

馬學立業  
厚德惠人



▶ 教师个人信息

▶ 科研成果

▶ 学术活动及社会服务

▶ 色彩空间

## 范龙振

教授

财务金融系

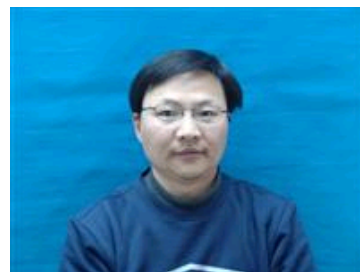
思源教授楼202室

25011093(TEL)

65648384(FAX)

lzfan@fudan.edu.cn

研究方向：资产定价理论，固定收益证券，资本市场实证分析



### 教育背景：

1997.05, 博士, 管理工程, 华中理工大学

### 学术经历：

2009.07--2009.08, 访问学者, 香港科技大学

2005.07--2005.08, 访问学者, 香港科技大学

2004.08--2004.10, 访问学者, 香港科技大学

2002.10--2002.11, 访问学者, 日本立正大学

1999.01--1999.06, 访问学者, 美国麻省理工学院斯隆管理学院

### 科研获奖：

2010.12, 上海市第十届哲学社会科学优秀成果奖论文类, 三等奖, 上海市哲学社会科学优秀成果评奖委员会

2008.11, 复旦大学复华奖教金文科科研成果个人奖, 复旦大学

### 教学获奖：

, 2005年度上海市教学成果奖三等奖, 上海市教育委员会

### 荣誉称号：

2006.01, 新世纪优秀人才支持计划, 教育部

### 期刊论文：

1. Fan, Longzhen, Yihong Yu, and Chu Zhang. 2011. An empirical evaluation of China's monetary policies. *Journal of Macroeconomics* 33(2) 358-371.
2. Longzhen Fan, Anders C. Johansson. 2010. China's Official Rates and Bond Yields. *Journal of Banking & Finance* Vol.34(5) 996-1007.
3. Longzhen Fan, Chu Zhang. 2007. Beyond segmentation: The case of China's repo

- markets. *Journal of Banking & Finance* vol.31 939-954.
4. 范龙振、Chu Zhang. 2006. The Chinese Interbank Repo Market: An Analysis of Term Premiums. *Journal of Futures Markets* vol.26(2) 153-167.
  5. 范龙振. 以1年期储蓄存款利率为状态变量的跳跃型广义Vasicek模型. *管理科学学报*, 2010, vol.13(10): 69-78.
  6. 范龙振. 一类均值随机跳跃型广义Vasicek模型. *系统工程学报*, 2010, vol.25(4): 467-472.
  7. 范龙振, 张处. 中国债券市场债券风险溢酬的宏观因素影响分析. *管理科学学报*, 2009, Vol.12(6): 116-124.
  8. 范龙振. 短期利率模型在上交所债券市场上的实证分析. *管理科学学报*, 2007, vol.10(2): 80-89.
  9. 范龙振. 银行间市场回购利率变化的利率模型解释. *系统工程学报*, 2007, vol.22(1): 27-34.
  10. 范龙振, 施婷. 上海证券交易所回购利率期限结构的风险溢酬. *系统工程理论方法应用*, 2006, vol.15(4): 359-363, 372.
  11. 朱才敏, 范龙振. 流动性与交易所市场回购利率. *上海管理科学*, 2006, (4): 34-37.
  12. 范龙振, 张国庆. 两因子CIR模型对上交所利率期限结构的实证研究. *系统工程学报*, 2005, vol.20(5): 447-453.
  13. 范龙振, 张国庆. 仿射模型、广义仿射模型与上交所利率期限结构. *管理工程学报*, 2005, vol.19(3): 97-101.
  14. 范龙振. 上交所利率期限结构的三因子广义高斯仿射模型. *管理工程学报*, 2005, vol.19(1): 81-86.
  15. 范龙振. 广义仿射模型在上交所债券市场的实证分析. *系统工程学报*, 2004, vol.19(6): 638-642.
  16. 范龙振, 单耀文. 交易额、A股比例、势效应和三因子模型. *管理科学学报*, 2004, 7(3): 13-22.
  17. 范龙振, 王海涛. 中国股票市场行业与地区效应分析. *管理工程学报*, 2004, vol.18(1): 117-119.
  18. 范龙振, 王晓丽. 上交所国债市场利率期限结构及其信息价值. *管理工程学报*, 2004, vol.18(1): 72-75.
  19. 范龙振, 王海涛. 上海股票市场股票收益率因素研究. *管理科学学报*, 2003, vol.6(1): 60-67.
  20. 范龙振, 余世典. 中国股票市场的三因子模型. *系统工程学报*, 2002, vol.17(6): 537-546.
  21. 范龙振, 胡畏. 深圳股市价格运动可预测性的研究. *系统工程学报*, 2001, vol.16(6): 475-480.
  22. 叶峰, 范龙振, 陈辰. 复合打包型衍生证券: 日本New Wave基金的定价研究. *管理工程学报*, 2001, vol.15(4): 31-33.
  23. 陈辰, 范龙振, 叶峰. 指数证券组合模拟市场指数的聚类 and MTV方法. *管理工程学报*, 2001, vol.15(4): 23-27.
  24. 叶峰, 范龙振. 汇率可预测性实证分析. *管理工程学报*, 2001, (7): 42-45.
  25. 范龙振, 陈辰. 转配股上市对我国股市影响的事件研究. *复旦学报(自然科学版)*, 2001, vol.40(2): 220-227.

---

#### 会议/研讨会论文:

1. Fan Long-Zhen Li Wan-Jun. 2008. The Factors that Affect Market Interest Rates in Chinese Bond Market. *IEEE* 1-5.
2. Fan, Longzhen. 2007. Official interest rate and bond excessreturn in chinese bond market. .
3. FAN Longzhen, LIU Qiwen. 2007. Relation between interest rate difference and trading volume difference in chinese inter-bank money market. 260-266.
4. 范龙振. 2005. Modelling Risk Premium of Repo Interest Rate in the SSE. 3463-3468.
5. 范龙振, 劳兰珺. 2004. An Empirical Comparison of Alternative Models of Short Interest Rate With Repo Rate in The Inter-Bank Market of China. 2736-2742.
6. Lan-Jun Lao, Long-Zhen Fan. 2004. A Hierarchical Strategy for Active Portfolio Management Considering Transaction Costs. vol.5 .

---

#### 教材和其他:

- 范龙振. 投资学. 中国上海: 上海财经大学出版社, 2005.  
范龙振, 胡畏. 金融工程学. 上海: 上海人民出版社, 2003.

---

#### 科研项目：

2010.01—2012.12, 项目负责人, 官方利率影响下的利率期限结构模型和债券定价研究, 国家自然科学基金面上项目

2005.05—2007.12, 项目负责人, 具有关联性的多个市场中的固定收益定价模型体系研究, 国家自然科学基金面上申请项目

---

#### 学术任职：

2000.01—2010.01, 编委, 系统工程学报