

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

2016

第 19 卷 第 6 期 Vol. 19 No. 6

ISSN 1007-9807



天津大学、国家自然科学基金委员会管理科学部

GUANLI KEXUE XUEBAO

万方数据

目 次

· 论 文 ·

具有技术转让的捆绑采购最优决策研究 魏 航, 谈 丹, 李 佩(1)

ATM 跨行交易独立定价与联合定价比较研究 傅联英, 骆品亮(20)

一种减少供应链牛鞭效应的资产组合管理方法 陈长彬, 盛 鑫, 梁永奕(33)

分析师跟踪与股价同步性——基于过度反应视角的证据 周铭山, 林 靖, 许年行(49)

跳跃风险如何影响期权复制收益?

——基于多维跳跃扩散的模型与证据 刘杨树, 郑振龙, 陈 蓉(74)

基于异质性投资者的动态情绪资产定价 曾 燕, 康俊卿, 陈树敏(87)

已实现跳跃波动与中国股市风险溢价研究

——基于股票组合视角 陈国进, 刘晓群, 谢沛霖, 等(98)

信用贷款风险中反向 CDS 协议设计与定价模型 庞素琳, 王 立(114)

Knight 不确定与随机汇率下外商投资决策 费为银, 夏登峰, 唐仕冰(125)

基于 Probit 回归的小企业债信评级模型及实证 迟国泰, 张亚京, 石宝峰(136)

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 李凤羽, 史永东(157)

股票收益反转效应及与买卖价差价关系研究 董晨昱, 刘维奇, LIU Wei-min, 等(171)

期刊基本参数: CN 12-1275/G3 * 1998 * m * A4 * 184 * zh * P * ¥32.00 * 2200 * 12 * 2016 - 6

JOURNAL OF MANAGEMENT SCIENCES IN CHINA

Vol. 19 No. 6 2016 (monthly)

CONTENTS

Optimal bundled procurement with technology acquisition

..... *WEI Hang, TAN Dan, LI Pei* (1)

A comparative study on the independent and collective pricing in ATM networks

..... *FU Lian-ying, LUO Pin-liang* (20)

Reducing bullwhip effect in supply chain: A portfolio management approach

..... *CHEN Chang-bin, SHENG Xin, LIANG Yong-yi* (33)

Star analyst coverage and stock price synchronicity: Empirical evidence based on market overreaction

..... *ZHOU Ming-shan, LIN Jing, XU Nian-hang* (49)

How does jump risk affect the Delta hedge gain? Evidence from multi-dimension jump diffusion model

..... *LIU Yang-shu, ZHENG Zhen-long, CHEN Rong* (74)

Dynamic sentiment asset pricing with heterogeneous investors

..... *ZENG Yan, KANG Jun-qing, CHEN Shu-min* (87)

Realized jump volatility components and portfolio risk premium in Chinese stock market

..... *CHEN Guo-jin, LIU Xiao-qun, XIE Pei-lin, et al* (98)

Design and pricing model of the reverse CDS in credit loan risk

..... *PANG Su-lin, WANG Li* (114)

On study of a foreign investor's investment with random exchange rate under Knightian uncertainty

..... *FEI Wei-yin, XIA Deng-feng, TANG Shi-bing* (125)

The debt rating for small enterprises based on Probit regression

..... *CHI Guo-tai, ZHANG Ya-jing, SHI Bao-feng* (136)

Economic policy uncertainty and corporate cash holding strategy: Empirical research by using China economic policy uncertainty index

..... *LI Feng-yu, SHI Yong-dong* (157)

Research on reversal effect and the relationship between reversal effect and bid-ask spread

..... *DONG Chen-yu, LIU Wei-qi, LIU Wei-min, et al* (171)

《管理科学学报》(月刊, 1998年1月创刊)

2016年 第19卷 第6期 总第144期

主管单位: 中华人民共和国教育部

主办单位: 天津大学、国家自然科学基金委员会管理科学部

主 编: 吴启迪

编辑出版: 《管理科学学报》编辑部

地 址: 天津市南开区卫津路92号 天津大学

邮政编码: 300072 电话: 022-27403197

印 刷: 天津市云海科贸开发公司

发 行: 天津邮政报刊发行局

订 购 处: 全国各地邮局

海外发行: 中国国际图书贸易总公司

邮发代号: 国内6-89
国外M5062

E-mail: jmsstju @ 263.net

网址: jmsc.tju.edu.cn

2016年6月出版

定价: 32元