

浙江大学百人计划 期中总结报告

所在单位： 经济学院

姓 名： 曾涛

职 工 号：

岗位学科： 金融学

填表日期： 2019 年 12 月 23 日

浙 江 大 学

填 表 说 明

- 一、浙江大学百人计划入选者首聘期内期中填写本表，填写内容必须实事求是。
- 二、本表内有关栏目填写不下的，可另附页。
- 三、本表内有关栏目成果填写要求是以浙江大学为第一署名单位的，否则请注明。

一、简况

姓 名	曾涛		性别	男	国籍	中国	出生年月	1979.05.15
百人计划 岗位类别	A 类	B 类	C 类		学科岗位 名称	金融学		
		√						
聘期	2017 年 11 月 16 日 至 2023 年 12 月 31 日							
联系电话	13971569480				电子邮箱	tzeng@zju.edu.cn		

二、聘期内主要学术兼职情况（兼任专业学会、协会职务、专业期刊编委等，请注明起讫年月）

--

三、聘期内教学科研情况

3.1 聘期内承担教学工作情况				
授课名称	授课时间	授课对象	讲授课时数	教学评估
金融计量模型	2018 年春	本科生	24	优秀
金融计量模型	2018 年春	本科生	24	优秀
经济统计软件应用	2018 年春夏	本科生	64	优秀
高级资产定价理论	2018 年夏	博士生	12	
量化投资	2018 年冬	硕士生	32	4.8
高级经济学前沿	2019 年夏	博士生	12	
经济统计软件应用	2019 年夏	本科生	32	良好
经济统计软件应用	2019 年秋	硕士生	32	4.7
经济统计软件应用	2019 年秋	硕士生	32	4.8
量化投资	2019 年冬	硕士生	32	4.8
量化投资	2019 年冬	硕士生	32	5.0
经济统计软件应用	2019 年秋冬	本科生	64	
量化投资	2019 年秋冬	硕士生	32	4.9
计量经济学	2019 年秋冬	本科生	42	

3.2 聘期内承担主要科研项目					
项目名称	项目性质及来源	项目经费（括号内为本人实际承担经费）（单位万元）	目前到校经费	项目起讫年月	本人排序
时变系数三步回归滤波理论及其在中国经济中的应用研究，18YJC790005	教育部青年项目	8	6	2018.8 – 2021.7	1
3.3 聘期内获奖情况					
获奖项目名称	奖励名称及等级	授奖单位	获奖年月	本人排序	
3.4 聘期内获得专利情况					
专利名称	专利授权国、专利号	专利类别	授权公告年月	本人排序	
3.5 聘期内代表性论文、著作情况（以浙江大学为第一署名单位，否则请注明）					
论文：论文题目，发表期刊名称，卷，期，起止页码，所有作者姓名（本人名字请加下划线，通讯作者名字上用*标示）	发表年月	是否被SCI、EI、SSCI、	期刊影响因子	他引次数	
Specification Tests based on MCMC Output, Yong Li, Jun Yu and <u>Tao Zeng*</u> , Journal of Econometrics, 207, 237-260	2018.11	SSCI	1.949	1	
Deviance Information Criterion for Latent Variable Models and Misspecified Models, Yong Li, Jun Yu and <u>Tao Zeng*</u> ,	2020	SSCI	1.949	2	

forthcoming				
Does the T + 1 rule really reduce speculation? Evidence from Chinese Stock Index ETF, Xinyun Chen, Yan Liu* and <u>Tao Zeng</u> , Accounting & Finance 57 (5), 1287-1313	2017.12	SSCI	1481	7
Does High Frequency Social Media Data Improve Forecasts of Low Frequency Consumer Confidence Measures? Steven Lehrer, Tian Xie* and <u>Tao Zeng</u> , Journal of Financial Econometrics, forthcoming,	2020	SSCI	1907	
房价波动、金融稳定与最优宏观审慎政策, 司登奎 葛新宇 曾涛 李小林, 金融研究 2019, 473 (11): 38-56	2019.11			
Hypothesis Testing, Specification Testing and Model Selection Based on the MCMC Output using R, Yong Li, Jun Yu and <u>Tao Zeng*</u> , Handbook of Statistics, Vol 41, Chapter 4	2019.8			
著作: 所有作者姓名, 书名, 出版地, 出版社 (本人名字请加下划线)	出版年月	个人字数	总字数	
3.6 聘期内担任国际学术会议重要职务及在国际学术会议大会报告、特邀报告情况				
The 2017 Aisan Meeting of the Econometric Society, 报告				
The Frontier in Econometrics Workshop, 2018, 报告				
The 2019 China Meeting of the Econometric Society, 报告				

四、期中工作总结

本栏由本人填写，主要填写以下内容（不超过 3000 字）：

1. 聘期内履行岗位职责、完成岗位工作目标和任务情况（包括教学与人才培养、科研、学科与队伍建设等）；
2. 聘期内取得的重要成果的内容、意义和前景，并着重说明其突破和创新之处；
3. 对比岗位目标和预期计划，说明完成情况以及存在的问题和建议。

1、 履行岗位职责，完成岗位工作目标和任务情况如下，

- 1) 科研方面：已发表浙江大学 A 类期刊文章两篇，B 类期刊文章一篇，SSCI 二区期刊文章一篇，经济类中文核心期刊一篇，应邀在统计学权威手册 Handbook of Statistics 撰写一个章节，2018 年度获批教育部青年基金项目一项；
- 2) 人才培养方面：目前本人正在指导研究生 1 人，本科生 6 人，负责“经济学拔尖班”《经济学前沿专题 I》和“数字金融班”《量化投资》两门课程的课程建设工作，负责工程师学院《量化投资》课程的校企共建工作，担任本科生社科 1824 和金融 1802 班的班主任，指导本科生 SRTP 项目《多因子选股模型在中国的通用性检验与修正》；
- 3) 教学方面：本人自 2017 年 11 月入职以来，至 2019 年 12 月，教授课程 14 门，共计 466 课时，其中本科生课程 5 门，计 208 课时，硕士研究生课程 5 门，计 160 课时，博士生课程 2 门，计 24 课时，工程师学院硕士研究生课程 1 门，计 32 课时，海宁国际校区本科生计量经济学课程 1 门，计 42 课时；
- 4) 学科建设：帮助学院联系引进国外优秀人才，组织了第一届和第二届“金融计量与新金融国际研讨会”，邀请了国内外著名金融领域专家参会，巩固与提升了浙江大学在金融学领域的研究声誉和优势；
- 5) 其他：担任了 Journal of Econometrics 等国际期刊的审稿人，赴新加坡管理大学进行了两次学术研修，邀请多位国内外知名学者来浙大讲学，参加了两次国际学术会议。

2、聘期内取得的重要成果的内容、意义和前景

- 1) 本人的主要研究领域是关于贝叶斯方法在金融计量经济学中的应用，2014 – 2019 年期间，已在国际顶尖经济学刊物 Journal of Econometrics（浙江大学经济学院 A 类奖励期刊）上发表文章两篇，同时有一篇文章已经被 Journal of Econometrics 接受，将于 2020 年发表：

A New Approach to Bayesian Hypothesis Testing (with Yong Li and Jun Yu)

Journal of Econometrics, 2014, 178, 602-612

Specification Tests based on MCMC Output (with Yong Li and Jun Yu)

Journal of Econometrics, 2018, 207, 237-260. （浙江大学第一署各单位，通讯作者）

Deviance Information Criterion for Latent Variable Models and Misspecified Models (with Yong Li and Jun Yu), Journal of Econometrics, forthcoming （浙江大学第一署各单位，通讯作者）

以上三篇文章主要研究了贝叶斯计量经济学在隐变量模型中的应用，在金融计量经济学中，有一些模型中的变量是无法观测的，在微观金融中以波动率模型为代表，包括 GARCH 模型，随机波动率模型等，而在宏观金融中则以动态随机一般均衡模型为代表。我们的文章建立了在贝叶斯估计的框架下隐变量模型的参数检验，模型设定检验以及模型选择的整套统计推断框架。

我们的研究成果得到了学术界的广泛关注。统计学届的权威手册 Handbook of Statistics 邀请我们参与编写了 Handbook of Statistics, Vol 41 的第四章，“Hypothesis Testing, Specification Testing and

Model Selection Based on the MCMC Output using R” (with Yong Li and Jun Yu)。该手册在统计学领域是历史最悠久和最权威的手册，其每个章节都是邀请在相关领域的权威编写，这充分说明了我们的研究已经得到了统计学和金融计量领域的高度认可。

2) 本人的另一研究领域为经济预测，有一篇文章已经被国际顶尖金融计量经济学杂志 Journal of Financial Econometrics (经济学院 B 类奖励期刊) 接受，该文章构建了一种新的使用高频社交媒体数据预测低频消费者指数的方法，该文章同时被美国经济研究局 (National Bureau of Economic Research) 收录为工作论文

Does High Frequency Social Media Data Improve Forecasts of Low Frequency Consumer Confidence Measures? (with Steven Lehrer and Tian Xie) forthcoming in the Journal of Financial Econometrics

3) 本人来到浙大后，在学院领导和职业导师的鼓励下，开始尝试将金融计量经济理论应用在中国经济研究方面。宏观金融研究方面，有一篇文章已经在《金融研究》(2019 年第 11 期) 发表，题目为《房价波动、金融稳定与最优宏观审慎政策》，该文章通过构建包含家庭住房抵押贷款摩擦和银行贷款摩擦的动态随机一般均衡模型考察了异质性冲击下房价波动对金融稳定的影响。微观金融研究方面，2017 年有一篇文章在 Accounting and Finance (SSCI 二区) 发表，题目为 Does the T + 1 rule really reduce speculation? Evidence from Chinese Stock Index ETF (with Xinyun Chen and Yan Liu)，该文章使用股指 ETF 数据探讨了股市的 T+1 交易制度能否抑制投机行为。

3、岗位目标和预期计划，说明完成情况

岗位目标：本人签订的百人计划 B 类工作合同的要求为六年发表一篇 A 类、一篇 B 类和两篇 C 类文章，或两篇 A 类期刊文章，获得一项国家或省部级基金，教学任务为每年 96 课时。对照岗位目标，本人已超额完成六年的岗位目标。

预期计划：申请人将继续秉承“求是创新”之精神，以“欲栽大木柱长天”之教育追求，密切配合学校和学院的发展战略，做好自身教研工作，极力推进金融系的学科建设和发展，主要预期计划包括：

1. 学科建设方面，一方面，将以“教学质量”为抓手，努力营造良好的师资交流和学习氛围，完善教学研讨会建设和课程组建设。与此同时，继续密切国内外学科之间的交流和联系，进一步完善学科培养方案和课程体系；另一方面，将以“金融实践”为重心，着力打造和提升金融学专业的品牌效应和市场影响力，将继续举办“金融计量与新金融国际研讨会”，努力开拓创新，努力推进学科的国际学术交流，配合院系领导做好系专业人才的培养和梯队建设，以及国内外高端学术领军人才的引进工作。

2. 教学方面，除进一步做好自身的教学工作外，将努力完善本、硕、博三个层次的主讲课程建设，努力推进精品课程建设、MOOC 课程开发和高质量教材建设。特别是在本科主讲课程《金融计量模型》和硕士主讲课程《量化投资》中努力做到使用自己编写的教材，突出我国金融市场特点、规律和进展，密切理论与实际，密切教学和实践。

3. 科研方面，聚焦中国金融市场发展和实践的“真”问题，做到“顶天立地”，继续争取在学科顶尖国际期刊发表更有影响力的中国研究论文。与此同时，努力打造优秀的科研团队，积极深化国际科研合作交流，力争获得国家自然科学基金重点项目的研究支持。

4. 在公共事务方面，将进一步配合学院管理中心工作，主动推进各项有利于院系发展的对外交流和联系工作。与此同时，也将尽我所能地多承担包括班主任、新生之友、学术大赛指导等各项院系公共事务。