



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

股票市场波动性的国际比较研究

内容摘要：比较分析了纽约、伦敦、东京以及上海四个证券交易所市场的波动情况。在分析方法上，采用了广义误差分布假定的ARMA-EGARCH-M模型，以捕捉收益率分布的高峰厚尾和波动集群特征。上海股市与世界主要股市相比波动性较高的原因有两个，一是新信息冲击更加集中而强烈，二是上海股市对信息冲击的吸收能力较差。本文讨论了造成以上原因的若干影响因素。

关键词：股市波动性；EGARCH模型；广义误差分布

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