

## 大会邀请报告

### 大会邀请报告一

**Topic:** Liquidity risk and asset pricing: Evidence from daily data, 1926–2009

**Reporter:** Prof. Weimin Liu , University of Nottingham

刘卫民教授 英国诺丁汉大学



Weimin Liu has been undertaking a secondment to the University of Nottingham Ningbo China (UNNC) campus since September 2012. His research interests include asset pricing, efficient market hypothesis tests, corporate finance, and mutual fund industry. He has published in leading international finance journals such as the Journal of Financial Economics (JFE), the Review of Financial Studies (RFS), the Journal of Banking and Finance (JBF), the Journal of Business Finance and Accounting (JBFA), and the European Financial Management (EFM).

### 大会邀请报告二

**Topic:** Timings, Terms and Agency Problems in Mergers and Acquisitions

**Reporter:** Prof. Peijun Guo, Yokohama National University

郭沛俊教授 日本横滨国立大学



Dr. Peijun Guo is Professor of Decision Sciences, Faculty of Business Administration, Yokohama National University, Japan. Prof. Guo is Associate Editors of Information Sciences and the Editorial Board Members of several Journals. His research interests involve operation research and management science, mainly in decision analysis under uncertainty and uncertainty modeling. His papers also appear in European Journal of Operational Research, IEEE Transactions on SMC, Part A: Systems and Humans, Computational Statistics and Data Analysis, Information Sciences, Fuzzy Sets and Systems etc.

### 大会邀请报告三

**Topic:** 基于 t-copula 信用资产组合风险度量

**Reporter:** Prof. Prof. Rongda Chen, Zhejiang University of Finance and Economics  
陈荣达教授 上海财经大学



陈荣达，浙江财经大学金融学教授。主要从事金融工程和金融风险度量方面的学习与研究，主持国家自然科学基金项目 2 项，获浙江省哲学社会科学优秀成果三等奖 1 项、浙江省高校科研成果 2 项。在《Annals of Operations Research》、《Economic Modelling》、《Physica A》、《Mathematical Problems in Engineering》、《管理科学学报》、《系统工程理论与实践》、《数量经济技术经济研究》等期刊发表论文 40 余篇，其中 SSCI、SCI 收录 7 篇，EI 收录 12 篇。出版专著 2 部。

### 大会邀请报告四

**Topic:** Time inconsistency, self-control and internal harmony: A planner-doer game framework

**Reporter:** Prof. Xiangyu Cui, Shanghai University of Finance Economics  
崔翔宇副教授 上海财经大学



崔翔宇，博士，上海财经大学统计与管理学院副教授。从事动态投资组合优化和行为金融学研究。主要研究方向为动态投资组合选择，风险管理，数量金融和行为金融。

### 大会邀请报告五

**Topic:** Gradient-Based Simulated Maximum Likelihood Estimation on Stochastic Volatility Models

**Reporter:** Prof. Jianqiang Hu, Fudan University  
胡建强教授 复旦大学



胡建强，复旦大学管理学院管理科学系任教授，博士生导师。1996 年任美国波士顿大学 (Boston University) 终身教授。他的主要科研方向是运筹学中各种随机系统的分析、优化和控制，研究内容包括仿真模拟、排队论、供应链和物流管理、电讯通信系统、金融市场及衍生产品等，十几年来共发表了 80 多篇专业论文。他现任《Automatica》副主编，《运筹学学报》编辑，《Journal of the Operations Research Society of China》编辑，中国运筹学会金融工程及金融风险管理分会会长，中国运筹学会理事。

### 大会邀请报告六

**Topic:** Dynamic  $\alpha$ -stable Copula for CDO pricing

**Reporter:** Prof. Hua Li, Zhengzhou University

李华副教授 郑州大学



李华，郑州大学副教授，硕士生导师，郑州大学金融工程研究所所长。主要研究方向：衍生产品的设计定价和风险防范，信用风险，期货套利和套保策略，证券智能交易策略和算法实现，金融数学模型的数值方法等。参加完成国家自然科学基金 2 项，主持完成国盛证券企业孵化上市策略研究项目，目前主持交通银行资产管理项目和 2 项河南省科技厅基础前沿项目。

### 大会邀请报告七

**Topic:** 基于社会管理的农户信用评级、信用贷款决策模型与系统研发

**Reporter:** Prof. Sulin Pang, Jinan University

庞素琳教授 暨南大学



庞素琳，暨南大学应急管理学院的教授，博士生导师。研究领域包括：金融工程与风险管理、应急管理与应急技术、移动网络故障与定位、网络评价与预警技术、计算机软件开发等。在国内外重要学术期刊发表论文近 100 篇。出版学术专著 3 部。获得授权发明专利 2 项。研究成果获得广东省科学技术奖二等奖 1 项、广东省哲学社会科学优秀科研成果奖三等奖 1

项。主持国家、省（部）市级项目、政府和企业委托或招标项目等 20 多项。2008 年入选教育部新世纪优秀人才支持计划。

### 大会邀请报告八

**Topic:** The Default Probability in the Credit Risk and its Computation under the Structural Model

**Reporter:** Prof. Yongjin Wang, Nankai University

王永进教授 南开大学



王永进，南开大学商学院金融和财务管理学教授、博士生导师，南开大学商学院副院长。同时双聘南开大学数学学院概率统计学教授、博士生导师。其主要研究领域包括：风险定价和金融期权，金融信用风险与信用衍生品；以及现代概率论，随机过程的理论与计算。迄今为止已在现代概率论、数量金融和金融工程等领域国际学术期刊上，发表学术研究论文 50 余篇。并先后主持教育部重大项目“金融信用风险的量化研究”，以及系列国家自然科学基金项目等。

### 大会邀请报告九

**Topic:** 石油价格变化对金融市场的影响

**Reporter:** Prof. Chongfeng Wu, Shanghai Jiao Tong University

吴冲锋教授 上海交通大学



吴冲锋，上海交通大学安泰经济与管理学院金融学教授、博士生导师、教授委员会主任、金融工程研究中心主任、经济学院副院长等，是国内最早从事金融工程研究与教学的学者之一。20 多年来一直从事金融工程（资产定价、金融产品创新和金融风险管理）及其相关问题研究，曾先后主持过国家杰出青年科学基金项目、国家自然科学基金重点项目等以及上海期货交易所等科研项目 30 多项；曾获国家教委科技进步奖 3 项、中国高校人文社会科学研究优秀成果奖 2 项、上海市决策咨询建议奖 2 项、上海市哲学社会科学优秀成果奖 3 项；曾获得国家教委和国务院学位办授予“做出突出贡献的中国博士学位获得者”。先后在国内重要期刊发表许多论文，其中被 SSCI 收录期刊论文超过 30 篇。此外，还先后担任中国金融学会常务理事兼金融工程专业委员会副主任，上海市金融工程

研究会理事长，上海市金融学会常务理事，教育部高等学校金融学类教学指导委员会委员等。

### 大会邀请报告十

**Topic:** Efficient Monte Carlo valuation for portfolio risk

**Reporter:** Prof. Chenglong Xu, Tongji University

徐承龙教授 同济大学



徐承龙，同济大学数学系风险管理研究所教授，博士生导师，兼任上海市计算科学 E-研究院特聘研究员，Math Review 评论员。从事计算金融的研究，承担过国家自然科学基金和国家 973 重点项目子课题《信用风险分析和信用衍生产品定价》（主要研究人员）以及多项上海市科研基金项目。在国内外发表论文 50 多篇，教材 7 本。曾获得上海市优秀教学成果一等奖（排名第二），宝钢优秀教师奖。

### 大会邀请报告十一

**Topic:** 增长期权的消耗、创造与股票收益

**Reporter:** Prof. Yong Zeng, University of Electronic Science and Technology

曾勇教授 电子科技大学



曾勇，电子科技大学经济与管理学院教授、博士生导师、资本市场研究中心主任，国务院特殊津贴专家。多年从事金融工程、资本市场与公司金融等领域的研究，作为主持人承担了国家自然科学基金、教育部“新世纪优秀人才支持计划”、教育部高等学校博士学科点专项基金、教育部人文社会科学规划基金等资助的多项重要科研项目。研究成果曾获得国家科技进步奖三等奖、四川省科技进步奖一等奖和二等奖、电子工业部科技进步奖一等奖、中国高校人文社会科学优秀成果二等奖、教育部高等学校科学研究优秀成果奖二等奖、四川省哲学社会科学优秀成果奖二等奖等多项奖励，在国内外学术刊物发表学术论文 100 余篇，出版学术著作 5 部。《金融学季刊》副主编，《系统工程学报》、《系统工程理论与实践》、《管理工程学报》、《管理学报》、《管理评论》和《投资研究》等编委。

## 大会邀请报告十二

**Topic:** 隐含因子的信息含量

**Reporter:** Prof. Zhenlong Zheng, Xiamen University  
郑振龙教授，厦门大学



郑振龙，厦门大学金融工程教授，博士生导师。研究方向主要集中在金融工程领域，主要研究内容为衍生品设计、定价、风险管理和交易策略。先后作为主持人和主要参与者承担了 18 项国家和省部科研课题的研究，还主持了 15 项横向课题。出版了 30 多部著作和教材，发表了近 200 篇学术论文，并获得 20 多项省部级优秀社科成果奖。2002 年获得霍英东教育基金会第八届青年教师奖，2004 年入选教育部新世纪优秀人才支持计划，2009 年入选国家百千万人才工程，

2011 年享受国务院政府特殊津贴。