

陈蓉个人简历

基本资料

陈蓉，女，1976 年出生，汉族，经济学（金融学）博士，厦门大学财务系金融工程教授、博士生导师，厦门大学金融工程研究中心主任，厦门大学证券研究中心副主任，美国康奈尔大学金融计量与金融工程方向博士后，美国北卡罗来纳大学夏洛特分校数学与统计学系访问（授课）教授，厦门大学金融工程博士后。

陈蓉教授先后发表了 30 多篇学术论文，出版了 10 多部著作和教材，作为主持人和主要参与者承担了 8 项国家和省部科研课题的研究，还主持了 10 多项横向课题，并多次获奖。

陈蓉教授近年来的研究领域包括：金融工程、固定收益证券、风险管理、金融计量与资产定价。

联系方式：福建省厦门市 厦门大学财务系 邮编：361005

电子邮件：aronge@xmu.edu.cn

教育经历

- 2000.9-2003.7 厦门大学金融系 金融学 博士
- 1997.9-2000.7 厦门大学财政金融系 金融学 硕士
- 1993.9-1997.7 厦门大学财政金融系国际金融专业 本科

工作经历

- 2017.6 至今 厦门大学财务系 数量金融方向 教授、博导
- 2010.4-2017.5 厦门大学金融学 金融工程方向 博士生导师
- 2009.8-2017.5 厦门大学金融系 金融工程方向 教授
- 2006.8-2009.8 厦门大学金融系 金融工程方向 副教授
- 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 访问教授（授课）
- 2005.8-2006.5 美国康奈尔大学 金融计量与金融工程方向 博士后
- 2003.8-2006.7 厦门大学金融系 金融工程方向 讲师
- 2003.8-2005.8 厦门大学 结构化金融衍生产品方向 博士后

主要讲授课程：

本科：《金融工程》、《固定收益证券》、《随机过程》

硕士：《固定收益证券》、《金融工程》、《金融时间序列分析》、《高级计量经济学 I》

博士：《数量金融与计量金融》（《高级金融工程》）

主要学术成果

著作:

1. 郑振龙、陈蓉主编,《金融工程(第四版)》(“十二五”国家级规划教材/国家级精品资源共享课教材),高等教育出版社,2016年9月.
2. 郑振龙、陈蓉主编,《金融工程(第三版)》(“十二五”国家级规划教材),高等教育出版社,2012年6月.
3. 陈蓉、郑振龙主编,《固定收益证券》,北京大学出版社,2011年9月.
4. 韩立岩、王允贵主编,《人民币外汇衍生品市场:路径与策略》,科学出版社,2009年5月.郑振龙、陈蓉、陈淼鑫等撰写第一章.
5. 郑振龙、陈蓉主编,《金融工程(第二版)》(“十一五”国家级规划教材),高等教育出版社,2008年7月.
6. 郑振龙、陈蓉、陈淼鑫、邓弋威著,《外汇衍生品市场:国际经验与借鉴》,科学出版社,2008年6月.
7. 参编《衍生产品》,郑振龙主编,武汉大学出版社,2005年2月.
8. Don M. Chance 著,陈蓉改编,《An Introduction to Derivatives and Risk Management》,高等教育出版社与 Thomson 出版社,2005年1月.
9. 参编《金融工程》(“十五”国家级规划教材),郑振龙主编,高等教育出版社,2003年7月.
10. 郑振龙、江孔亮、陈蓉、李建斌著,《中国证券发展简史》,经济科学出版社,2000年8月.
11. Aswath Damodaran 著,郑振龙、蒋峰、陈蓉、林海译,《应用公司理财》,机械工业出版社,2000年5月.

论文:

1. 陈蓉,赵永杰. 陈蓉,赵永杰. 隐含波动率曲面的预测研究:来自中国台湾市场的证据[J]. 系统工程理论与实践,2017,37(8): 1949-1962.
2. Zhenlong Zheng, Zhengyun Jiang and Rong Chen, AVIX: An Improved VIX Based on Stochastic Interest Rates and an Adaptive Screening Mechanism[J], Journal of Futures Markets, 2017, 37:374-410.
3. 陈蓉,葛骏,中国国债期货与隐含择券期权定价[J]. 数理统计与管理,2017,36(2): 361-380. 中国金融期货交易所第五届金融期货与期权研究征文大赛一等奖.
4. 陈蓉,林秀雀. 波动率偏斜与风险中性偏度能预测尾部风险吗[J]? 管理科学学报,2016,19(8): 113-126.
5. 刘杨树,郑振龙,陈蓉,跳跃风险如何影响期权复制收益?——基于多维跳跃扩散的模型与证据[J],管理科学学报,2016,19(6): 74-86.
6. 陈蓉,廖木英,徐婉菁. 期权隐含偏度风险溢酬:来自中国台湾市场的证据[J]. 系统工程理论与实践,2016,36(5): 1099-1108.
7. 郑振龙,廖木英,陈蓉,黄海峰. 潜藏因子的信息含量:来自中国国债市场的证据[J]. 系统工程理论与实践,2016,36(1): 44-54.
8. 陈蓉,王宜峰,邱紫华. 隐含风险厌恶:度量、影响因素与信息含量[J]. 厦门大学学报(哲社版),2016,233(1):116-127.

9. 郑振龙, 陈蓉, 王磊. 汇率相关性的预测与全球资产配置[J]. 国际金融研究, 2015 (3): 76-85.
10. 陈蓉, 葛骏. 谁是国债期货的 CTD 券[J]? 中国期货, 2015, 44 (2): 62-65
11. 陈蓉, 葛骏. 国债期货定价: 基本原理与文献综述[J]. 厦门大学学报 (哲社版), 2015 (1): 5-8.
12. 陈蓉, 陈焕华, 郑振龙. 动量效应的行为金融学解释[J]. 系统工程理论与实践, 2014, 34 (3): 613-622.
13. Rong Chen, Hai Lin and Qianni Yuan, On-/off-the-Run Yield Spread Puzzle: Evidence from Chinese Treasury Markets, Handbook of Financial Econometrics and Statistics, Springer US, 2014.
14. 陈蓉, 陈妙琼. 金融资产的动态非线性相关: 一个新的模型[J]. 管理评论, 2012, 24 (2): 12-23.
15. 陈蓉, 曾海为. 波动率风险溢酬: 基于香港和美国期权市场的研究[J]. 商业经济与管理, 2012 (2): 53-59.
16. 陈蓉, 方昆明. 波动率风险溢酬: 时变特征及影响因素[J]. 系统工程理论与实践, 2011, 31 (4): 761-770. EI 收录
17. 陈蓉, 吕恺. 隐含波动率曲面: 建模与实证[J]. 金融研究, 2010 (8): 136-154.
18. 陈蓉, 杨伟, 郑振龙. 韩圆 NDF 市场发展的深层思考及对我国的经验借鉴[J]. 财经问题研究, 2009 (7): 78-82.
19. 陈蓉, 郑振龙. 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[J]. 世界经济, 2009 (6): 64-76.
20. 陈蓉, 郑振龙. 中国应开放人民币 NDF 市场吗? 基于人民币和韩圆的对比研究[J]. 国际金融研究, 2009 (6): 79-89.
21. 陈蓉, 蔡宗武, 陈妙琼. 最小下偏矩套期保值比率估计研究: 基于混合 Copula 方法[J]. 厦门大学学报 (哲社版), 2009 (3): 34-40.
22. 陈蓉, 郑振龙, 刘琛. 澳大利亚外汇衍生品市场发展历程探究及其对我国的启示[J]. 商业经济与管理, 2009 (2): 59-64.
23. 陈蓉, 郑振龙, 蒋禹. 墨西哥外汇衍生品市场发展对我国的经验借鉴[J]. 当代财经, 2009 (1): 59-63.
24. 陈蓉, 郑振龙. NDF 市场: 挑战与对策——各国 NDF 市场比较与借鉴[J]. 国际金融研究, 2008 (9): 39-47.
25. 陈蓉, 郑振龙. 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[J]. 系统工程理论与实践, 2008 (8): 2-11. EI 收录。
26. 陈蓉, 郑振龙. 期货价格能否预测未来的现货价格[J]. 国际金融研究, 2007 (9): 70-74.
27. 陈蓉, 郭晓武. 期权调整利差 (OAS) 及其运用研究[J]. 统计研究, 2005 (8): 44-47.
28. 陈蓉, 郑振龙, 张林昌. 金融衍生产品: 风险、市场失灵与公共政策[J]. 山东社会科学, 2005 (8): 50-53.
29. 贺涛, 陈蓉. 期权调整价差模型及其运用[J]. 中国货币市场, 2005 (5).
30. 陈蓉, 郭晓武. 中港股票保本基金的实证研究与比较分析[J]. 厦门大学学报 (哲社版), 2005 (4): 48-54.
31. 郑振龙, 陈蓉. 金融学 and 经济学相关关系探讨[J]. 经济学动态, 2005 (2): 26-30.
32. 陈蓉. IPO 发售机制的国际融合和中国考察[J]. 证券市场导报, 2002 (7): 29-33.

课题：

主持纵向课题：

1. 国家自然科学基金，“波动率微笑：隐含信息与动态建模”，项目号：71471155，经费 61 万，2015.1-2018.12
2. 国家自然科学基金青年项目，“投资者风险偏好：度量与应用”，项目号 71101121，经费 20 万，2012.1- 2014.12
3. 教育部留学回国人员基金，“人民币即期与远期汇率关系及外汇市场协同稳定机制研究”，经费 2 万，2008.8
4. 教育部人文社科一般项目，“市场有效性、价格发现与定价权争夺：基于人民币即期汇率和远期汇率的研究”，项目号 07JA790077，经费 5 万，2007.12

作为主要合作者的纵向课题：

1. 国家自然科学基金，“资产价格中隐含通货膨胀信息的提取、分析与应用”，项目号：71371161，经费 57.5 万元，2014.1—2017.12
2. 国家自然科学基金，“非完美信息下基于观点偏差调整的资产定价”，项目号 70971114，经费 25.5 万，2010.1- 2012.12
3. 教育部“国际金融危机应对研究”应急项目，“金融市场的信息功能与金融危机预警”，项目号 2009JYJR051，经费 5 万 2009.4-2010.3
4. 国家自然科学基金应急项目，“人民币外汇衍生产品的发展现状与结构设计”，项目号 70741012，经费 7 万，2007.6-2008.4