

<<实证统计分析>>

图书基本信息

书名：<<实证统计分析>>

13位ISBN编号：9787500544173

10位ISBN编号：7500544170

出版时间：1999-11

出版时间：中国财政经济出版社

版权说明：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：<http://www.tushu007.com>

## &lt;&lt;实证统计分析&gt;&gt;

## 书籍目录

## 目录

第一章 中国股市的基本统计分析.....1	1
1.1 中国证券市场的规范化进程.....2	2
1.1.1 证券市场监管体制.....3	3
1.1.2 证券市场法制建设.....6	6
1.2 数据的整理及指标定义.....12	12
1.2.1 数据的收集与处理.....12	12
1.2.2 指标定义.....14	14
1.3 我国股市的基本统计特征分析.....21	21
1.3.1 基本统计量.....21	21
1.3.2 基本统计性质的实证分析.....23	23
1.4 收益率的日历影响分析.....46	46
1.4.1 日历影响分析.....47	47
1.4.2 周内各日收益序列基本统计量的分析.....50	50
1.4.3 周内各日收益序列的自相关特征.....54	54
1.4.4 周内各日收益序列的相依关系分析.....55	55
1.5 股市交易的量价分析.....61	61
1.5.1 交易量数据的基本统计特征.....61	61
1.5.2 量价关系分析.....64	64
1.6 小结.....72	72
第二章 中国股市风险特征分析.....74	74
2.1 风险的基本概念.....74	74
2.1.1 系统风险与非系统风险.....75	75
2.1.2 风险的度量工具.....75	75
2.2 沪深股市的风险波动特征.....79	79
2.2.1 样本的选取及深沪股市风险的基本特征.....79	79
2.2.2 股市共同风险与收益的关系.....86	86
2.2.3 不同序列条件异方差的共动性.....88	88
2.3 股市共同风险的分析.....89	89
2.3.1 因子 GARCH模型及其建模.....89	89
2.3.2 计算结果的实证分析.....94	94
2.3.3 因子的时变特征.....96	96
2.4 小结.....98	98
第三章 股市与宏观经济基本面的关系.....99	99
3.1 概述.....99	99
3.2 宏观经济景气指标与股市的关系.....101	101
3.2.1 宏观经济景气指标与股市关系的统计描述...102	102
3.2.2 宏观经济景气指标与股市关系的基本统计分析104	104
3.2.3 沪深股市与宏观经济景气关系的进一步分析 . 111	111
3.3 小结.....118	118
第四章 上市公司财务的统计分析.....119	119
4.1 上市公司财务的基本统计特征.....119	119
4.1.1 经营业绩的行业差异.....119	119
4.1.2 经营业绩的地区差别.....121	121
4.1.3 经营业绩与公司上市时间的关系.....123	123

## &lt;&lt;实证统计分析&gt;&gt;

4.1.4 深沪上市公司业绩对比.....	124
4.2 上市公司财务分析.....	127
4.2.1 上市公司财务报表分析.....	127
4.2.2 上市公司财务比较分析.....	135
4.2.3 上市公司财务的多元统计分析方法.....	139
4.3 小结.....	143
第五章 股票投资选择的分析.....	144
5.1 投资组合选择的基本理论.....	144
5.1.1 马柯维茨投资组合原理.....	146
5.1.2 方差—均值准则.....	147
5.1.3 有效组合的构造.....	149
5.1.4 最优投资组合的选择.....	151
5.1.5 投资组合的实证分析.....	152
5.2 投资组合与风险的分散化.....	157
5.2.1 市场模型与风险的分散化.....	157
5.2.2 关于我国股市系统风险和非系统风险的 实证分析.....	160
5.3 组合规模分析.....	161
5.3.1 组合规模研究的背景.....	162
5.3.2 对我国股市组合规模的实证分析.....	163
5.3.3 关于我国股市组合规模的评述.....	169
5.4 小结.....	169
第六章 中国股市与国际部分股市的比较分析.....	171
6.1 数据来源和市场及证券指数的选取.....	171
6.2 各证券市场基本统计特征的比较.....	173
6.2.1 市场规模和活跃性的统计分析.....	173
6.2.2 基本统计特征的比较分析.....	174
6.3 价格和波动强度非对称性调整的比较研究.....	186
6.3.1 模型的选取.....	186
6.3.2 价格部分调整模型.....	188
6.3.3 价格和波动强度非对称性的实证分析.....	191
6.4 小结.....	199
参考文献.....	200
后记.....	202

版权说明

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:<http://www.tushu007.com>