

NSD/CCER Workshop——实证金融学和金融计量学

2014 年春季 主持老师：黄卓

时间：

地点：

研究方向：

实证金融学（empirical finance）和金融计量学(financial econometrics)相互关联但侧重点不同。实证金融学侧重于研究金融学中的问题，用计量经济学作为工具，通常以问题为导向。金融计量学侧重于研究适用于金融研究的计量方法，通常以方法为导向。

本学期的研究内容主要集中在（但不限于）以下四个研究方向。

1. 基于高频数据的波动率（Volatility）和相关性(Correlation)模型
2. 金融市场的实证研究（Empirical Study on the Financial Markets）
3. 期权定价（Options Pricing）
4. 能源和大宗商品期货市场（Energy and Commodity Markets）

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、第一次讨论定于 。将确定一学期的演讲安排和 syllabus；余下时间组员简单报告研究进程和本学期的研究安排。
- 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。