

Koronakriisin vaikutus osakemarkkinoiden volatiliteettiin (aihe-esittely)

Eero Heimonen

10.5.2021

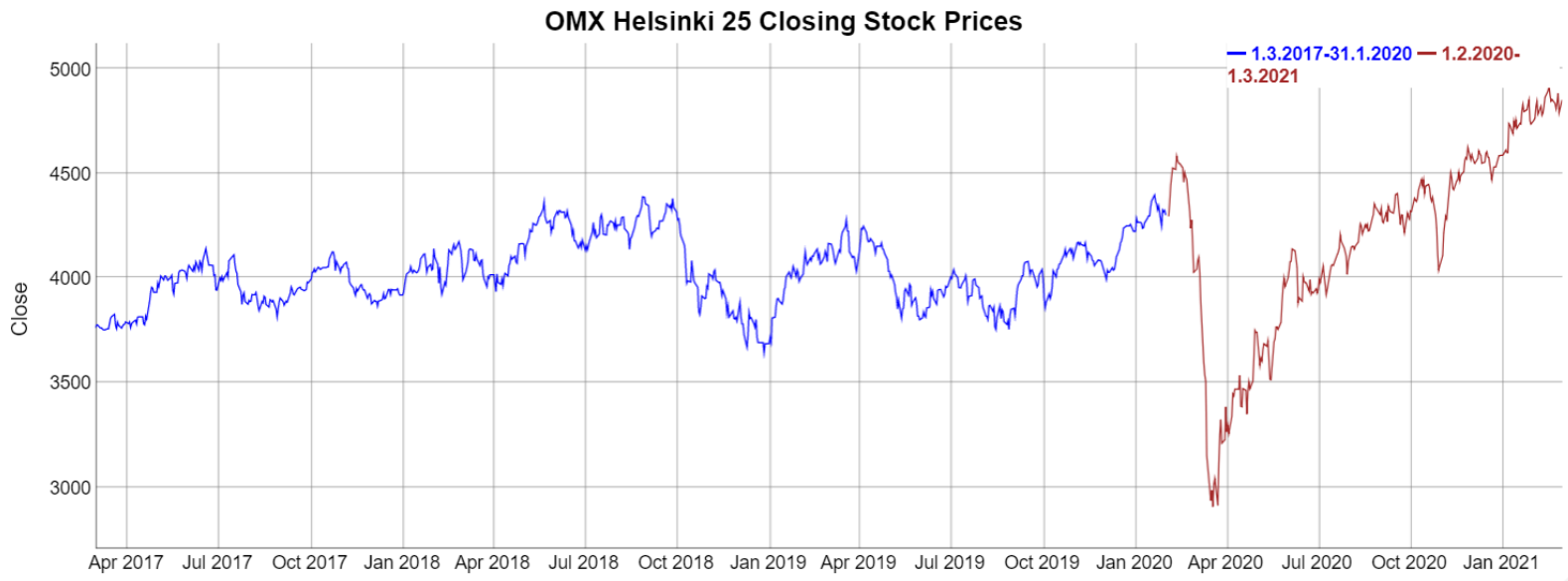
Ohjaaja: *Pauliina Ilmonen*

Valvoja: *Pauliina Ilmonen*

Työn saa tallentaa ja julkistaa Aalto-yliopiston avoimilla verkkosivuilla. Muilta osin kaikki oikeudet pidätetään.

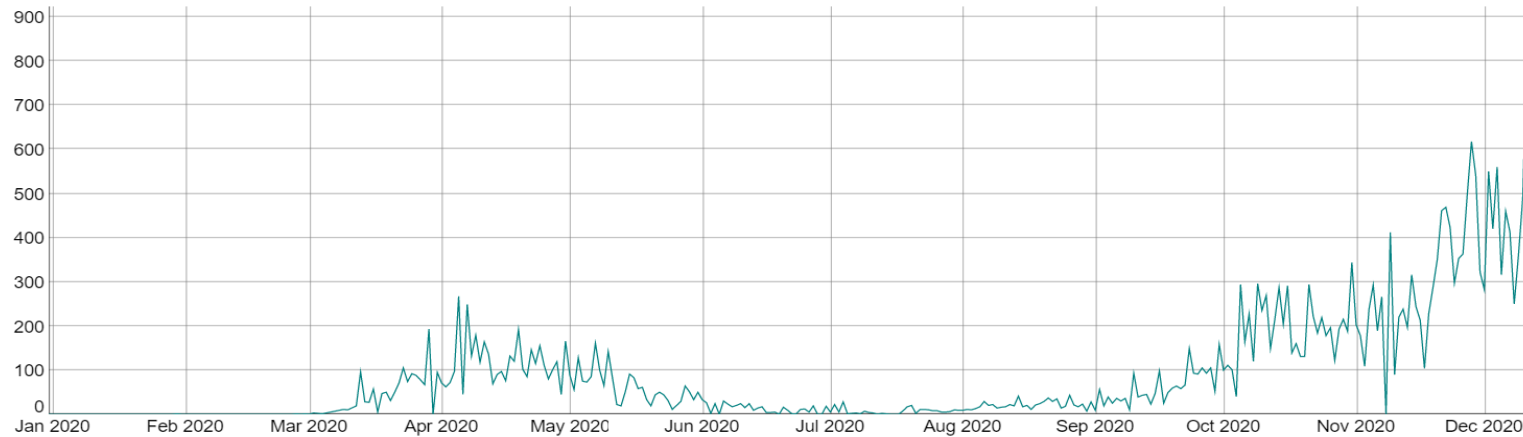
Tausta 1/2

- Koronakriisi on vaikuttanut maailman taloustilanteeseen valtavasti.

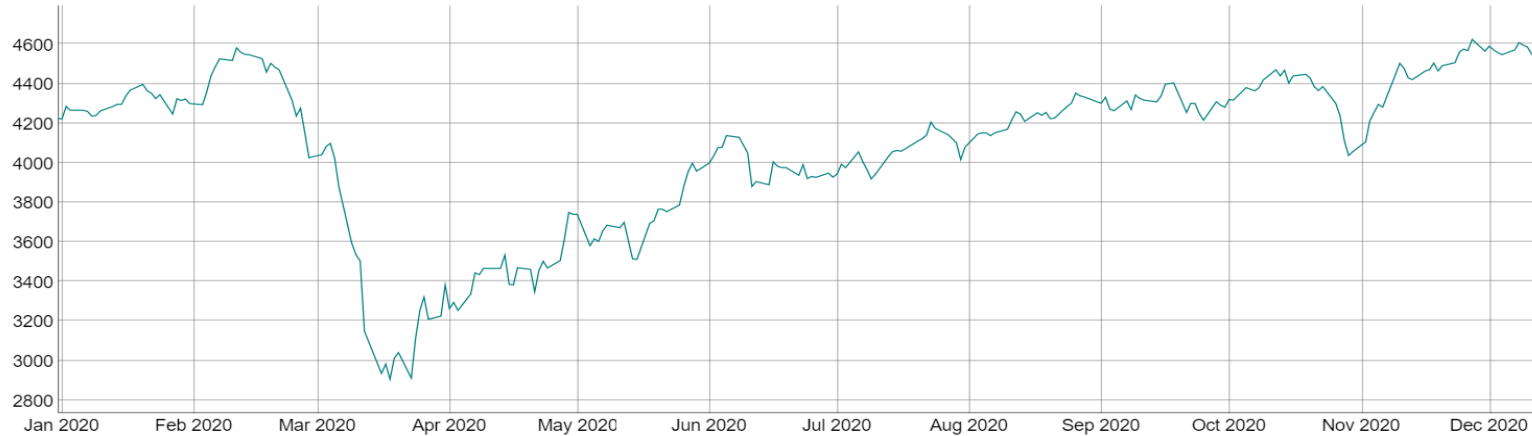


Tausta 2/2

Finland Cases



OMX Helsinki 25 closing price



Tavoite

- Lasketaan eri markkinaindeksien volatiliteettejä
- Tarkastellaan koronatapauksien ja kuolemien vaikutusta kansainvälisesti isoimpien markkinaindeksien volatiliteettiin
- Kuvaajien perusteella tutkitaan pandemiaan liittyviä ilmiöitä, jotka ovat voineet vaikuttaa osakemarkkinoiden käyttäytymiseen
 - Esim. Ensimmäisen aallon vaikutus indekseihin verrattuna toisen aallon vaikutukseen
- Toteutetaan riippumattomuustestaus tapausmäärien ja indeksien volatiliteettien välillä

Rajaukset

- Tarkastellaan vain viiden maan koronatapauksia
- Kyseisistä maista tarkastellaan pelkästään maan seuratuinta markkinaindeksiä
- Valitut maat ovat Yhdysvallat, Iso-Britannia, Saksa, Japani ja Suomi

Aineistot

- European Centre for Disease Prevention and Control
- World Health Organization
- The Wall Street Journal

Työkalut

- R

Aikataulu

- Lähteisiin ja aineistoon tutustuminen 04/2021
- Taustatietojen kirjoittaminen 04/2021
- Kuvaajien tekeminen korona-aineistosta, markkinaindekseistä ja niiden volatiliteeteistä 04/2021
- Aiheen esittely 05/2021
- Tilastollinen päättely 05/2021
- Tulosten raportointi 05/2021
- Valmis työ 06/2021