

汤银芬简历

个人基本信息

汤银芬，上海财经大学理学博士，2018年8月起任上海立信会计金融学院/统计与数学学院讲师。邮箱：tangyinfen@lixin.edu.cn

研究方向：

应用概率和统计；金融计量；高频及超高频金融数据统计推断

教育背景

2007.9–2011.6, 南京林业大学，轻化工程学院，制浆造纸专业，工学学士

2012.9–2014.6, 上海财经大学，统计与管理学院，数理统计学专业，经济学硕士

2014.9–2018.8, 上海财经大学，统计与管理学院，金融统计与风险管理专业，理学博士

工作经历

2018年8月–至今，上海立信会计金融学院，统计与数学学院，讲师

代表性研究成果和学术奖励情况：

1、期刊论文

科研论文：

- [1] **Tang, Y.** and Zhang, Z., 2019. A Combined Filtering Approach to High-Frequency Volatility Estimation with Mixed-Type Microstructure Noises. *Applied Stochastic Models in Business and Industry*. 35:603–623.
- [2] **Tang, Y.**, Peng, Y. and Zhang, Z., 2022. Trading information, price discreteness, and volatility estimation. *Journal of Statistical Planning and Inference*. 220:49–70.
- [3] **Tang, Y.**, Su, T. and Zhang, Z., 2022. Distribution-free specification test for volatility function based on high-frequency data with microstructure noise. *Metrika*, 85: 977-1022.
- [4] Tan, Y., Tan, Z., **Tang, Y.** and Zhang, Z., 2024. Functional volatility forecasting. *Journal of Forecasting*, 1-26
- [5] Peng, Y., Tan, Y., Tan, Z., **Tang, Y.*** and Zhang, Z., 2025. Two-Component Realized Mixture of Distribution Hypothesis*. Working paper.
- [6] Su, T., **Tang, Y.** and Zhang, Z., 2025. Calendar Effect in Volatility and Microstructure Noise. Working paper.

教学论文:

- [1] 汤银芬. 《Python 金融大数据分析》课程教学研究[J]. 时代金融. 2021(05)
- [2] 汤银芬. 统计学课程教学与思政教育结合的研究[J]. 中国多媒体与网络教学学报. 2021(03)

2. 项目参与情况

- (1) 主持 1 项校级科研项目 “金融高频大数据下的风险推断”
- (2) 参与 1 项国家社会科学基金项目 “非平稳时间序列的半参数分位数统计推断及其在经济和金融分析中的应用”

主讲课程:

时间序列分析、金融大数据分析、统计学、统计学实践、非参数统计等