# 黄卓学术简历

北京大学国家发展研究院助教授。黄卓老师于2011年1月获得斯坦福大学经济学博士学位后，加入北大国家发展研究院任教，曾获得斯坦福大学经济系“最佳博士生候选人论文奖”、北京大学曹凤岐金融发展基金“金融青年科研进步奖”、 青年教师教学基本功比赛二等奖、“优秀班主任”等奖励。2014 年获得应用计量经济学领域的国际权威期刊 Journal of Applied Econometrics 的“Richard Stone 最佳论文奖”。

研究领域：
应用计量经济学　金融计量学　实证金融学　能源和大宗商品市场

教授课程：

工作论文

A Generalized Autoregressive Score Model with Realized Measures of Volatility,(with Xin Zhang and Tianyi Wang), working paper 2014, submitted.

Realized EGARCH, Volatility Risk Premium and CBOE VIX (with Peter Hansen and Tianyi Wang), working paper 2014.

Volatility During the Financial Crisis Through the Lens of High Frequency Data: A Realized GARCH Approach (with Denisa Banulescu, Peter Hansen and Marius Matei)， working paper 2014.

Oil Markets and Price Movements: A Survey of Models, with Hillard Huntington, Saud M. Al-Fattah, Michael Gucwa and Ali Nouri, 2013. Available at SSRN: http://ssrn.com/abstract=2264034

“中国宏观经济异质信念和股票市场波动率的关系：基于‘朗润预测’的实证分析”，（与路磊、于超、沈诗涵合著），已投稿。

“波动率长记忆性建模：基于混频数据回归与已实现波动率的新模型”（与王天一、刘浩合著），已投稿。

“中国股票市场的加总特质性波动率”（与康辰合著），已投稿。

“Gram-Charlier 分布在动态金融高阶矩建模中的近似误差”（与王天一、李超合著），已投稿。

发表论文

Exponential GARCH Modeling with Realized Measures of Volatility (with Peter Hansen), Forthcoming at Journal of Business & Economic Statistics.

Modeling the Long Memory Volatility Using Realized Measures of Volatility (with Hao Liu and Tianyi Wang), Forthcoming at Economic Modelling.

The Spirit of Capitalism and the Equity Premium, (with Qin Wang, Yiheng Zou and Yu Ren), Annals of Economics and Finance, Vol. 16, Issue 2, November 2015.

Is There a Structural Change in the Persistence of WTI-Brent Oil Spreads in Post-2010? (with Wei Chen and Yanping Yi), Economic Modelling , Volume 50, November 2015 .

Estimation of Extreme Value-at-Risk: An EVT Approach for Quantile GARCH Model, (with Yanping Yi and Xingdong Feng), Economics Letters, Volume 124, Issue 3, 2014.

Oil Price Drivers and Movements: The Challenge for Future Research, (with Huntington, Hillard, Al-Fattah, Saud M., Gucwa, Michael and Nouri, Ali), Alternative Investment Analyst Review, Vol. 2, Issue 4, 2014.

Realized GARCH: A Joint Model of Returns and Realized Measures of Volatility (with Peter Hansen and Howard Shek), Journal of Applied Econometrics, Vol. 27, No. 6, 2012.

Winner of the Richard Stone Best Paper Prize for the two years of 2012-2013 at Journal of Applied Econometrics

Ownership Restructuring, Marketization and Wealth Inequality in Urban China: 1995 and 2002 (with Xiaobin He), China & World Economy, Vol. 20, No. 5, 2012.

The Relationship between Volatility and Trading Volume in the Chinese Stock Market: A Volatility Decomposition Perspective (with Tianyi Wang), Annals of Economics and Finance, Vol. 13, No. 1, 2012.

“动态金融高阶矩建模：基于 Generalized-t 分布和 Gram-Charlier 展开分布的比较研究”（与李超合著），《中国管理科学》，2015 年第 10 期。

“Realized GAS-GARCH 模型及其在 VaR 预测中的应用”（与王天一合著），《管理科学学报》，2015 年第 5 期。

“利用高频数据预测沪深 300 指数波动率——基于 Realized GARCH 模型的实证研究”，（与王天一、赵晓军合著），《世界经济文汇》，2014 年第 5 期。

“中国股票市场的风险收益关系研究——基于波动率反馈和 APARCH-NIG 模型的新视角”（与王天一、刘浩合著），《浙江社会科学》，2014 年第 10 期。

“中国能源体制改革：有效的市场，有为的政府”，（与王敏、徐晋涛合著），《国际经济评论》，2014 年第 4 期。

“高频农产品期货波动率和相关性预测：基于 Realized Copula-DCC 模型的视角”，（与黄雯、王天一合著），《浙江社会科学》，2013 年第 5 期。

“空间经济学在中国，”（与梁琦合著），《经济学季刊》，2012 年第 3 期。

“高频数据波动率建模：基于厚尾分布的 Realized GARCH 模型，”（与王天一合著），《数量经济技术经济研究》, 2012 年第 5 期。

“基于高频数据的波动率建模及应用研究评述，”（与王天一合著），《经济学动态》，2012 年第 3 期。

“‘碳关税’与贸易保护主义是一回事吗？”《国际经济评论》 2011 年第 5 期。《中国社会科学文摘》2012 年第 2 期转载。

“IPO 初始回报与风险投资参与—基于我国创业板的实证研究”（与刘媛媛、何小锋合著），《当代经济科学》，2012 年第 2 期。

“公司治理理论前沿综述”，（与姚伟、郭磊合著），《经济研究》 2003 年第 5 期。