

图书基本信息

书名：<<中国股市与债市溢出效应的数量研究>>

13位ISBN编号：9787564304935

10位ISBN编号：7564304936

出版时间：2009-12

出版时间：西南交通大学出版社

作者：王璐 著

页数：236

字数：199000

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>

## 内容概要

本书是从提高金融资源配置效率的角度出发,研究我国股票市场和债券市场的溢出效应,探讨这两个市场价格的内在传导机制,定量化了解它们的互动关系,认识两个市场的相互作用机理,探讨目前两个市场资源配置的效率现状及其成因,为合理协调它们之间的资源配置关系提供理论支持和决策参考。

## 书籍目录

- 1 绪 论
  - 1.1 问题的提出
  - 1.2 研究意义
    - 1.2.1 理论意义
    - 1.2.2 现实意义
  - 1.3 相关研究成果综述
    - 1.3.1 金融市场溢出效应的研究现状
    - 1.3.2 股市与债市溢出效应的研究现状
    - 1.3.3 国内外研究成果的评述
  - 1.4 本书的研究思路及结构安排
- 2 股市与债市溢出效应的基本认识
  - 2.1 金融市场溢出效应概念的界定
    - 2.1.1 金融市场溢出效应的基本定义
    - 2.1.2 金融市场溢出效应的内涵
  - 2.2 股市与债市溢出效应的理论分析
    - 2.2.1 股市与债市溢出效应的基础分析
    - 2.2.2 股市与债市溢出效应的形成机理
  - 2.3 股市、债市溢出效应与金融资源配置效率
    - 2.3.1 效率与金融效率
    - 2.3.2 金融资源配置效率
    - 2.3.3 股市、债市溢出效应和金融资源配置效率的关系
- 3 中国股市与债市波动的基本统计特征
  - 3.1 中国股市与债市的发展规模
    - 3.1.1 股市与债市整体规模的对比
    - 3.1.2 股市与债市发行规模的对比
    - 3.1.3 股市与债市交易规模的对比
  - 3.2 股市与债市波动的总体特征
    - 3.2.1 中国股市与债市波动的度量
    - 3.2.2 中国股市与债市的波动特征
  - 3.3 中国股市与债市收益率的波动特征
    - 3.3.1 收益率波动的基本统计特征对比
    - 3.3.2 收益率序列的平稳性特征对比
    - 3.3.3 收益率序列的自相关性特征对比
    - 3.3.4 收益率序列的非线性特征对比
    - 3.3.5 收益率序列的稳态特征对比
- 4 中国股市与债市溢出效应的存在性研究
  - 4.1 股市与债市溢出效应的检验方法
    - 4.1.1 股市与债市溢出效应的测度标准
    - 4.1.2 基于VAR模型的股市与债市的溢出效应
    - 4.1.3 模型的简要评价
  - 4.2 股市与债市溢出效应存在性的实证分析
    - 4.2.1 VAR模型在刻画溢出效应存在性的建模步骤
    - 4.2.2 股市与债市溢出效应存在性的VAR检验
    - 4.2.3 对溢出效应存在性的解释分析
  - 4.3 股市与债券各子市场溢出效应关系的实证分析

- 4.3.1 研究债券各子市场波动关系的必要性
- 4.3.2 样本数据及基本分析
- 4.3.3 子市场间溢出关系的检验
- 4.3.4 主要结论及分析
- 5 中国股市与债市溢出效应的影响因素研究
  - 5.1 股市与债市溢出效应影响因素的一般分析
    - 5.1.1 市场溢出效应中共变和互变因素的划分
    - 5.1.2 共变因素的基本分析：宏观经济变量及相关因素
    - 5.1.3 互变因素的基本分析：投资者行为
  - 5.2 共变因素对股市与债市溢出效应的影响
    - 5.2.1 选取因素及变量
    - 5.2.2 实证分析
    - 5.2.3 结论及相关分析
  - 5.3 股市与债市溢出效应的互变影响因素——投资者情绪
    - 5.3.1 投资者情绪的含义
    - 5.3.2 投资者情绪指标的选择
    - 5.3.3 投资者情绪与股(债)市波动的相关关系
    - 5.3.4 个人与机构投资者情绪和股(债)市波动的相关关系
- 6 中国股市与债市溢出效应的变相关结构研究
  - 6.1 金融市场相关结构的测度
    - 6.1.1 金融市场相关结构测度的基本方法
    - 6.1.2 股市和债市相关结构的总体测度
    - 6.1.3 总体相关测度的不足
  - 6.2 股市与债市溢出效应的变相关结构诊断
    - 6.2.1 时间序列变点检验：ICSS方法
    - 6.2.2 股市和债市溢出效应突变点的检验
    - 6.2.3 股市和债市溢出效应变相关结构的初步分析
  - 6.3 股市与债市变相关结构的门限混合Copula模型
    - 6.3.1 Copula模型
    - 6.3.2 股市与债市的相关结构：门限混合Copula模型
    - 6.3.3 实证分析及结果
  - 6.4 股市与债市变相关结构的分析及启示
- 7 中国股市与债市溢出效应的聚集性研究
  - 7.1 MV-GARCH模型对金融市场溢出效应的刻画
    - 7.1.1 ARCH / GARCH模型及局限
    - 7.1.2 MV-GARCH模型与溢出效应
    - 7.1.3 模型评述
  - 7.2 股市与债市溢出效应聚集性的MV-GARCH模型
    - 7.2.1 溢出效应与聚集性特征
    - 7.2.2 基于BEKK模型的溢出效应聚集特征
  - 7.3 溢出效应聚集性的实证分析
    - 7.3.1 样本数据及基本检验
    - 7.3.2 模型的参数估计
    - 7.3.3 模型比较及选择
    - 7.3.4 主要结论及分析
- 参考文献



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>