

# 李 建 栋

助理教授

中央财经大学-中国金融发展研究院

北京市海淀区学院南路 39 号, 邮编: 100081

电话: 010-62288469

手机: 15801269179

电子邮件: [jiandongli@cufe.edu.cn](mailto:jiandongli@cufe.edu.cn), [jiandongli@hotmail.com](mailto:jiandongli@hotmail.com)

## 教育背景

- 德雷克塞尔大学(Drexel Univ), 商学院 (美国费城) 2007 年 5 月  
博士, 金融学
- 印第安纳大学(Indiana Univ), 商学院 (美国印第安纳州布鲁明顿市) 2002 年 5 月  
工商管理硕士, 金融专业
- 清华大学, 汽车工程系 1996 年 6 月  
工学硕士, 内燃机专业
- 清华大学, 汽车工程系 1993 年 6 月  
工学学士, 内燃机专业

## 出版专著

1. 《佛法求财: 佛法中的财富智慧》, 企业管理出版社, 2011 年 8 月出版。
2. 《认识价值论》, 中国经济出版社, 2010 年 4 月出版。
3. 《股指期货从入门到精通》, 企业管理出版社, 2010 年 3 月出版。

## 出版章节 (中文)

1. 《汇市中可以预测股市的信息, 中国市场的证据》, 2013 年。
2. 《收益率的非线性模型》, 《西方人文社科前沿述评: 金融学》中的第四章。  
Dongmin Ke, Huimin Li 编, 中国人民大学出版社, 2011 年 10 月出版, 第 85-113 页。
3. 《农村金融与农产品期货》, 《中国农村金融风险若干问题研究》的第四章, 中国社会科学出版社, 2011 年 6 月出版, 第 69-97 页。

## 发表期刊论文(中文)

1. 卖空者是否提前获悉年度公报的信息[J]. 浙江金融, 2013 (8), 52-56.
2. “钱荒”怎么来的? [J]. 现代商业银行, 2013 (8), 22-25.
3. 股市卖空的理论与实践[J]. 浙江金融, 2012 (8), 52-55.
4. 成本真的能淹没吗? [J]. 浙江金融, 2012 (7), 77-78.
5. 中国城市居民的信任格局及社会资本的影响[J]. 中国社会科学, 2012 (5), 131-148.
6. 基于价值创新的三种基本盈利模式[J]. 企业管理, 2012 (5), 62-63.
7. 发现价值: 四种基本盈利模式[J]. 企业管理, 2012 (4), 60-62.
8. 顺藤摸瓜发现新盈利点[J]. 企业管理, 2012 (3), 52-53.
9. 有了“关系”就有利润吗? [J]. 企业管理, 2012 (2), 55-57.

10. 文化产业投资: 通向何方[N]. 瞭望东方周刊, 2011(50), 54-56. 同时刊载于 今晚报, 2011年12月11日第11版面
11. 从日元国际化道路看人民币国际化[J]. 广西财经学院学报[J], 2011(4), 46-49.
12. “一站式”服务是现代服务业的根本特征[N]. 瞭望东方周刊, 2011(1), 65-67.
13. 中国市政债券政策初探[J]. 中国金融, 2010(8), 75-76.
14. 股票拆分和股票红利原因及其影响[J]. 新金融, 2010(3), 36-41.
15. 取消抵押房产赎回程序介绍[J]. 经济问题, 2009(12), 36.

### 发表期刊论文(英文)

1. Time varying correlations of stock-bond returns and financial market uncertainty: Evidence from advanced markets. *Review of Quantitative Finance and Accounting*, forthcoming
2. Dynamic herding behavior in Pacific-Basin markets: Evidence and implications. *Multinational Finance Journal*, 2013.
3. Stock returns and risk: Evidence from quantile regression analysis. *Journal of Risk and Financial Management*, Vol 5, 2012, 20-58.
4. Does herding behavior in Chinese markets react to global markets? *International Review of Accounting, Banking and Finance*, Vol 4, No. 1, 2012, 73-95.
5. Empirical investigation of herding behavior in Chinese stock markets: Evidence from quantile regression analysis, *Global Finance Journal*, 21(2010), 111-124.

### 出版章节(英文)

1. “Modeling Asset Returns with Skewness, Kurtosis, and Outliers”是“Handbook of Financial Econometrics and Statistics”中第80章。Cheng-Few Lee 编, Springer 出版社, 2013年(待出版)。
2. “Stock Returns, Extreme Values, and Conditional Skewed Distribution”是“Handbook of Quantitative Finance and Risk Management”中第55章。Cheng-Few Lee, Alice C. Lee, John Lee 编, Springer 出版社, 2010年6月出版, 第853-862页。

### 发表会议论文集(英文)

1. Determinants of Stock Return Volatility: A Perspective of Belief Trading, *American Eastern Finance Association 42<sup>nd</sup> annual meeting proceeding*, 2006, Philadelphia.
2. Time Varying Betas and Trading Volume. *American Midwest Finance Association 55<sup>th</sup> annual meeting proceeding*, 2006, Chicago.

### 工作论文

1. The Information Content of Short Sales and Stock Return Characteristics.
2. Twice stock dividend effect and negative reaction on the ex-date in Chinese markets.
3. The Puzzle of block trading premium in the Chinese market.
4. Incorporate higher order conditional moments into stock return modeling: Evidence from 5 stock indexes.
5. 样本内外分析透视中国股市的预测性。
6. 芝诺悖论的完备性。
7. 上市公司进行股票红利的动机探讨。

## 主持项目

- 不同量价动态关系的原因：宏观政策与公司特性  
(教育部留学归国人员科研启动基金项目)
- 基于面板数据的融券市场卖空行为内生性研究  
(教育部基金项目)

## 参与项目

- 商业银行物流金融信用风险的度量与防范研究：基于 COPULA 理论视角的分析性  
(国家自然科学基金项目)

## 媒体

- “文化创造价值：文化三性”，中国文明网-文明评论，2012 年 3 月 9 日，  
[http://www.wenming.cn/wmpl\\_pd/yczl/201203/t20120309\\_547973.shtml](http://www.wenming.cn/wmpl_pd/yczl/201203/t20120309_547973.shtml)。
- “公司季报前卖空研究”，超星学术视频知名学者学术专题片  
([www.ssvideo.cn](http://www.ssvideo.cn))，2011 年 11 月。
- “the 2<sup>nd</sup> Anniversary of ChiNext”，panel discussion of “Today” show,  
English Service, 中国国际广播电台 (CRI)，2011 年 10 月 12 日。
- “新股发行改革更进一步”，《中国投资》2010 年第 11 期，第 101-103 页。

## 教学

- 高级公司理财 (研究生水平, MBA)
- 公司理财 (本科生水平)
- SAS®编程
- 投资学
- 金融风险管理

## 学术事务

- 杂志编委会成员：Journal of Business and Finance (ISSN: 2305-1825) .
- 审稿人：Journal of International Financial Markets, Institutions & Money. Quantitative Finance. etc.

## 学术讲座

- 亚太国家经济与金融挑战与问题国际会议，成都，2012
- 中国农村金融问题高端论坛，北京，2011
- 第十八届亚太金融、经济、会计与管理会议 PBFEM 2010, 北京，2010
- 第一届海峡两岸金融工程与风险管理研讨会 FERM 2010, 台北，2010
- 北京大学光华管理学院 讲座，北京，2010
- 亚太经济联合会 (APEA) 第 4 届年会，北京，2009
- 人民大学第 2 届“五星”会议，北京，2009
- 美国巴黎大学 (AUP) 讲座，巴黎，2008
- 韩国 Yonsei 大学讲座，汉城，2008
- 《改革》杂志社 20 年周年论坛，北京，2008

## 社会讲座

- 传统中的财富智慧，2012年1月，“黄金珠宝产业论坛”，深圳。
- 金融市场现状与发展，2011年7月，新华保险江西分公司管理干部研讨班，宜春。
- 现代金融系统的风险管理，2010年12月，农发行湖南省分行高级培训班，北京。
- 中国金融市场改革与现状，2010年9月，香港高级公务员培训班，北京。
- 结构化融资与中国市场，2009年12月，深圳企业家迎春会，深圳。
- 银行内部控制，2009年8月，安徽省农村发展银行行长班，合肥。
- 金融危机的原因与影响，2009年5月，江西省农信社高级金融培训班，井冈山。

## 工作经历

- |  |           |
|--|-----------|
| IHT 交易公司（美国印第安那波利斯市）交易员                | 2002-2003 |
| • 分析测试股票自动交易系统                         |           |
| 康富-英格尔投资公司（北京）销售经理                     | 1999-2000 |
| • 负责销售和技术支持法国西电 SDMO 发电机组。             |           |
| 申克公司（北京）应用工程师                          | 1998-1999 |
| • 负责销售汽车下线检测设备和汽车加液设备。                 |           |
| 中国国际科学中心（北京）项目经理                       | 1996-1998 |
| • 承担世界银行项目“中国机动车污染控制对策研究”的组织工作。        |           |
| • 承担 CATEC97，第一届中国国际汽车环保技术展览会暨研讨会组织工作。 |           |

## 培训咨询

- “人居环境论坛-范例新城”拓展项目，2010年9月。
- 江西省农村信用合作社高级金融培训班，南昌，2009年5月。
- 中国金融发展研究院与澳洲纽卡斯尔大学联合培养硕士项目，2008年-2009年。
- 广州市开发区工业发展集团有限公司上市项目，2008年。
- 广州市花城制药厂股份改造项目，2008年。
- 广州市恢复与发展期货交易市场可行性报告，2007年。

## 社区服务

- 中央财经大学中国金融发展研究院党总支委员，2012。
- “中国生态道德教育促进会”第四次代表大会理事，2010。
- 指导学生参加“中国互联网协会建行‘e路通’杯第三届全国大学生网络商务创新应用大赛”，获得北京赛区金融与支付主题赛一等奖，以及全国三等奖。同时获得“优秀指导老师奖”，2010。
- 中央财经大学本科生生活指导教师，2007-至今
- 中国金融发展研究院院长助理，2007-2009
- Drexel 大学中国学生联合会委员，2004-2005
- 清华大学汽车工程系研究生党员支部书记，1995-1996
- 清华大学第十四届校研究生会副主席，1993-1994

## 其它

- 博客：<http://blog.sina.com.cn/jack46224>