

## NSD/CCER Workshop——Financial Econometrics and Empirical Finance

2016 年春季

北京大学国家发展研究院 黄卓

时间：周四 14:00pm -16:00pm

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 market）
3. 波动率和相关性建模（Volatility and correlation modelling）
4. 波动率风险溢价动态（Variance risk premium）
5. 波动率传导和溢出效应（Volatility transmission and spillover）
6. 高频金融数据（High frequency data）

### 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：

对金融计量和实证金融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 3 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](mailto: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，但请提前告诉我。