

全部文章

现在时间

您的位置: 首页 - 财贸经济摘要

我国股票市场收益、交易量、波动性动态关系的实证分析(2003年第12期)

作者: 华仁海 丁秀玲 发布时间: 2004-7-4 17:56:37

内容提要: 本文对我国股票市场上证指数和深圳成指的收益、交易量、波动性之间的动态关系进行了实证研究, 研究表明: 收益和绝对收益与交易量之间均存在正相关关系; 收益与交易量以及绝对收益与交易量之间存在双向Granger 因果关系(线性或非线性); 深圳成指收益的波动方差对收益具有正向作用, 而上证指数收益的波动方差对收益没有直接的影响; 上证指数和深圳成指的成交量对股指收益的波动方差不具有解释作用。

关键词: 股票市场 收益 交易量 波动性

作者简介: 华仁海, 南京财经大学金融学系副主任、副教授, 210003;

丁秀玲, 南京财经大学工商管理系副教授, 210003。

中图分类号: F832.5 文献标识码: A 文章编号: 1002—8102 (2003) 12 —00 —05

[\[推荐朋友\]](#) [\[关闭窗口\]](#) [\[回到顶部\]](#)

转载务经授权并请刊出本网站名

版权所有: 中国社会科学院人口与劳动经济研究所

您是第位访客