

一级学科：应用经济
学科方向：金融学

北京理工大学

青年教师学术启动计划

项目执行报告

项目名称：	青年教师学术启动计划
项目负责人：	吕鑫
所在学院：	管理与经济学院
项目学科类别：	文科
联系电话：	68918843
填报日期：	2017.10.24

北京理工大学人事处制

二〇一三年十一月

二. 项目进展情况

1、项目的具体研究进度

首先,本课题揭示了中国股票市场与国际原油价格相关关系背后的经济学含义及理论,并比较了适用中国的股票市场理论与传统文献中欧美股票市场理论的异同。其次,本课题基于极值理论更加准确的拟合国际原油市场的波动对中国股票市场的影响。此外,本研究课题对2008年金融危机后中国股票市场与国际能源市场关系进行了再验证,研究结论有益于投资者更加准确理解市场风险收益状况,从而构建有效的投资组合。课题研究内容申请了国家自然科学基金青年项目,并发表了SSCI检索论文。

2、阶段性成果

① 国家自然科学基金青年项目

基于TVP-BVAR模型的国际油价波动对我国股市复杂传导机制研究(71603021)

② 发表2篇SSCI检索论文

[1]Qian Chen, Xin Lv. <The Extreme-value Dependence between the Crude Oil Price and Chinese Stock Markets>. International Review of Economics and Finance (SSCI), 39, 121-132, 2015

Beijing Institute of Technology Fund Program for Yong Scholars. (No. 3210012261404)

[2]Xin Lv, Weijia Dong, Fang Fang.<The Asymmetric Effects of Official Interest Rate Changes on China's Stock Market during Different Market Regimes>. Emerging Markets Finance and Trade (SSCI), 51(4),826-841, 2015

3、经费使用情况

科研经费预算已全部完成。

4、遇到的问题

在数据测算和数据模型计量的过程中,实验室一些软件程序存在不匹配的情况,之后经过和同行交流解决了相应问题。

三. 目前正在承担的主要科研任务

项目编号	项目名称	经费(万元)	起止年月	负责或参加	项目来源
71603021	基于 TVP-BVAR 模型的国际油价波动对我国股市影响的传导机制研究	18	2017.01-2019	负责	国家自然科学基金
16JDYJC014	北京新能源汽车鼓励消费政策及其效果评估	5	2016.7-2018.6	负责	北京市社会科学基金研究基地项目
3210012211712	国际油价波动对我国股市的影响：基于石化行业特殊性的研究	10	2017.1-2018.12	负责	北京理工大学基础基金
71521002	能源经济与气候政策创新群体	700	2015.01-2020.12	参与	国家自然科学基金
2016ZX05031-004	美洲地区超重油及油砂一体化经济评价与经营策略研究	69	2016.1-2020.12	参与	国家科技重大专项课题

四. 重要论著及被引用情况

论文、专著名称	年份	学术期刊或出版社名称	收录情况	卷(期)	页	作(著)者名次	引用次数
The extreme-value dependence between the crude oil price and Chinese stock markets	2015	International Review of Economics & Finance	SSCI 收录	39	121-132	通讯作者	12
The Asymmetric Effects of Official Interest Rate Changes on China's Stock Market during Different Market Regimes	2015	Emerging Markets Finance and Trade	SSCI 收录	51 (4)	826-841	第一作者	2

“收录情况”请注明被 SCI、EI、核心期刊收录情况，如被 SCI 收录，请注明影响因子。

五. 授权发明专利

专利名称	授权专利号	年份	授权国家或地区	本人名次	经济效益(万元)

六. 获奖目录

获奖项目名称	奖励类别(等级)	授予单位	获奖时间	本人排名