**NSD/CCER Workshop**

**计量经济学和大数据分析 Econometrics and Big Data Analysis**

**2018 年秋季**

北京大学国家发展研究院 **沈艳 黄卓**

时间：周五 9:00am -10:30am

地点：TBA

**研究方向：**

本学期的研究内容主要集中在（但不限于）以下研究方向.

1. 基于大数据的预测（forecasting）的基本原理和方法
2. 宏观不确定性和金融市场 （macroeconomic uncertainty）
3. 投资者情绪测度与分析（investor sentiment）
4. 金融中的文本分析 （textual analysis in finance）
5. 波动率建模和期权定价（volatility modelling and option pricing）
6. 高频金融数据 （high frequency data）
7. 机器学习 (machine learning)

**主要形式：**

采用外部专家演讲与内部师生演讲两种形式相结合。学生可以选择报告自己的研究进展或者讲解经典和前沿论文。每次1-2人主讲，全部参与人进行讨论。预计本学期外部专家演讲、经典和前沿论文精读复制、研究进展报告各占三分之一。同时鼓励同学们按课题组成研究小组进行学习。

**参与对象：**

对计量经济学、金融计量、大数据分析等领域感兴趣的校内外老师和同学。

**要求：**

1. **第一次见面会定于9月21日（周五 9:00-10:30，第一次地点在国发院致福轩会议室）**。将确定一学期的演讲安排和syllabus。
2. 每次的主讲人要提前做好准备，至少提前三天将完整的文章发给所有参与者以便提前阅读。
3. Workshop重在参与，希望能积极参与每一次讨论。
4. 如果想要参与，前将姓名、学号、学校、专业、年级、手机、电子邮箱发给zhuohuang@nsd.pku.edu.cn。
5. 需要获得学分和希望认真参与的同学要求做1到2次论文报告。每次30-45分钟。