



## 陈蓉个人简介



陈蓉

女 金融系 教授 博导

厦门大学金融系金融工程教授、博导。

研究方向与研究兴趣：金融工程、固定收益证券、风险管理、金融计量、资产定价。

联系方式

办公室：经济学院B-105 时间：周二下午4:30—6:30

电话：

电子邮件：aronge@xmu.edu.cn

### 主要研究与教学领域

金融工程、固定收益证券、风险管理、金融计量、资产定价

### 工作经历

2009至今 厦门大学金融系 金融工程 教授、博导

2006-2009 厦门大学金融系 金融工程 副教授

2003-2006 厦门大学金融系 金融工程 讲师

### 教育经历

2000-2003 厦门大学 金融系 金融学 博士

1997-2000 厦门大学 财政金融系 金融学 硕士

1993-1997 厦门大学 财政金融系 国际金融 本科

### 海外学习经历

2005.8-2006.5, 美国康奈尔大学经济学系计量经济学博士后； 2006.5-2006.12, 美国北卡罗来纳大学夏洛特分校数学与统计学系数量金融访问教授并授课

### 最高学历

厦门大学金融学博士研究生

## 学术专著

- [1] 金融工程（第二版）， 编著 第二作者， 高等教育出版社， 2008
- [2] An Introduction to Derivatives， 教材 独立完成， 高等教育出版社， 2005
- [3] 金融工程学， 教材 参加编写， 高等教育出版社， 2003
- [4] 中国证券发展简史， 专著 第三， ， 2000

## 论文

- [1] 隐含波动率曲面：建模与实证， 金融研究， 2010年8期
- [2] 结构突变、推定预期与风险溢酬：美元/人民币远期汇率定价偏差的信息含量， 世界经济， 2009年6期
- [3] 最小下偏矩套期保值比率估计研究：基于混合Copula方法， 厦门大学学报（哲社版）， 2009年3
- [4] NDF市场：挑战与对策——各国NDF市场比较与借鉴， 国际金融研究， 2008年9期
- [5] 无偏估计、价格发现与期货市场效率——期货与现货价格关系研究， 系统工程理论与实践， 2008年8期
- [6] 期货价格能否预测未来的现货价格， 国际金融研究， 2007年9期
- [7] 中港股票保本基金的实证研究与比较分析， 厦门大学学报（哲社版）， 2005年第4期
- [8] 期权调整利差（OAS）及其应用研究， 统计研究， 2005年第8期
- [9] 金融学 and 经济学相关关系探讨， 经济学动态， 2005年第2期
- [10] 网络经济学发展概述， 经济学家， 2001年第5期