响因素的一般分析
5. 1. 1 市场溢出效应中共变和互变因素的划分
5. 1. 2 共变因素的基本分析：宏观经济变量及相关因素
5. 1. 3 互变因素的基本分析：投资者行为
5. 2 共变因素对股市与债市溢出效应的影响
5. 2. 1 选取因素及变量
5. 2. 2 实证分析
5. 2. 3 结论及相关分析
5. 3 股市与债市溢出效应的互变影响因素——投资者情绪
5. 3. 1 投资者情绪的含义
5. 3. 2 投资者情绪指标的选择
5. 3. 3 投资者情绪与股(债)市波动的相关关系
5. 3. 4 个人与机构投资者情绪和股(债)市波动的相关关系
- 6 中国股市与债市溢出效应的变相关结构研究
6. 1 金融市场相关结构的测度
6. 1. 1 金融市场相关结构测度的基本方法
6. 1. 2 股市和债市相关结构的总体测度
6. 1. 3 总体相关测度的不足
6. 2 股市与债市溢出效应的变相关结构诊断
6. 2. 1 时间序列变点检验：ICSS方法
6. 2. 2 股市和债市溢出效应突变点的检验
6. 2. 3 股市和债市溢出效应变相关结构的初步分析
6. 3 股市与债市变相关结构的门限混合Copula模型
6. 3. 1 Copula模型
6. 3. 2 股市与债市的相关结构：门限混合Copula模型
6. 3. 3 实证分析及结果
6. 4 股市与债市变相关结构的分析及启示
- 7 中国股市与债市溢出效应的聚集性研究
7. 1 MV-GARCH模型对金融市场溢出效应的刻画
7. 1. 1 ARCH/GARCH模型及局限
7. 1. 2 MV-GARCH模型与溢出效应
7. 1. 3 模型评述
7. 2 股市与债市溢出效应聚集性的MV-GARCH模型
7. 2. 1 溢出效应与聚集性特征
7. 2. 2 基于BEKK模型的溢出效应聚集特征
7. 3 溢出效应聚集性的实证分析
7. 3. 1 样本数据及基本检验
7. 3. 2 模型的参数估计
7. 3. 3 模型比较及选择
7. 3. 4 主要结论及分析
- 参考文献



版权说明

本站所提供下载的PDF图书仅提供预览和简介, 请支持正版图书。

更多资源请访问:<http://www.tushu007.com>