金融学系·教师简介

余白敏，副教授

余白敏

对外经济贸易大学 国际经济贸易学院 金融系

Email: bmyu@uibe.edu.cn

教育背景

2009 中科院数学与系统科学研究院博士

2004 电子科技大学学士

工作经历

2009.8—至今 对外经济贸易大学国际经贸学院教师

访问经历

2008.1-2008.8 加拿大滑铁卢大学（University of Waterloo）统计与精算系，访问学者

2007.6-2007.9 德国比勒菲尔德大学（Bielefeld University）IGK.

教授课程

数量金融基础（研究生）

金融模型数值分析（研究生）

数理经济学I（研究生，本科生（荣誉班、校荣誉课程））

多元统计分析（研究生）

研究领域

数理金融

主要研究成果

“Two Efficient Parameterized Boundaries for Vecer's Asian Option Pricing PDE”, Acta Mathematicae Applicatae Sinica (English Series)，forthcoming, 2011. (SCI)

“Index-Exciting CAViaR: A New Empirical Time-Varying Risk Model”, with D. Huang, F.J. Fabozzi, S. Focardi, M. Fukushima and Z. Lu, Studies in Nonlinear Dynamics & Econometrics, Vol.14(2), Article 1, 2010. (SSCI)

“CAViaR-based Forecast of Oil Price Risk”, with Dashan Huang, Frank J. Fabozzi and Masao Fukushima, Energy Economics, Vol.31, 511-518, 2009. (SSCI)

“An Improved CAViaR Model for Oil Price Risk,” with Dashan Huang, Frank J. Fabozzi, Masao Fukushima and Lean Yu, Lecture Notes in Computer Science, Vol.4489, 937-944, 2007.（EI）

工作论文

“高频数据下风险价值预测直接法和间接法的比较研究”

“Option Pricing based on Realized Volatility Model: Evidence from China”

版权所有 © 对外经济贸易大学·国际经济贸易学院 外经贸网备：10118001
地址：中国·北京市朝阳区惠新东街10号博学楼11-12层
学院邮箱：site@uibe.edu.cn