

NSD/CCER Workshop——Econometrics and Financial Econometrics

2015 年春季 主持老师：黄卓 沈艳

时间：周三 12:05pm -14:00pm

地点：朗润园万众楼一楼小教室

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. 预测（forecasting）的基本原理和方法
2. 股市收益率的可预测性（Predictability of stock returns）
3. 波动率和相关性预测（Forecasting volatility and correlation）
4. 动态金融高阶矩预测（Forecasting higher moments of financial returns）
5. 面板数据的计量经济学（Panel Data Econometrics）
6. 政策评估（Program Evaluation）

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：

对金融学或计量经济学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 3 月 11 日。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、希望认真参与的同学要求做一到两次论文报告。每次 30-45 分钟。打酱油的同学也欢迎旁听，但请提前告诉黄卓老师。