

2016 哈尔滨“金融，经济与数学”冬季研讨会

程
序
册

哈尔滨师范大学数学科学学院
哈尔滨, 中国
2016 年 1 月 13-14 日

主办/赞助单位：哈尔滨师范大学数学科学学院

组织委员会：史峻平（美国威廉玛丽学院），宋文,王玉文,刘萍（哈尔滨师范大学），程立新（厦门大学），薛小平(哈尔滨工业大学)

组织者通讯方式： junpingshi@gmail.com, liuping506@gmail.com

秘书组： 刘冠琦，王紫，陈静仁，刘宏丽（哈尔滨师范大学）

报告地点：哈师大(松北校区)理工一号楼337报告厅

住宿地点：哈尔滨马迭尔宾馆

1 月 13 日(理工一号楼 337 报告厅)

Time	Chairman	Speaker	Title
9:30-9:50	王玉文	宋文 王玉文 史峻平	讲话, 合影
9:50-10:30	张圣平	周爱民	股市中的大道定理 (Turnpike Theorem in a Stock Market)
茶歇 10:30-10:50			
10:50-11:30	于长福	张峥	中国权证市场投机性的传染

1 月 13 日(理工一号楼 337 报告厅)

Time	Chairman	Speaker	Title
13:00-13:40	田波平	李冰清	Option Pricing for a Jump-Diffusion Model with General Discrete Jump-Size Distributions
13:40-14:20		史峻平	美国威廉玛丽学院的 大数据本科生研究

摘要

股市中的大道定理 (Turnpike Theorem in a Stock Market)

周爱民(南开大学金融学院数量金融系)

本文使用跨时分析方法得出了股市里的大道定理, 讨论了扩容速度与价格成长之间的长期均衡关系, 对现实问题有一定的指导意义。

中国权证市场投机性的传染

张峥(北京大学光华管理学院, 金融系)

我们的研究分析并展示了投机活动具有传染效应, 并可以跨市场溢出。我们验证了如下假说——在中国权证市场存在泡沫的情况下, 权证的投机活动会吸引投资者注意力, 并进一步促使他们对标的股票进行更大规模的投机行为。我们发现, 在控制了信息驱动的交易行为和对冲交易行为之后, 标的股票换手率、收益波动率与权证的非预期换手率、基础证券的价格偏差有正向关系。还进一步发现, 权证吸引投资者注意越多, 溢出效应则越显著。

Option Pricing for a Jump-Diffusion Model

with General Discrete Jump-Size Distributions

李冰清(南开大学金融学院)

We obtain a closed-form solution for pricing European options under a general jump-diffusion model that can incorporate arbitrary discrete jump-size distributions, including non-parametric distributions such as an empirical distribution. The exhibility in the jump-size distribution allows the model to better capture leptokurtic features found in real-world data. The model uses a discrete-time framework and leads to a pricing formula that is provably convergent to the continuous-time price as the discretization is increased. The solution is easy to implement with fast convergence properties. Numerical results illustrate the efficiency and accuracy of the proposed model, and highlight its robustness and exhibility.

美国威廉玛丽学院的大数据本科生研究

史峻平(美国威廉玛丽学院)

我介绍一些我所任教的学校数学系近年来在大数据本科生教育方面的新的课程设置和研究课题。

通讯录

姓名	单位	邮箱
李冰清	南开大学金融学院	bqlink@126.com
史峻平	美国威廉玛丽学院	junpingshi@gmail.com
田波平	哈尔滨工业大学数学系	bopingt361147@hit.edu.cn
姚凤阁	哈尔滨商业大学金融学院	55510765@qq.com
于长福	黑龙江财经学院	
张圣平	北京大学光华管理学院	zsp@gsm.pku.edu.cn
张铮	北京大学光华管理学院	zheng86@gsm.pku.edu.cn
周爱民	南开大学金融学院数量金融系	13302183858@163.com
程立新	厦门大学	lxcheng@xmu.edu.cn
薛小平	哈尔滨工业大学数学系	xiaopingxue@hit.edu.cn
宋文	哈尔滨师范大学数学科学学院	wsong_hrbnu@aliyun.com
王玉文	哈尔滨师范大学数学科学学院	wangyuwen1950@aliyun.com
刘萍	哈尔滨师范大学数学科学学院	liuping506@gmail.com
刘冠琦	哈尔滨师范大学数学科学学院	liuguanqi@163.com
王紫	哈尔滨师范大学数学科学学院	wangzi_718718@163.com
陈静仁	哈尔滨师范大学数学科学学院	chenjingren0@sina.com
刘宏丽	哈尔滨师范大学数学科学学院	liuhongli79@163.com
王涛	哈尔滨师范大学数学科学学院	wangtaohrb@126.com
赵岩斌	哈尔滨师范大学数学科学学院	zyb_sxx@126.com
刘宏亮	哈尔滨师范大学数学科学学院	liuhongliang1978@126.com
丁磊	哈尔滨师范大学数学科学学院	dingleihrb@163.com

其他安排:

- ✓ 12日马迭尔报到,17:30 晚宴(马迭尔宾馆三楼莫斯科厅), 商讨 2018 年纪念活动筹备情况
- ✓ 13日 8:30 马迭尔出发--哈师大江北校区,11:30 午餐(梦溪宾馆)
下午 14:30 太阳岛雪博会(1 个小时); 16:30 晚宴(江北龙华渔村) 19:00 冰雪大世界
- ✓ 14日 9:00 出发伏尔加庄园(滑雪,俄罗斯歌舞,滑梯,特色建筑)预计 16:00 返回
- ✓ 15日离会