

[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](#)

Search the Web

Find It

□ 您的位置： [首页](#) → [数技经济研究杂志](#) → [现实经济问题研究](#)

沪、深、港股市信息溢出效应与动态相关性——基于DCC-(BV) EGARCH-VAR的检验

【摘要】 本文将收益与波动作为刻画股市信息的代理变量，将沪市(深市)受到的收益和波动冲击分解为来自自身的“本地因素”，来自深市(沪市)的“区域因素”(作为内生变量引入)和来自港市的“世界因素”(作为外生变量引入)，首次将DEC-(BV)EGARCH-VAR的方法引入对沪、深、港三地股票市场收益和波动溢出效应与动态相关性研究。

关键词 收益与波动溢出 动态相关性 DCC-(BV) EGARCH-VAR