

全部文章

现在时间

立即搜索

您的位置: 首页 - 财贸经济摘要

A 股H 股收益率和波动率研究(2003年第12期)

作者: 李大伟 朱志军 陈金贤 发布时间: 2004-7-4 17:58:54

内容提要: H 股作为中国证券市场的一个有效补充, 对中国吸引外资, 促进国外投资者了解中国企业起到了极大的作用。考虑到H 股市场得到信息的快捷性和准确性, 本文重点研究了A 股和H 股之间收益率和波动率的关系, 根据A 股和B 股相关研究和最后数据实证分析我们发现A 股和H 股两个市场的收益率并没有显著差异, 然而H 股的波动率确显著高于A 股的波动率。而后对造成此结果的原因也进行了一些分析。

关键词 H 股 A 股 收益率 波动率

作者简介: 李大伟, 西安交通大学管理学院管理科学系博士生, 710049;

朱志军, 西安交通大学管理学院管理科学系博士生, 710049;

陈金贤, 西安交通大学教授, 博士生导师, 710049 。

中图分类号: F830 文献标识码: A 文章编号: 1002—8102(2003)12—00—03

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

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