

全国中文核心期刊
国家自然科学基金委员会管理科学部认定的管理科学A级重要期刊

ISSN 1007-9807
CN 12-1275/G3

管理科学学报

JOURNAL OF MANAGEMENT SCIENCES IN CHINA

2012

第 15 卷 第 4 期 Vol. 15 No. 4

ISSN 1007-9807



9 771007 980121

国家自然科学基金委员会管理科学部

GUANLI KEXUE XUEBAO

目 次

后金融危机时代金融系统工程与风险管理的研究进展(专辑序言)
 汪寿阳, 张 维, 余乐安(1)

“京十二条”房地产调控政策的影响——基于 TEI@I 方法论
 郭 琨, 崔 啸, 王 珏, 等(4)

中国 IPO 抑价的构成及影响因素研究 邹高峰, 张 维, 徐晓婉(12)

基于 Fréchet Copula 的欧式脆弱期权定价 李 平, 曲 博, 黄光东(23)

时变信息溢出检验及其在金融市场中的应用 陆凤彬, 洪永森(31)

金融危机前后的汇率波动特征 李小平, 冯 芸, 吴冲锋(40)

具有最优学习率的 RBF 神经网络及其应用 卫 敏, 余乐安(50)

违约风险下的信贷决策模型与机制 庞素琳(58)

系统风险的会计决定: 企业财务风险、经营风险、系统风险的时变关联
 吴武清, 陈暮紫, 黄德龙, 等(71)

基于时序多目标方法的主权信用违约风险研究 寇 纲, 姜春伟, 彭 怡, 等(81)

可违约零息债券风险综合度量 Monte Carlo 方法 陈荣达, 陆金荣(88)

期刊基本参数: CN 12 - 1275/G3 * 1998 * m * A4 * 98 * zh * P * ¥20.00 * 2200 * 11 * 2012 - 04

JOURNAL OF MANAGEMENT SCIENCES IN CHINA

Vol. 15 No. 4 2012 (monthly)

CONTENTS

- Effects of the "Beijing Twelve Measures" real estate regulation policy: Based on TEI@I methodology
..... *GUO Kun, CUI Xiao, WANG Jue, et al* (4)
- Factors affecting IPO underpricing and its composition in Chinese market
..... *ZOU Gao-feng, ZHANG Wei, XU Xiao-wan* (12)
- Pricing of European vulnerable options based on Fréchet Copula
..... *LI Ping, QU Bo, HUANG Guang-dong* (23)
- Time-varying information spillover tests and their application to financial markets
..... *LU Feng-bin, HONG Yong-miao* (31)
- The characteristics of exchange rate volatility before and after the financial crisis
..... *LI Xiao-ping, FENG Yun, WU Chong-feng* (40)
- A RBF neural network with optimum learning rates and its application
..... *WEI Min, YU Le-an* (50)
- Credit decision model and mechanisms under default risk
..... *PANG Su-lin* (58)
- Accounting determinants of systematic risk: Dynamic association among firm's financial risk, operating
risk and systematic risk *WU Wu-qing, CHEN Mu-zi, HUANG De-long, et al* (71)
- A time series MCDM method for sovereign default risk evaluation
..... *KOU Gang, LOU Chun-wei, PENG Yi, et al* (81)
- A Monte Carlo method of integrated risk measurement for defaultable zero-coupon bonds
..... *CHEN Rong-da, LU Jin-rong* (88)