

## 管理工程学院

### 金融创新团队

- 1、团队负责人：冯磊教授
- 2、团队成员：曹广喜、鲁训法、储小俊、李晓庆、崔海蓉、郭建平、葛和平、张旭、郑玉华、姜闪闪、许微、邱祺璐、江美辉
- 3、团队研究方向：金融风险管理、智能量化投资决策和资产定价等
- 4、团队成果：

序号	成果名称	成果类别	发表刊物或出版社（论文或专著）	成果收录情况	第一作者
1	Forecasting Realized Volatility in A Heterogeneous Market: A GM (1, 1) Approach	学术论文	The Journal of Grey System	SCI	储小俊
2	Forecasting stock returns using first half an hour order imbalance	学术论文	International Journal of Finance & Economics	SSCI	储小俊
3	Forecasting Volatility with Price Limit Hits—Evidence from Chinese Stock Market	学术论文	Emerging Markets Finance and Trade	SSCI	储小俊
4	Intraday momentum and reversal in Chinese stock market	学术论文	Finance Research Letters	SSCI	储小俊
5	融资融券放大了投资者情绪效应吗？	学术论文	证券市场导报	核心期刊	储小俊
6	市场摩擦与股价跳跃风险分析	学术论文	商业研究	核心期刊	储小俊
7	证券市场流动性研究	专著	科学出版社	权威出版社	储小俊
8	基于模糊聚类-关联规则的气象条件对交通阻断影响评估分析	学术论文	科学技术与工程	核心期刊	崔海蓉
9	基于 k-means-RM 的气象条件对交通阻断的影响评估	学术论文	公路	核心期刊	崔海蓉
10	Can the Implied Information of Options Predict the Liquidity of Stock Market? A Data-Driven Research Based on SSE50ETF Options	学术论文	Journal of Mathematics	SCI	崔海蓉
11	买卖权平价关系偏离能预测现货市场收益吗？——基于上证 50ETF 期权的实证研究	学术论文	金融发展研究	核心期刊	崔海蓉

12	Is Temperature-index Derivative Suitable for China?	学术论文	Physica A	SCI	崔海蓉
13	多分布假设下的 AR-EGARCH 气温预测模型研究——基于气温衍生品定价视角	学术论文	生态经济	核心期刊	崔海蓉
14	基于 AR-EGARCH-HCM 模型的气温衍生品适用性研究——来自于中国 7 个城市的实证分析	学术论文	金融理论与实践	核心期刊	崔海蓉
15	高温天气衍生品设计及其定价模型——以长江中下游地区水稻为例	学术论文	系统工程	核心期刊	崔海蓉
16	数字普惠金融评价指标体系及实证	专著	中国社会科学出版社	权威出版社	葛和平
17	国际分工视野下贸易壁垒的新兴古典经济学阐释	专著	经济管理出版社	地方出版社	葛和平
18	国际分工视野下贸易壁垒新兴古典经济学阐释	专著	经济管理出版社	地方出版社	葛和平
19	基于前兆数据和经验模态分解的金融系统极值风险识别研究	学术论文	统计与信息论坛	核心期刊	郭建平
20	基于傅立叶变换的统计数据外推问题研究	学术论文	统计与决策	核心期刊	郭建平
21	基于信度加权叠加分布模型的医疗保险损失数据拟合问题研究	学术论文	统计与信息论坛	核心期刊	郭建平
22	小样本厚尾观测数据的信度加权混合分布拟合研究	学术论文	统计与决策	核心期刊	郭建平
23	Structural decomposition analysis of global carbon emissions: The contributions of domestic and international input changes	学术论文	Journal of Environmental Management	SCI	江美辉
24	Consumption-based multi-objective optimization model for minimizing energy consumption: A case study of China	学术论文	Energy	SCI	江美辉
25	Identifying the key sectors in the carbon emission flows along the production chain paths: A network perspective	学术论文	Ecological Indicators	SCI	江美辉
26	控股股东股权质押经济后果的影响机理分析	学术论文	财会月刊	核心期刊	李晓庆
27	基于 WRDDM 模型的我国商业银行公司治理绩效评价	学术论文	统计与决策	核心期刊	李晓庆
28	存款人的市场约束对银行成本效率的影响	学术论文	财经问题研究	核心期刊	李晓庆
29	The Break Point-Dependent Causality between the Cryptocurrency and Emerging Stock Markets	学术论文	Economic Computation and Economic	SSCI	鲁训法

			Cybernetics Studies and Research		
30	Dynamic correlation between cryptocurrency index and crude oil price	学术论文	Basic & Clinical Pharmacology & Toxicology	SCI	鲁训法
31	基于 GARCH 族混合模型的沪深 300 指数波动预测	学术论文	阅江学刊	核心期刊	鲁训法
32	Strategic Information Flow under the Influence of Industry Structure.	学术论文	European Journal of Operational Research	SCI	邱祺珺
33	Consumer Entry: Impact on Expert's Pricing and Overcharging Behavior.	学术论文	Journal of Systems Science and Systems Engineering	SCI	邱祺珺
34	Firms Can Benefit from Inaccurate Market Beliefs.	学术论文	Operations Research Letters	SCI	邱祺珺
35	How to Deal with Consumers Who Group to Request a Discount?	学术论文	Naval Research Logistics	SCI	邱祺珺
36	Optimal switching of switched systems with time delay in discrete time	学术论文	Automatica	SSCI	许微
37	Optimal switching signal design with a cost on switching action	学术论文	Journal of Industrial and Management Optimization	SSCI	许微
38	Optimal scheduling of discrete-time switched linear systems	学术论文	IMA Journal of Mathematical Control and Information	SSCI	许微
39	Optimal switching for linear quadratic problem of switched systems in discrete time	学术论文	Automatica	SSCI	许微
40	A 股纳入 MSCI 指数与股价异质性风险	学术论文	《国际商务（对外经贸大学学报）》	核心期刊	张旭
41	基于混频实时数据的“区域”——非对称货币政策规则研究	学术论文	统计与信息论坛	核心期刊	张旭
42	How do Stock Price Indices Absorb the COVID-19 Pandemic Shocks?	学术论文	North American Journal of Economics and Finance	SSCI	张旭
43	Multiscale Systemic Risk and Its Spillover Effects in the Cryptocurrency Market	学术论文	Complexity	SSCI	张旭
44	“沪港通”影响上证 A 股股票流动性吗——基于分位数 DID 的准自然实验	学术论文	金融理论与实践	核心期刊	张旭
45	A 股“入摩”降低股价波动了吗？	学术论文	金融发展研究	核心期刊	张旭

## 5、成果应用案例：

## 6、相关项目经验

序号	项目名称	应用单位
1	投资者情绪高频指数的构建及其对股价崩盘影响研究	江苏高校哲学社会科学研究
2	基于大数据的股市系统性崩盘风险监测预警研究	江苏省规划办
3	基于大数据的股市系统性崩盘风险监测预警研究	国家统计局
4	外部冲击对股市价格跳跃影响的作用机理、预警及风险防控研究	全国哲学社会科学规划办公室
5	基于互联网金融框架的科技金融创新及发展机制研究	江苏省教育厅高校哲学社会科学基金
6	铁路交通气象灾害评估系统及预警指标研发	江苏省气象科学研究所
7	基于数据挖掘的气象条件对公路交通阻断和流量影响及程度分析	中国气象局公共气象服务中心
8	江苏省互联网金融人才发展状况与竞争趋势研究	江苏人才强省建设决策咨询研究基地
9	数字普惠金融服务江苏乡村振兴战略的模式与路径研究	江苏省科技厅
10	数字普惠金融促进乡村产业振兴的模式创新与政策研究	全国哲学社会科学规划办公室
11	烟雾火光识别警报软件	南京澳晟科技有限公司
12	工业数据采集工具软件	南京韵哲信息科技有限公司
13		南京万盛
14	复合功能差异化涤纶短纤产品开发	江苏埤恒复合材料有限公司
15	超高硬度合金钻头研发	南通博特锐精密工具有限公司
16	气象灾害应急救援服务的金融风险分析及支持方式选择	中国气象局
17	频域分析视角下金融系统极值风险防范与化解机制研究	教育部
18	碳中和目标下中国省际产业关联网络优化策略研究	江苏高校哲学社会科学研究
19	基于网络视角下有中国特色的影子银行风险传染机理研究	教育部社科司
20	基于复杂网络视角的影子银行风险传染研究	国家自然科学基金委
21	复杂网络视角下有中国特色的影子银行风险传染机理研究	教育部
22	高频数据下基于动态 Copula 和“已实现波动”理论的股市投资组合风险建模及应用	国家自然科学基金委
23	基于高频大数据的 Copula 模型动态极值风险度量及其应用研究	教育部

24	区块链背景下加密货币指数与人民币汇率指数的动态风险传递关系研究	江苏省规划办
25	江苏省“双创博士”人才工程项目	江苏省教育厅
26	医疗行业考虑消费者服务决策的专家欺骗行为及其对策研究	南京信息工程大学人才启动经费
27	基于上下游学习效应的供应链采购决策与优化算法研究	江苏省教育厅高校自然科学研究面上项目
28	基于上下游学习效应的供应链采购策略研究	国家自然科学基金委
29	离散线性二次型切换系统的分布鲁棒最优控制及其在生产调度中的应用	国家自然科学基金委员会
30	江多时滞离散线性二次型切换系统的最优切换控制研究	江苏省科技厅
31	多时滞离散线性二次型切换系统的最优切换控制研究	江苏省科技厅
32	复杂系统视角下服务质量管理创新影响因素研究	江苏高校哲学社会科学研究
33	宏观经济动量研究	中国博士后基金
34	中国股票市场重大风险的生成机理、甄别与治理研究——基于市场流动性供需失衡视角	教育部
35	江苏率先实现经济高质量发展的金融驱动机制与金融支持政策研究	江苏省哲学社科界联合会
36	金融市场异常波动的共振效应及其智能监控研究	国家自然科学基金委
37	金融资产价格极端波动的共振机理及其风险防范研究	江苏省科技厅
38	“双支柱”框架下基于机器学习的货币政策调控模式创新研究	江苏省规划办
39	中国博士后基金特别资助:基于流动性供需失衡的中国股票市场“高波动之谜”研究	中国博士后基金