



南京审计大学  
NANJING AUDIT UNIVERSITY

## 统计与数据科学学院

[首页](#) [学院概况](#) [师资队伍](#) [院内通知](#) [学科建设](#) [人才培养](#) [党建工作](#) [科研机构](#) [社会服务](#) [图片新闻](#) [校友专栏](#)

## 我院刘广应教授在国际权威期刊Journal of Econometrics发表论文

---

发布者: 统计与数学学院 发布时间: 2021-04-22 浏览次数: 160

近日, 我院刘广应教授的论文《Volatility of volatility: Estimation and tests based on noisy high frequency data with jumps》, 被Journal of Econometrics杂志录用, 目前可以在线查阅。此论文研究金融高频数据波动率的波动率, 主要估计波动率自身的波动率, 检验分析波动率过程特征, 并将理论结果应用在实际金融高频数据, 得出了实证结论。目前, 金融高频数据研究是金融计量学的一个研究热点, 波动率在金融等领域具有重要的应用价值。在Journal of Econometrics是统计领域、经济计量领域享有高国际声誉的公认权威期刊, 为SSCI、SCI双收录期刊。根据Thomson Reuters发布的期刊引证报告(JCR), 该期刊也是ESI“Economics and Business”(经济学与商学)类别的A区(Q1)期刊。

在学校和学院的支持下, 刘广应受邀于2015年对香港科技大学进行学术访问。访问期间, 与合作导师香港科技大学商学院李莹莹教授、上海财经大学张志远博士进行充分研讨, 形成论文初稿, 经过若干次打磨修改, 最终于2019年1月投稿到Journal of Econometrics期刊, 经过审稿专家的双盲评审, 结合审稿意见, 反复打磨修改, 最终被期刊录用发表。

附: 论文链接:

<https://www.sciencedirect.com/science/article/pii/S0304407621000701>。

地址：南京市浦口区雨山西路86号 电话：025-58318699 Email：310179@nau.edu.cn  
统计与数据科学学院 制作维护