



杨科

发布时间：2017-04-20 浏览次数：6839

基本信息(Basic Information)



姓名	杨科	Name	Ke Yang
职称	教授	Title	Professor
职务	博导/硕导	Position	PhD Supervisor
系/所	金融系	Department	Finance
办公	B10中座207	Office	Building B10, 207
室			
电话		Telephone	
E-	yangkdc@scut.edu.cn	E-MAIL	yangkdc@scut.edu.cn
MAIL			

个人简介

杨科，男，湖南岳阳人，2011年6月博士毕业于中山大学岭南学院，2014年入选广东省高等学校“千百十人才培养工程”校级培养对象，2017年4月破格晋升为正教授。主持国家自然科学基金青年项目（结题评为“优秀”）和国家自然科学基金面上项目各1项，省部级和地方政府项目4项，参加国家社科基金重大项目和国家自然科学基金重点项目各1项，其他国家级课题5项。已在*International Journal of Forecasting*、*Journal of Forecasting*、*International Review of Economics and Finance*、*Energy Economics*、*International Review of Finance*、*Health Economics*、《管理科学学报》和《系统工程理论与实践》等主流期刊上发表学术论文30余篇。担任国家自然科学基金通讯评审专家以及《经济学（季刊）》、《管理科学学报》、《系统工程理论与实践》、《中国管理科学》、*Energy Economics*和*International Review of Financial Analysis*等刊物的审稿专家。

招生专业

博士：应用经济学

学术硕士：金融学

研究领域(Research Interest)

金融经济学、金融计量、金融工程等

主授课程(Teaching)

金融经济学、金融计量学、实证金融、资产定价、证券投资学等

教育经历(Education)

2008.9-2011.7中山大学岭南学院金融学专业经济学博士学位

2005.9-2008.7广东财经大学经济贸易与统计学院国民经济学专业经济学硕士学位

2001.9-2005.7湘潭大学数学与计算科学学院数学与应用数学专业理学学士学位

工作经历(Experience)

2017.04-至今华南理工大学经济与贸易学院金融系，教授（破格晋升）

2016.12-2017.07. 华南理工大学经济与贸易学院金融系，副教授

2015.08-2016.02,Royal Melbourne Institute of Technology University访问学者（国家公派）

2014.12-2016.11.华南农业大学经济管理学院金融系，副教授

2011.07-2014.11.华南农业大学经济管理学院金融系，讲师

研究成果(Publications)

- Realized volatility forecast: structural breaks, long memory, asymmetry, and day-of-the-week effect. *International Review of Finance*. 2014, 14(3): 345-392. SSCI.
- Realized Volatility Forecast of Stock Index Under Structural Breaks. *Journal of Forecasting*. 2015, 34(1): 57-82. SSCI.
- Forecasting Realized Volatility of Agricultural Commodity Futures Using HAR Model with Time-varying Sparsity. *International Journal of Forecasting*, 2017, 33(1): 132-152. SSCI.
- Realized volatility forecast of agricultural futures using the HAR models with bagging and combination approaches. *International Review of Economics and Finance*. 2017, 49: 276-291, SSCI.
- Realized volatility forecasting of agricultural commodity futures using long memory and regime switching. *Journal of Forecasting*, 2017, 36(4), 421-430. SSCI.
- Forecasting the oil futures price volatility: Large jumps and small jumps. *Energy Economics*, 2018, 72(2): 321-330. SSCI
- A quantile regression approach to panel data analysis of health - care expenditure in Organisation for Economic Co-operation and Development countries. *Health Economics*, Forthcoming. SSCI
- 股市波动率的短期预测模型和预测精度评价.《管理科学学报》，2012年第5期.

- 中国股市高频波动率的特征、预测模型以及预测精度比较.《系统工程理论与实践》，2013年第2期.
- 跳跃的估计、股市波动率的预测以及预测精度评价.《中国管理科学》，2013年第3期.
- 中国股市高频波动率跳跃的特征分析.《系统工程学报》，2012年第4期.
- 长记忆性、结构突变条件下中国股市波动率的高频预测.《管理工程学报》，2013年第2期.
- 基于面板数据的中国菲利普斯曲线的非参数估计及分析.《数理统计与管理》，2014年第5期.
- 全球通货膨胀率的国际联动效应研究-基于贝叶斯潜在多动态因子模型的分析.《国际贸易问题》，2013年第6期.
- 农产品期货市场波动率的动态特征及其预测模型，《经济评论》，2014年第4期.

科研项目(Grants),

- 2016, 主持, 国家自然科学基金面上项目, 金融资产收益的高频协方差矩阵研究: 估计、预测与应用, 项目批准号: 71673089
- 2012, 主持, 国家自然科学基金青年项目, 农产品期货市场波动率的预测以及预测精度评价研究, 项目批准号: 71203067 (已结项, 结题评为“优秀”)
- 2015, 主持, 2015年广州市哲学社会科学“十二五”规划一般课题, 广州市科技金融发展的风险防范问题研究, 项目编号: 15Y21 (已结项)
- 2015, 主持, 广东省软科学项目, 广东省财政科技专项资金投入的管理模式与绩效评价研究, 项目编号: 2015A070704039 (已结项)
- 2012, 主持, 2012年广东省高校优秀青年创新人才培养项目, 我国农产品期货市场波动率的预测研究, 项目编号: 2012WYM_0033 (已结项)
- 2017, 主持, 中央高校基本科研业务费, 金融市场高维波动率的建模及预测研究, 项目批准号: 2017MS114
- 2017, 主持, 2017年度广州市哲学社会科学“十三五”规划智库课题, 广州国企混合所有制改革深化研究, 项目编号: 2017GZZK44
- 2017, 参加, 国家社科基金重大项目, 基于结构性数据分析的我国系统性金融风险防范体系研究项目编号: 17ZDA073
- 2015, 参加, 国家社科基金青年项目, 项目名称: 基于金融高频数据的多元波动率模型及其实证研究, 项目批准号: 15CJY004
- 2014, 参加, 教育部人文社会科学研究青年基金项目, 我国人口结构与资产价格研究, 项目批准号: 14YJCZH141
- 2013, 参加, 国家自然科学基金重点项目, 农村土地与相关要素市场培育与改革研究, 项目编号: 71333004
- 2013, 参加, 教育部人文社科青年基金项目, 政治周期与企业投资: 现象、作用路径与经济后果, 项目编号: 13YJC790013
- 2014, 参加, 国家自然科学基金青年项目, 宏观环境变化、政治关联与现金持有, 项目编号: 71402058
- 2014, 参加, 国家自然科学基金青年项目, 基于容量约束影响的企业竞争策略研究, 项目编号: 71401057

荣誉 (Honors)

- 2016年01月, 评为华南农业大学经济管理学院“十二五”科研工作先进个人
- 2016年01月, 评为华南农业大学经济管理学院“十二五”优秀班主任
- 2016年07月, 评为华南农业大学“三育人”先进个人
- 2014年04月, 入选广东省高等学校“千百十工程”校级培养对象

社会服务

国家自然科学基金评审专家, *International Review of Financial Analysis*、*Energy Economics*、*Emerging Markets Finance and Trade*、国家自然科学基金委管理学部认定的A级重要期刊《管理科学学报》、《中国管理科学》、《系统工程理论与实践》以及核心期刊《经济学季刊》、《经济评论》等学术杂志的论文评审专家.

2012 华南理工大学经济与贸易学院版权所有 粤ICP备05084312号-1

地址: 广州市番禺区 广州大学城 华南理工大学大学城校区B10楼 邮编: 510006

联系电话: 020-39382288 39381068 传真 (Fax): 020-39381068 电子信箱: x2jm@scut.edu.cn

020-39381128 39382298 39382233 39380718 (本科教务) 39380756 39380766 (研究生教务)

020-39380701 39380709 39383096 39382299 (学生工作) 39382299 (研究生管理)

020-39380788 39380799 (EDP中心)