

陈季龙

浙江工商大学
国际商学院
杭州, 浙江, 310000

电话: 15258801144
电子邮件: cj1hk1989@hotmail.com
主页: <https://ibs.zjgsu.edu.cn/cj1>

基本信息

出生年月1989年2月

浙江江山人.

教育背景

Ph.D. 数量金融学, 格拉斯哥大学, 英国, 2012-2016.

M.A. 金融预测与投资, 格拉斯哥大学, 英国, 2011-2012.

B.S. 数学与应用数学, 浙江工商大学, 中国, 2007-2011.

工作经历

助理教授, 浙江工商大学, 2018-.

教学: 金融衍生品, 大数据等

助理教授, 江西财经大学, 2017-2018.

教学: 金融工程, 投资学, 金融衍生品, 金融学基础模型等.

博士助教(*Applied Computational Finance*), 格拉斯哥大学, 2013-2016.

科研成果

"Pricing Commodity Futures and Determining Risk Premia in a Three Factor Model with Stochastic Volatility: The Case of Brent Crude Oil", (with Christian Ewald, Ouyang Ruolan, Xie Yonghong, Sjur Westgaard), *Annals of Operations Research*, 2021, Accepted. (第一作者, SSCI一区)

"COVID-19, public attention and the stock market", (with Xu liao and Zhang Xuan), *Accounting & Finance*, 2020, Accepted. (通讯作者, SSCI二区)

"Do ETF flows increase market efficiency? Evidence from China", (with Xu liao and Zhao Yang), *Accounting & Finance*, 2020, 60(5):4795-4819. (第一作者, SSCI二区)

"Time-dependent volatility in futures contract options", (with Christian Ewald, Ali Kutan), *Investment Analysts Journal*, 2019, 48 (1):30-41. (第一作者, SSCI)

"Pricing commodity futures options in the Schwartz multi factor model with stochastic volatility: An asymptotic method", (with Christian Ewald), *International Review of Financial Analysis*, 52(2017), 144-151. (第一作者, SSCI一区)

"On the Performance of the Comonotonicity Approach for Pricing Asian Options in Some Benchmark Models from Equities and Commodities", (with Christian Ewald), *Review of Pacific Basin Financial Markets and Policies*, 20(2017), 1750005. (第一作者)

《基于三因子模型的沪铜期货定价研究》(与欧阳若澜,肖晓侠,谢咏红), *系统管理学报*, 02(2021),264-273. (通讯作者, CSSCI)

科研项目

2020浙江省自然科学基金探索项目基于模糊厌恶的农产品期权定价模型的研究, 主持

2017年度江西省高校人文社会科学重点研究基地招标项目Schwartz二因素模型在中国期货期权市场的应用, 主持

2018国家自然科学基金青年项目基于GAS模型的系统性金融风险测度及其在宏观经济预测中的应用研究, 参与

学术服务

Quantitative Finance 匿名审稿人

International journal of Economics and Finance 匿名审稿人

Accounting & Finance 匿名审稿人

Investment Analysts Journal 匿名审稿人

指导完成专业硕士研究生1名