2021 年经济学院研究生导师信息表

<table>
<tr><td>姓名</td><td>骆兴国</td><td>性别</td><td>男</td><td>职务</td><td colspan="3">金融系副系主任</td></tr>
<tr><td>职称</td><td>副教授</td><td>出生年月</td><td>1980.09</td><td>拟招收
博士生数</td><td>2</td><td>拟招收硕士
生数</td><td>4</td></tr>
<tr><td>手机</td><td colspan="2">18858127157</td><td>联系电话</td><td></td><td>电子邮箱</td><td colspan="2">xgluo@zju.edu.cn</td></tr>
<tr><td rowspan="4">愿带硕士生的专业与方向</td><td rowspan="2">一</td><td>专业名称</td><td colspan="5">金融学</td></tr>
<tr><td>方向</td><td colspan="5">资产定价、衍生品市场、对冲基金、绿色能源金融等理论与实证研究</td></tr>
<tr><td rowspan="2">二</td><td>专业名称</td><td colspan="5">金融学</td></tr>
<tr><td>方向</td><td colspan="5">外汇，宏观金融，衍生品在公司金融中的应用等实证分析</td></tr>
</table>

对学生的要求

积极阳光，热爱科研，习惯阅读英文文献。

自述（简历、学术专长、学术兴趣等需向学生说明的任何事项）

本科、硕士，数学，浙江大学数学系； 博士，金融学，香港大学经济金融学院； 副教授（博导），金融学，浙江大学经济学院、浙江大学金融研究院，浙江大学"求是青年学者"。

研究领域：资产定价、衍生品、量化高频交易、ABS、绿色普惠金融、信用风险和金融大数据等，涉及中国大陆、香港和美国的债券、股票、权证和商品等金融市场，已在金融学国际知名 SSCI 期刊发表 10 余篇文章，担任衍生品国际知名期刊 Journal of Futures Markets 编委，多次指导硕士和博士在国际知名 SSCI 期刊发表论文。

详见个人主页： http://mypage.zju.edu.cn/xingguo

主要著作、论文

1.Volatility index and the return–volatility relation: Intraday evidence from Chinese options market, ***Journal of Futures Markets***, 2019. （与博一学生合作）

2. Expected stock returns and forward variance, ***Journal of Financial Markets***, 2017.

3. The dynamic correlations between the G7 economies and China: Evidence from both realized and implied volatilities, ***Journal of Futures Markets***, 2017. （与硕士合作）

4. Stochastic volatility vs. jump diffusions: Evidence from the Chinese convertible bond market, ***International Reivew of Economics and Finance***, 2017. （封面首篇）（与数学系博三学生合作）

5. The information content of implied volatility and jumps in forecasting volatility: Evidence from the Shanghai gold futures market, ***Finance Research Letters***, 2016. （与本科、硕士合作）

6. Predicting volatility of the Shanghai silver futures market: What is the role of the U.S. options market?, ***Finance Research Letters***, 2015 （与硕士合作）

7. Sell in May and Go Away: Evidence from China, ***Finance Research Letters***, 2014

8. Is Warrant Really a Derivative? Evidence from the Chinese Warrant Market, ***Journal of Financial Markets***, 2013

9. The Term Structure of VIX, ***Journal of Futures Markets***, 2012 （封面首篇）

10. Forecasting the Term Structure of Chinese Treasury Yields, ***Pacific-Basin Finance Journal***, 2012 （封面首篇）

主要课题、项目（须写明立项单位、课题名称、本人角色、起止日期、经费数量等信息）

1. 波动率衍生品市场的理论和实证研究，国家自然科学基金，主持人，2018-2021,45.2 万
2. 我国股票市场隐含偏度指数的建立及应用研究，国家自然科学基金，主持人，2014-2017,20.5 万
3. 我国国债期货与现货市场动态关系研究，浙江省自然科学基金，主持人，2013-2015,5 万

获奖情况

2012 年获得芝加哥商业交易所集团（CME Group，全球最大的期货期权交易市场）的特别研究奖励。

社会（学术）兼职

近年来担任以下 SSCI 学术期刊的匿名审稿人：

1. Management Science
2. Journal of Futures Markets
3. Pacific-Basin Finance Journal
4. Quantitative Finance
5. Energy Economics
6. Journal of Banking and Finance
7. Accounting and Finance

多次在主流金融学国际会议宣读论文，曾担任国际金融管理学会（Financial Management Association, FMA）和亚洲金融学会（Asian Finance Association）年会的分会场主席（Session Chair）。

（助研助学金）导师经费卡卡号：

若在研究生复试、选导期间（3 月份硕士复试选导、5 月份博士复试选导、提前攻博、9 月份免试生复试选导、12 月份提前攻博）本人不在杭州，委托_____ 全权处理，其联系信息如下：

受托人姓名	电话号码	手机号码	电子邮箱