

第十二届金融系统工程与风险管理国际年会优秀论文获奖名单

组别	作者	题目	证书编号
1 金融工程	尹力博 韩立岩	基于长期投资视角的动态套期保值策略——以原油期货组合为例	fserm201401
	李 平 尹菁华	基于 Copula 双变量模拟的 COCO 债券定价	fserm201402
	庞素琳 王 立	信用贷款中反向 CDS 协议的设计与定价研究	fserm201403
	费为银 夏登峰 唐仕冰	奈特不确定及机制转换环境下考虑汇率变动的外商投资决策问题研究	fserm201404
2 金融风险管理 (一)	迟国泰 张亚京 石宝峰	基于 Probit 回归的小型非工业企业债信用评级模型及实证	fserm201405
	陈国进 刘晓群 谢沛霖 赵向琴	已实现跳跃波动与中国股市风险溢价研究——基于市场组合	fserm201406
	Huaying Guo Jin Liang Zheng Gong Bohan Ding	The Valuation of CCIRS with A Special Item	fserm201407
	牟 刚 袁先智	使用 Logistic 回归对企业信用评级的实证研究——大数据在企业实践中的应用	fserm201408
3 金融风险管理 (二)	隋 聪 王宗尧	银行系统性风险的分布式预警策略	fserm201409
	马 锋 魏 宇 黄登仕 庄晓洋	隔夜收益率能提高高频波动率模型的预测能力吗?	fserm201410
	肖斌卿 余 哲 杨 旸	小微企业信贷评级模型研究——基于 Logistic 回归与神经网络的比较	fserm201411
4 计算实验金融	陈舒宁 张 维 金 曦 何 枫	中小板交易异动停牌制度有效性研究	fserm201412
	杨 威 韩 艾 汪寿阳	基于区间型数据的金融时间序列预测研究	fserm201413

	Youfa Sun C.W. Oosterlee	Double Heston Stochastic Volatility and Jump-diffusion Dynamics: A Good Financial Model or Not?	fserm201414
	Yongjie Zhang Weixin Song Dehua Shen Wei Zhang	Market Reaction to Internet News: Information Diffusion and Price Pressure	fserm201415
	Min Zheng	Heterogeneous Agents and Housing Prices	fserm201416
5 资产定价	陈 蓉 廖木英 徐婉菁	期权隐含偏度风险溢酬：来自中国台湾市场的数据	fserm201417
	董晨昱 刘维奇 Weimin Liu 王 钰	股票收益反转效应及与买卖价差关系研究	fserm201418
	刘晓倩 周 勇	自回归模型的加权复合 Expectile 回归估计及其应用	fserm201419
6 宏观金融（一）	李凤羽 史永东 杨墨竹	经济政策不确定性与企业现金持有策略——基于中国经济政策不确定指数的实证研究	fserm201420
	夏楚豪 易 江	产品扩散定价模型与房地产资产定价	fserm201421
7 宏观金融（二）	薛耀文 张云香 薛佳琦 李江涛	中国异常资金流动水平控制研究	fserm201422
	董 志 李秀婷 董纪昌 汪寿阳	基于系统动力学的我国融资结构仿真研究	fserm201423
	冯 玲 冯硕硕	人民币 NDF 市场与新台币 NDF 市场相关性及其风险溢出研究	fserm201424
	李 江 李红刚	基于流动性配置的银行系统性风险研究	fserm201425
8 行为金融与公司治理	张腊凤 刘维奇	资产增长度量指标新论——经营资产增长率指标的提出与实证分析	fserm201426
	曾 燕 康俊卿 陈树敏	基于连续时间框架的动态异质情绪资产定价模型研究	fserm201427