

[首页](#)[概况](#)[研究机构](#)[学者介绍](#)[成果文库](#)[文献数据](#)[培训教育](#)[对外交流](#)

Search the Web

Find It

 您的位置： [首页](#) → [数技经济研究杂志](#) → [现实经济问题研究](#)

金融市场协同波动溢出分析及实证研究

【摘要】对于动态投资组合与风险管理来说，测定金融市场之间的波动溢出是非常重要的。在已有的文献中往往是研究两个金融市场之间是否存在波动溢出，多个金融市场对一个金融市场的协同波动溢出则未提及。本文使用独立成分分析(ICA)来消除多个金融市场波动之间的相关性，使用GARCH模型研究多个金融市场对一个金融市场的协同波动溢出，并进行了实证分析。

关键词 独立成分分析(ICA) 金融市场 协同波动溢出 GARCH模型

地址：北京市建国门内大街5号 邮政编码：100732 电话及传真：010-65125895、010-65137561

版权所有 (c) 中国社会科学院数量经济与技术经济研究所

联系我们 E-mail to: iqte@cass.org.cn