

《股票价格波动特征及影响因素分析：信息传递视角》

书籍信息

版次：1

页数：

字数：

印刷时间：2015年05月01日

开本：16开

纸张：胶版纸

包装：平装

是否套装：否

国际标准书号ISBN：9787514156850

内容简介

对于股票价格波动的研究是近30年来现代微观金融学中最为活跃的一个领域。本书基于结构向量自回归模型、事件研究法及GARCH族等方法，从多方面分析了股票市场价格变动在不同影响因素下的市场反应，一方面通过分析股票市场发展与经济增长相互之间的关联强度，对二者之间相关性的表现特征及其内在规律进行了探究；另一方面研究了股票市场之间、股票市场与汇率市场之间、股票市场与商品期货市场之间信息传导对股票价格波动的影响；同时验证了我国股票市场价格波动受到来自特定事件冲击下的市场反应，为股票市场价格波动的研究提供了一条可行路径。

目录

第一章 导论

第一节 研究背景

第二节 研究目的和意义

一、研究目的

二、研究意义

第三节 国内外研究现状及评析

一、股票价格波动特征研究

二、股票价格的量价关系研究

三、股票市场与宏观经济关系的研究

四、股票价格信息传导及波动溢出效应研究

第四节 研究内容与结构安排

第五节 研究方法

第六节 研究的创新之处

第二章 我国股票市场发展现状及价格波动的理论基础

第一节 导论

第二节 研究目的和意义

一、研究目的

二、研究意义

第三节 国内外研究现状及评析

一、股票价格波动特征研究

二、股票价格的量价关系研究

三、股票市场与宏观经济关系的研究

四、股票价格信息传导及波动溢出效应研究

第四节 研究内容与结构安排

第五节 研究方法

第六节 研究的创新之处

第二章 我国股票市场发展现状及价格波动的理论基础

第一节 我国股票市场发展现状

第二节 股票市场资产价格波动的理论基础

一、混合分布假说与连续信息到达假说

二、汇率传递的股票价格波动理论

三、市场信息传导与波动溢出效应

第三节 本章小结

第三章 股票市场资产价格波动的基本特征

第一节 股票市场资产价格波动特征基本统计分析

一、样本的选择与数据的处理

二、股票市场资产价格波动特征的统计描述分析

三、股票市场资产价格收益率波动特征的统计描述

第二节 股票市场资产价格波动的自相关与波动聚集特征检验

一、股票市场资产价格波动的自相关检验

二、股票市场资产价格波动的波动聚集特征检验

第三节股票市场资产价格的非对称性检验 第四节本章小结

第四章股票市场资产价格波动影响因素的分析

第一节股票市场资产价格波动的影响因素的结构与界定 一、外部宏观经济因素

二、内部微观经济因素 三、市场交易因素 四、信息传导因素 五、非经济因素

第二节股票市场资产价格波动的影响因素分析 一、宏观经济因素 二、微观经济因素

三、信息传导因素 四、制度因素 第三节本章小结

第五章宏观经济变量与股票价格波动之间的关系：来自山西板块的检验

第一节宏观经济变量与股票价格波动关系的理论分析 第二节研究方法设计与变量的选择

一、研究方法设计 二、变量的选择和数据的处理

第三节山西省经济增长与股票市场发展关系的实证分析 一、单位根检验 二、协整检验

三、误差修正模型的建立 四、Granger因果关系检验 第四节研究结论与分析

第五节本章小结第六章特定事件对股票价格波动的影响

第一节特定事件对股票价格波动影响的机理分析 第二节研究方法设计

第三节变量的选择和数据的处理 一、变量的选择 二、样本数据处理

第四节特定事件对股票价格波动影响的实证分析

一、特定事件影响下股票价格超额收益率与累积平均日超额收益率

二、中国零售业股票节日效应的平均累积异常值及显著性检验 第五节研究结论与分析

第六节本章小结第七章信息传导因素对股票价格波动的影响

第一节信息传导因素对股票价格波动的影响机理 第二节模型与方法的导入 一、协整分析

二、Granger因果关系分析 三、VAR—GARCH(1,1)—BEKK模型导入

第三节变量的选择和数据的处理 一、变量的选择 二、数据的处理

第四节信息传导因素对股票价格波动影响的实证分析

一、股票市场间信息传导对股票价格波动影响的实证分析

二、外汇市场信息传导对股票价格波动影响的实证分析

三、商品期货市场信息传导对股票价格波动影响的实证分析 第五节研究结论与分析

第六节本章小结第八章研究结论及政策建议 第一节研究结论 第二节政策建议

第三节研究的不足之处及有待进一步研究的问题译名对照表附录参考文献后记

[显示全部信息](#)

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www.tushupdf.com](http://www.tushupdf.com)