



QK20197746

数理统计与管理

JOURNAL OF APPLIED
STATISTICS AND MANAGEMENT

2020 Vol.39 No.3

中国现场统计研究会 主办

本期目次

统计应用研究

- 新冠肺炎疫情影响下的统计科学研究新模式与新趋势 —— “科学抗疫、统计担当 —— 全国统计科学线上高端论坛” 综述 阮敬, 刘雅楠, 任韬, 张宝学, 纪宏 (381)
- 吉林省农产品电商产业集聚对产业全要素生产率的影响研究 —— 基于阿里巴巴平台数据 慎丹, 杨印生 (385)
- 淡水鱼养殖环节中副溶血性弧菌预测统计建模与分析 杨倩, 陈巍璐 (397)
- 多元零浮动负二项分布模型在美国老龄化研究中的应用 刘寅, 张弛, 蒋锋 (406)

方法研究与探讨

- 基于 LASSO 变量选择与多因子模型的增强型指数基金的构造研究 古志婷, 宋泽芳, 李元 (417)
- 基于傅里叶近似的时变门槛拐点回归模型及其应用 杨利雄 (429)
- 多元 Laplace 分布下的广义贝叶斯分层回归模型及其应用 慕娟, 田茂再 (438)
- 基于 GEE 的离散面板数据动态因子模型估计及应用 方国斌, 马慧敏, 张波 (449)
- 基于贝叶斯 GARCH-Expectile 模型的 VaR 和 ES 风险度量 胡宗义, 李毅, 万闯 (467)

数据化管理

- 单边指数加权移动平均 t 控制图设计 胡雪龙, 仲建兰, 吴姝, 屈明剑 (478)
- 一种检测 Maxwell 分布尺度参数控制图 宋琪, 李琦, 张久军 (487)
- 基于控制过度遗漏发现概率的高维数据流异常诊断 杨梓樱, 濮晓龙, 徐嘉辉 (495)

经济因素分析

- 企业战略定位差异与商业信用 侯德帅, 赵鹤临, 董曼茹, 姚秋歌 (511)

股市与投资探讨

- 基于贝叶斯检验方法的股票定价模型比较分析 —— 来自中国上市公司的数据证据 任燕燕, 徐晓波, 王姿懿 (531)
- 稳健夏普单指数模型的构建及其比较研究 李雄英, 王斌会 (544)
- 基于自注意力神经网络的多因子量化选股问题研究 张虎, 沈寒蕾, 刘晔诚 (556)

JOURNAL OF APPLIED STATISTICS AND MANAGEMENT

MAIN CONTENTS

New Concepts and Trends in Statistical Scientific Research Influenced by the COVID-19 Epidemic — Review of “Statistics in Epidemic Prevention” National Statistical Online High-end Forum	RUAN Jing, LIU Ya-nan, REN Tao, ZHANG Bao-xue, JI Hong (381)
Effect of Agricultural Products E-commerce Industry Agglomeration on Total Factor Productivity in Jilin Province: Based on Alibaba Platform Data	SHEN Dan, YANG Yin-sheng (385)
Statistical Modeling and Analysis of <i>Vibrio Parahaemolyticus</i> in Freshwater-Fish Cultivation	YANG Qian, CHEN Wei-lu (397)
The Multivariate Zero-inflated Negative Binomial Models with Application in American Study on Aging	LIU Yin, ZHANG Chi, JIANG Feng (406)
Study on the Construction of Enhanced Index Fund Based on LASSO Variable Selection and Multi-factor Model	GU Zhi-Ting, SONG Ze-fang, LI Yuan (417)
Regression Kink with a Time-varying Threshold Based on Fourier Approximation and Its Application	YANG Li-xiong (429)
Bayesian Hierarchical Regression Model with Multivariate Laplace Distribution and Its Application	MU Juan, TIAN Mao-zai (438)
Specification and Inference for High-dimensional Discrete Panel Data Dynamic Factor Models	FANG Guo-bin, MA Hui-min, ZHANG Bo (449)
Evaluating VaR and ES Based on the Bayesian GARCH-Expectile Model	HU Zong-yi, LI Yi, WAN Chuang (467)
Design of One-sided Exponentially Weighted Moving Average t Control Chart	HU Xue-long, ZHONG Jian-lan, WU Shu, QU Min-jian (478)
A Control Chart for Monitoring the Scale Parameter of the Maxwell Distribution	SONG Qi, LI Qi, ZHANG Jiu-jun (487)
High-dimensional Fault Diagnosis by Controlling Missed Discovery Excessive Probability	YANG Zi-ying, PU Xiao-long, XU Jia-hui (495)
Enterprise Strategic Positioning Difference and Commercial Credit	HOU De-shuai, ZHAO He-lin, DONG Man-ru, YAO Qiu-ge (511)
Comparative Analysis of Stock Pricing Model Based on Bayesian Test Method — Data Evidence from Chinese Listed Companies	REN Yan-yan, XU Xiao-bo, WANG Zi-yi (531)
The Formation and Comparison of Robust Shape's One-way Analysis of Variance	LI Xiong-ying, WANG Bin-hui (544)
The Study on Multi-factor Quantitative Stock Selection Based on Self-attention Neural Network	ZHANG Hu, SHEN Han-lei, LIU Ye-cheng (556)

中国中文核心期刊
中国科技核心期刊
中国人文社会科学核心期刊

“数理统计与管理”编委会

主 编：陈 敏
副 主 编：程维虎 郭建华 何书元 刘维奇 濮晓龙 唐年胜 王兆军
王 柱 张忠占 周 勇
编 委：陈守东 程龙生 崔恒建 房祥忠 范 英 何 桢 金勇进
李仲飞 李 元 林华珍 林金官 刘立新 刘民千 刘 扬
马立平 孟生旺 覃 红 石 磊 孙六全 王德辉 王汉生
王慧敏 王建稳 王 强 王学钦 汪荣明 吴耀华 杨 虎
杨静平 杨 瑛 于 丹 张 波 张建方 张 虎 张日权
赵 宇 朱建平 朱仲义

数理统计与管理

(双月刊)

JOURNAL OF APPLIED STATISTICS
AND MANAGEMENT

编委会主编：陈 敏

编辑部主任：程维虎

本期责任副主编：王 柱

本期责任编辑：吴金荣

本期责任校对：陈 叙

主管：中国科学技术协会

主办：中国现场统计研究会

编辑：《数理统计与管理》编辑部

地址：中国科学院应用数学所内（100190）

Email: sltj@amt.ac.cn

http: //sltj.chinajournal.net.cn

出版：《数理统计与管理》编辑部

印刷：北京科信印刷有限公司

发行：北京报刊发行局，全国发行

2020年第3期（总第227期）

出版日期：2020年05月22日

刊号：CN11-2242/01

ISSN: 1002-1566

邮政代号：82-69

国内发行：¥18.00

ISSN 1002-1566



9 771002 156002