**刘薇个人简历**

**电话:**13333111336

**邮箱**:silvia@cueb.edu.cn

**工作经历**:

**助理教授, 首都经济贸易大学, 国际经济管理学院**  **2019.9-至今**

**教育背景**：

**金融学博士， 英国曼彻斯特大学 2015.9-2019.9**

**经济学硕士, 英国曼彻斯特大学 2012.9-2014.9**

**金融经济学硕士， 英国诺丁汉大学 2010.9-2011.9**

**研究方向**： **资产定价, 金融工程，宏观计量，金融时间序列，风险预测。**

**发表论文**： (※ **代表第一作者**, ⁑ **代表通讯作者**)

[1]“Regime-dependent effects of macroeconomic uncertainty on realized volatility in the U.S. stock market”

Authorship: Wei Liu※ ⁑and Ian Garrett

***Economic Modelling***  2023, 128:106483.

**在审论文：**(※ **代表第一作者**, ⁑ **代表通讯作者**)

[1]“Forecasting Realized Volatility With Tree-Based HAR-Type Models Incorporating Macroeconomic Uncertainty.”

Authorship: Wei Liu※ (CUEB), Wen Xu⁑ (CUEB) and Ian Garrett (UoM)

R&R at ***Journal of Forecasting***.

[2]“Option Valuation using Macroeconomic Uncertainty: A Realized Volatility Approach.”

Authorship: Shuwen Yang※ (USTB), Wei Liu⁑ (CUEB) and Ian Garrett (UoM)

R&R at ***Journal of Empirical Finance***.

[3]“The Macroeconomic Determinants of Stock Market Volatility: An International Study with The Consideration of Economic Policy Uncertainty .”

Authorship: Wei Liu※⁑ (CUEB) and Yao Wang (Jinan University)

R&R at ***Economic Modelling***.

[4] “How Does EPU Affect The Dynamic Macro-volatility relationship? Analyses Using A Tree-based GARCH-MIDAS Model. ”

Authorship: Jingyi Meng※ (Nankai University), Wei Liu⁑ (CUEB)

R&R at ***Applied Economics Letters***

[5] “Corporate Debt Concentration and Total Factor Productivity. ”

Authorship: Wei Liu※ (CUEB), Zilong Song⁑（NUFE）

Submitted to ***International Review of Economics & Finance*** Under Review.

**工作论文**：(※ **代表第一作者**, ⁑ **代表通讯作者**)

[1] “Analysts’ Conditional Biases and the Cross Section of Corporate Bond Returns.”

Authorship: Shuwen Yang※ (USTB), Wei Liu⁑ (CUEB)

Target paper: ***Journal of Financial and Quantitative Analysis***

[2] “ The Role of Information Flow of Media Coverage on Dynamic Jumps in the U.S. Stock Market ”

Authorship: Wei Liu※ (CUEB), Yiyuan Sun⁑ (Jinan University)

Target paper: ***Review of Finance***

**教学经历**：

**2021-2022, 金融计量学(英语) 国际经济管理学院**

**2020-2021，金融计量学(英语) 国际经济管理学院**

**2019-2020, 金融数据分析(英语) 国际经济管理学院**

**科研项目**：

**[1]. 国家自然科学基金面上项目（72373106）, 带有交互效应的高维离散选择模型:理论研究及其应用, 2024,01-2027,12, 参与人。**

**[2]. 国家社科基金一般项目(23BGL293), 商业医疗保险的功能定位与作用机制研究， 2023,01-2026,12, 参与人。**

**[3]. 国家社会科学基金委员会，特别委托项目 (2020MYB019), 加快完善社会主义市场经济体制研究， 2020,01-2020,06，子课题参与人。**

**[4]. 首都经济贸易大学新入职青年教师科研启动基金 (XRZ2020028)。**

**荣誉奖励**：

**[1]最佳文章摘要奖 曼彻斯特大学 2016**

**[2]经济系学生奖学金 曼彻斯特大学 2013-2014**

**学术会议**：

**[1]. 2017 第3届宏观经济与金融国际会议， 马其顿大学**

**[2]. 2018 第11届国际管理风险大会, 里昂商学院， 巴黎第九大学**

**[3]. 2018 第25届金融市场预测会议, 塞德商学院, 牛津大学**

**[4]. 2018 英国皇家经济学会博士会议, 威斯敏斯特大学**

**[5]. 2019 亚洲经济计量年会(AMES), 厦门大学**

**备注：**

**Capital University of Economics and Business (CUEB)**

**University of Manchester (UoM)**

**University of Science and Technology Beijing (USTB)**

**Nanjing University of Finance & Economics (NUFE)**