一、个人信息

蒋祥林 1974 年 4 月出生于广西全州县。

教育背景:

2000 年 3 月 – 2003 年 7 月 天津大学管理学系博士研究生
(2003 年 9 月获天津大学管理学博士学位)

1997 年 9 月 – 2000 年 2 月 天津大学管理学系硕士研究生

1993 年 9 月 – 1997 年 7 月 中南大学应用物理学系本科生

学术经历及职务:

2004 年 3 月 – 2006 年 4 月 复旦大学金融研究院 讲师

2006 年 5 月 – 2010 年 8 月 复旦大学经济学院金融研究院 副研究员

二、教学与科研研究领域

主要研究方向: 金融工程 资本市场理论与实证

近期教学经历: 金融工程学、证券投资分析 (本科生)、固定收益证券及其衍生品、金融工程学、金融时间序列分析 (硕士研究生)

三、主要科研成果:

(1) **著作:** 《诊断与治疗——揭示中国的股票市场》, (成思危主编) 第一章、第二章, 经济科学出版社, 2004 年

(2) 论文:

- [1] 蒋祥林, 吴晓霖, 阳桦. 上海、伦敦铜期货市场价格互动关系演变.《统计与决策》, 2009 年 11 月
- [2] 安俊英、蒋祥林(通讯作者). 基于下方风险的套期保值.《系统工程》, 2007 年 8 月
- [3] 蒋祥林, 杨建林. 当前环境下我国信托公司业务创新研究.《中国软科学》2007 年 10 月
- [4] 蒋祥林, 王春峰. 中国股市信息流、波动性与交易量关系.《系统工程理论方法应用》, 2005 年 2 月
- [5] 蒋祥林, 王春峰. 基于贝叶斯原理的随机波动率模型及其应用.《系统工程》, 2005 年 10 月
- [6] 蒋祥林, 王春峰. 基于 SWARCH 的 VaR 及压力测试值的一致性估计.《管理科学》, 2005 年 2 月
- [7] 蒋祥林, 王春峰. 基于状态转移 ARCH 模型的中国股市波动性研究.《系统工程学报》, 2004 年 6 月
- [8] 蒋祥林. 中国股市波动与交易量关系研究--基于混合分布假定.《山西财经大学学报》, 2004 年 6 月
- [9] 蒋祥林. 基于日内价格幅度与回报的随机波动率模型.《系统工程》, 2006 年 6 月
- [10] 王春峰, 蒋祥林 (通讯作者). 中国股市的内幕交易及监管——国际经验与中国的对策.《国际金融研究》, 2003 年 6 月

[11] 王春峰, 蒋祥林 (通讯作者). 基于随机波动性模型的中国股市波动性估计. 《管理科学学报》, 2003 年 8 月

[12] 王春峰, 蒋祥林 (通讯作者). 随机波动性模型的比较分析. 《系统工程学报》, 2005 年 4 月

[13] 蒋祥林, 王书林. 破产机制与破产程序的经济分析. 《中国软科学》, 1999 年 5 月

[14] 徐明东, 蒋祥林. 资本约束对商业银行信贷扩展行为的影响. 中国国际金融学年会, 清华大学中国金融研究中心、中山大学岭南经济学院联合主办, 广州 2009 年 7 月

(3) 项目:

- (1) 国家自然科学基金项目: 资本监管下的商业银行行为及其宏观经济效应研究(项目批准号: 70503006), 项目负责人。
- (2) 上海市哲学社会科学规划基金项目: 体制转换时间序列模型及其应用研究(项目批准号: 2005BJB002), 项目负责人。
- (3) 教育部人文社会科学规划项目: 国内外衍生品市场对我国战略性大宗商品和金融资产国际定价权的影响研究 (项目批准号: 06JC790009), 项目负责人。
- (4) 国家杰出青年基金项目: 证券市场的波动性、流动性及价格行为研究 (王春峰主持, 项目批准号: 70225002), 项目参加人。
- (5) 国家自然科学基金项目: 基于 Support Vector Machines(SVM)算法的智能型期权定价模型研究 (曹丽娟主持,项目批准号: 70501008), 项目参加人。

四、获奖及荣誉

上海金融学会会员

五、学术交流

已获得国家留学基金委资助, 计划于 2010 年 10 月-2011 年 10 月到美国马里兰大学商学院和环境与建筑工程学院做访问学者, 从事金融衍生品、碳金融领域的研究。