

徐凌

副教授、硕导

办公室：文理楼427

电话：0532-86981324

Email: lingxu@upc.edu.cn

研究兴趣

财务管理理论与实务

金融市场

金融工程

风险管理与风险控制

非线性滤波理论

主讲课程

本科生《统计》、《统计分析与统计软件》等

研究生《管理研究计量工具》

教育经历

2010, 德国马普研究所和莱比锡大学联合培养, 博士

2003, 天津大学, 理学, 硕士

2000, 天津大学, 理学, 学士

主持课题

2015.01至2017.12: 国家自然科学基金项目《不完全信息下信用风险的建模, 定价以及对冲—基于非线性滤波理论》 主持

2014.02至2016.12: 教育部人文社会科学研究项目《不完全市场信息下信用风险模型的研究》 主持

2013.07至2015.07: 教育部归国留学基金项目《由扩散和泊松观测过程驱动的Zakai方程的Galerkin数值解及其在信用风险中的应用》 主持

2014.09至2016.08: 教学研究与改革项目《经管专业理工类课程分级分类教学的研究与实践——以《统计学》课程为例》 主持

2011.04至2014.12: 中国石油大学(华东)自主创新科研计划项目《由扩散和泊松观测过程驱动的Zakai方程的Galerkin近似解》 主持

发表论著

- [1] T. Schmidt and L. Xu. “Some Limit Results on the Haar-Fisz Transform for Inhomogeneous Poisson Signals”, 2008. Journal for Analysis and its Applications 27 No. 4, 475 – 489.SCI
- [2] R. Frey, T. Schmidt and L. Xu, 'On Galerkin Approximations for the Zakai Equation with Diffusive and Point Process Observations', 2013, SIAM Journal of Numerical Analysis 51 (4), pp. 2036-2062. SCI二区
- [3] 徐凌,刘嘉焜,李亮. 自相似网络流量Hurst指数估计算法[J]. 科学技术与工程(北大中文核心). 2013(20)
- [4] 徐凌,李雷鸣,李进. 国际原油市场量价关系的分阶段研究——基于线性与非线性Granger因果关系检验[J]. 价格理论与实践(CSSCI, 北大中文核心). 2014(07)
- [5] 徐凌,王爱东. 德国高等教育特色及启示[J]. 人民论坛(北大中文核心). 2014(19)
- [6] 徐凌,许增坤,李亮. 基于EVA会计利润的财务危机预警研究[J]. 财会通讯(北大中文核心). 2014(03)
- [7] 徐凌,马逢时. 六西格玛设计中的标准差计算. 统计与决策(CSSCI, 北大中文核心). 2014(22)