

姚京

副教授

地址：复旦大学金融研究院，上海市邯郸路 220 号

邮编：200433

Email: yaojing@fudan.edu.cn

研究兴趣

行为金融学，金融风险管理，文化差异

教育背景：

2004.09—2007.07	经济学博士，金融学专业，中山大学岭南学院
2001.09—2004.07	经济学硕士，金融学专业，中山大学岭南学院
1997.09—2001.07	经济学学士，国际金融专业，中山大学岭南学院

学术经历

2014.12—至今	复旦大学经济学院金融研究院	副教授
2008.10—2014.12	复旦大学经济学院金融研究院	讲师
2010.07—2010.08	香港中文大学系统工程与工程管理系	访问学者
2007.08—2008.07	香港中文大学系统工程与工程管理系	博士后
2005.11—2006.10	香港中文大学系统工程与工程管理系	研究助理

讲授课程

行为金融学，金融经济学，金融风险管理，时间序列分析方法，投资与风险

发表论文

[1] Yun Shi, Xiangyu Cui, Jing Yao and Duan Li (2015). Dynamic trading with reference point adaptation and loss aversion, *Operations Research* (SSCI). Forthcoming.

- [2] Jing Yao and Duan Li (2013). Prospect theory and trading patterns, *Journal of Banking and Finance* (SSCI), 37(8): 2793-2805.
Cited by *Handbook of the Economics of Finance*, 2013
- [3] Jing Yao and Duan Li (2013). Bounded rationality as a source of loss aversion and optimism: A study of psychological adaptation under incomplete information, *Journal of Economic Dynamics and Control* (SSCI), 37(1): 18-31.
- [4] 姚京, 严坤, 李端 (2013). 基于电视游戏节目的香港居民风险决策分析. 《管理科学学报》16 (10) : 1-10.
- [5] 黄琼, 朱书尚, 姚京 (2011). 投资组合策略的有效性检验: 基于中国市场的实证分析. 《管理评论》7: 3-10.
- [6] 姚京, 李仲飞 (2010). 从管理风险的角度看金融风险度量, 《数理统计与管理》4: 736-742.
- [7] Zhongfei Li, Jing Yao, Duan Li. (2010). Behavior patterns of investment strategies under Roy's safety-first principle, *Quarterly Review of Economics and Finance* (Finance Literature Index), 50(2): 167-179.
- [8] 姚京, 袁子甲, 李仲飞, 李端. (2009). VaR 风险度量下的 Beta 系数: 估计方法和实证研究. 《系统工程理论与实践》(EI), 29 (7): 27-34.
- [9] 袁子甲, 李仲飞, 姚京. (2007). 卖空限制下的期权定价研究: 效用等价方法. 《中国金融学》, 13: 112-124.
- [10] 李仲飞, 颜至宏, 姚京, 樊婷婷, 常琳 (2007). 从风险视角解析中航油事件. 《系统工程理论与实践》(EI), 2007, 27(1): 23-32.
- [11] Jing Yao, Zhongfei Li, and Kai W. Ng (2006). Model risk in VaR estimation: An empirical study. *International Journal of Information Technology and Decision Making* (SCI). 5(3): 503-512.
- [12] 姚京, 袁子甲, 李仲飞. (2006). 组合投资与不对称风险: 基于 VaR 的风险-收益分析. 《中国金融学》, 4(2): 58-76.
- [13] 姚京, 袁子甲, 李仲飞. (2005). 基于相对 VaR 的资产配置和资本资产定价模型. 《数量经济技术经济研究》, 22(12): 133-142.
- [14] 姚京, 李仲飞. (2005). VaR 估计中的模型风险---检验方法与实证研究. 《管理

评论》，17(10): 3-7.

[15] 姚京, 李仲飞. (2004). 基于 VaR 的金融资产配置模型.《中国管理科学》，12(1): 8-14.

[16] 李仲飞, 姚京. (2004). 安全第一准则下的动态资产组合选择.《系统工程理论与实践》(EI)，24(1): 41-45.

[17] 李仲飞, 姚京. (2004). 中国沪深股市整合性的实证分析.《管理评论》，16(1): 27-30.