

Curriculum Vitae

刘振涛

副教授

厦门大学财务管理与会计研究院 Tel: +86-592-218 7351

电话:

传真:+86-592-218 1787

工作经历

2007/09-至今: 厦门大学财务管理与会计研究院

1993/6-1998/2: 延边对外贸易进出口公司

1986/9-1993/5: 开山屯化学纤维浆厂

教育经历:

2003/04-2007/07: 日本一桥大学大学院, 经济学博士

2001/04-2003/07: 日本一桥大学大学院, 经济学硕士

1993/09-1997/07: 吉林大学日本研究所, 经济学硕士

1982/09-1986/07: 大连轻工业学院, 化学纤维专业

教授课程:

微观经济学, 宏观经济学, 计量经济学, 数据库与 SAS 编程, 风险管理, 数量分析

研究:

英文文章:

Asako, K. and **Zhentao Liu**. Comovement of Stock Markets—An Analysis by Nonlinear Cointegration. *Open Journal of Social Sciences*, 2016,4, 62-73.

Dong Yan, **Liu Zhentao**, Sun Qian, Shen Z, Political patronage and capital structure in China, *Emerging Markets Finance and Trade*, 2014,50(3), 102-125.

Zhentao Liu, Gilbert V. Nartea and Ji Wu, 2013, Does Idiosyncratic Volatility Matter in Emerging Markets? *Journal of International Financial Markets, Institutions & Money, Forthcoming*, 27:137 - 160.

Kazumi Asako, **Zhentao Liu**, 2013, A Statistical Model of Speculative Bubbles, with Applications to the Stock Markets of the United States, Japan, and China. *Journal of Banking and Finance*, vol.37, 2639-2651

Liu Zhentao, and Kazumi Asako, 2011, A Disequilibrium Analysis of the Japanese Loan Market: Were the Post-Bubble Periods in Disequilibrium? *Hitotsubashi Journal of Economics*, 52(1), 87-111

Liu, Zhentao, and Kazumi Asako, 2009, Transfiguration of the Foreign Exchange Market -

Since the Euro Introduction, *Applied Financial Economics*, 19, 1803-1812

Liu Zhentao, 2008, Testing the liquidity effect with equilibrium interest rate, *Applied Economics*, 40, 1529-1535

日文文章:

浅子和美, Spencer Christopher, **刘振涛**, 2015, 金融政策の目標と政策決定過程, 日刊《经济研究》, 66(2): 97 - 114。

浅子和美, 张艳, **刘振涛**, 2014, 日米中株式市場の連動性 : 非線形共和分の検証, 日刊《经济研究》, 65(1): 56-85。

张艳, **刘振涛**, 2013, 世界金融危機下の日中米株式市場の比較分析, ゆうちょ資産研究, 第 20 卷, 75-106。

劉振濤, 浅子和美, 加納悟, 投機的バブルの推計—日米中の株式市場への応用, (2011 年 12 月), 浅子和美・渡部敏明 (編), 『ファイナンス・景気循環の計量分析』(ミネルヴァ書房), 第 1 章 9-34 頁。

中文文章:

刘振涛、左浩苗、张振轩, 2012, 泡沫变化过程的动态贝叶斯模型研究, 《管理科学学报》, 第 15 卷第 9 期 74-83 页。(一级核心期刊)

左浩苗、**刘振涛**、曾海为, 2012, 基于高频数据的股指期货与现货市场波动溢出和信息传导研究, 《金融研究》, 第 4 期(总第 382 期)140-154 页。(一级核心期刊)

左浩苗、**刘振涛**, 2011, 跳跃风险度量及其在风险-收益关系检验中的应用, 《金融研究》第 10 期 170-184 页。(一级核心期刊)

沈哲、**刘振涛**, 2010, 欧元导入后外汇市场的特征变化, 《统计研究》第 4 期 58-61 页。(一级核心期刊)

工作论文:

Worldwide Inflation Arose from China

Sports Sentiment and Pricing Efficiency, co-authored with Fei Wu and Bohui Zhang

Price Co-Movement Among Stock Markets of U.S., Japan and China, co-authored with Kazumi Asako, in Japanese.

Financial Transaction Cost and Dual-List

Dynamic Jump Risk and Asset Pricing