



## 刘妍

发布者: 系统管理员 发布时间: 2018-02-02 浏览次数: 5519

刘妍, 副教授, 硕士生导师, 统计学博士

### 研究方向:

金融时间序列分析, 投资组合理论, 风险管理

### 主讲课程:

金融时间序列分析, 运筹学(本科、硕士)

高等计量经济学(博士)

### 教育及工作背景:

2011/7至今, 中国海洋大学金融系工作

2008/8 - 2011/7, 香港中文大学, 统计学, 博士

2006/9 - 2008/7, 中国人民大学, 统计学, 硕士

2002/9 - 2006/7, 中国人民大学, 风险管理与精算学专业, 学士

### 学术交流:

2014.12-2015.01, 香港中文大学统计系, 访问学者

2015.07-2015.09, 香港中文大学统计系, 访问学者

### 主持纵向课题:

1. 山东省社科规划项目, 企业债务危机视角下山东省系统性金融风险预警研究, 2017.10-2019.12.

2. 山东省优秀中青年科学家科研奖励基金, 山东半岛蓝色经济区近海生态健康与海洋经济发展关系的实证研究, 2014.12-2016.12.

### 主持横向课题:

1. 蓝贝创新创业指数编制, 2015年至今。

### 主要发表论文:

1. Yan Liu, Ngai Hang Chan\*, Chi Tim Ng, Samuel Po Shing Wong. Shrinkage Estimation of Mean-Variance Portfolio. *International Journal of Theoretical and Applied Finance*, 2016, 19(1): 1-25.

2. Yan Liu, Hsu-Ling Chang, Chi-Wei Su\*. Do Real Interest Rates Converge across East Asian Countries Based on China? *Economic Modelling*, 2013(31): 467-473.

### 通讯地址:

山东省青岛市崂山区松岭路238号, 中国海洋大学经济学院306  
邮 编: 266100  
电子邮箱: liuyan0617@ouc.edu.cn

版权所有-中国海洋大学-经济学院      青岛市崂山区松岭路238号 中国海洋大学崂山校区 经济学院      邮政编码:266100  
传真:0532-66781783      电话:0532-66781695 66781992(值班)      E-mail:jjxyyb@ouc.edu.cn