



ISSN 1000-6788  
CN 11-2267/N

# 系统工程理论与实践

*Systems Engineering — Theory & Practice*



中国系统工程学会主办

2012年 第32卷 第8期

2012年第32卷第8期

目次

基于期权博弈的股票波动性价值模型 ..... 张 普 吴冲锋 (1631)

单阶段 R&D 项目与有价证券投资组合优化的情景生成模型 .....  
..... 陈丽华 尹伟力 房 勇 陈 冲 (1639)

基于线性学习函数的泛证券投资组合策略 ..... 张卫国 张 永 徐维军 杨兴雨 (1647)

“公司 + 农户” 模式下公司的最优套期保值和订单价格方式 ..... 杨晨辉 刘新梅 魏振祥 (1655)

基于机制转换混合 Copula 模型的我国股市间极值相依性 ..... 吴吉林 张二华 (1662)

基于固定股利支付比率的企业盈余可持续性优化模型及实证 ..... 张景奇 孟卫东 (1673)

基于商品供需网络的城市物流仓储设施均衡模型及应用 ..... 杨 鹏 史 峰 (1681)

基于两区域市场的可替代产品扩散模型及其稳定性 ..... 王德鲁 刘 芸 宋学锋 (1692)

基于阈值回归模型的中国电力消费与经济增长的关系 ..... 李 科 (1704)

动态规划启发式算法求解时变车辆调度问题 ..... 李妍峰 李 军 高自友 (1712)

基于实物期权理论的 RFID 技术投资评价方法 ..... 张宏斌 韩 伟 宁 浪 (1719)

损失规避零售商订货量与广告费用的联合决策 ..... 周永务 肖 旦 李绩才 (1727)

项目缓冲设置方法及其评价指标改进 ..... 施 骞 王雅婷 龚 婷 (1739)

基于直觉梯形模糊信息的多准则群决策方法 ..... 王坚强 聂荣荣 (1747)

联合均值与方差模型的变量选择 ..... 吴刘仓 张忠占 徐登可 (1754)

基于 I-GM(0,N) 模型的干线客机价格预测方法 ..... 何沙玮 刘思峰 方志耕 (1761)

联网审计的绩效评价方法: 基于 RC 和 AHP 的组合应用 ..... 陈 伟 Smieliauskas Wally (1768)

强化学习在基于多主体模型决策支持系统中的应用 —— 以湖泊水环境决策支持系统为例 ...  
..... 倪建军 刘明华 任 黎 张传标 (1777)

LSVDD: 基于局部支持向量数据描述的稀有类分析算法 ..... 熊海涛 吴俊杰 刘 鲁 李 明 (1784)

两阶段启发式算法求解带时间窗的多中心车辆路径问题 ..... 于 滨 靳鹏欢 杨忠振 (1793)

带时间窗的开放式满载车辆路径问题建模及其求解算法 ..... 孙国华 (1801)

适应性指挥控制关系网的度分布 ..... 陶九阳 张东戈 赵普山 (1808)

随机时间影响网络建模方法 —— 扩展时间影响网络的确定性时间延迟 .....  
..... 朱延广 朱一凡 雷永林 曹星平 (1814)

基于本体的飞机舵面结构故障诊断方法 ..... 袁 侃 胡寿松 (1826)

基于 eM-Plant 的参数化虚拟组合设备 ..... 潘春荣 伍乃骥 黄学佳 (1831)

动态多响应系统的稳健参数设计 ..... 马义中 汪建均 苏国进 (1841)

考虑发电商风险偏好的电力市场均衡分析 ..... 王 晔 康小宁 张少华 (1850)

岛屿复合生态系统的动态仿真 ..... 李 华 (1858)

光电跟踪系统集成仿真系统的开发 ..... 史建亮 任 戈 谭 毅 (1864)

## Contents

<b>Model of stocks' volatility value based on option games</b> .....	ZHANG Pu WU Chong-feng (1631)
<b>Scenario generation model for single stage R&amp;D projects and securities portfolio optimization</b> .....	CHEN Li-hua YIN Wei-li FANG Yong CHEN Chong (1639)
<b>Universal portfolio based on on-line learning of linear function</b> .....	ZHANG Wei-guo ZHANG Yong XU Wei-jun YANG Xing-yu (1647)
<b>The optimal hedging and contract price style of the company under the "Company &amp; Farmer" pattern</b> .....	YANG Chen-hui LIU Xin-mei WEI Zhen-xiang (1655)
<b>Extreme dependence in Chinese stock markets based on regime-switching mixed Copula</b> .....	WU Ji-lin ZHANG Er-hua (1662)
<b>Optimization model of earnings persistence under fixed dividends payment ratio and empirical research</b> .....	ZHANG Jing-qi MENG Wei-dong (1673)
<b>Urban logistics storage facilities equilibrium model based on commodity supply and demand network and its application</b> .....	YANG Peng SHI Feng (1681)
<b>Substitute products diffusion model and stability in two regional markets</b> .....	WANG De-lu LIU Yun SONG Xue-feng (1692)
<b>Relationship between electricity consumption and economic growth of China based on threshold regression model</b> .....	LI Ke (1704)
<b>Dynamic programming heuristics for solving time dependent vehicle routing problem</b> .....	LI Yan-feng LI Jun GAO Zi-you (1712)
<b>Evaluation of RFID investment based on real options</b> .....	ZHANG Hong-bin HAN Wei NING Lang (1719)
<b>Joint decision-making of order quantities and advertising expenditure for loss-averse retailers</b> .....	ZHOU Yong-wu XIAO Dan LI Ji-cai (1727)
<b>An improved approach for project buffer sizing and evaluation</b> .....	SHI Qian WANG Ya-ting GONG Ting (1739)
<b>Multi-criteria group decision-making method based on intuitionistic trapezoidal fuzzy information</b> .....	WANG Jian-qiang NIE Rong-rong (1747)
<b>Variable selection in joint mean and variance models</b> .....	WU Liu-cang ZHANG Zhong-zhan XU Deng-ke (1754)
<b>Method of route airliner price forecast based on I-GM(0,N) model</b> .....	HE Sha-wei LIU Si-feng FANG Zhi-geng (1761)
<b>Performance assessment method of online auditing: Combined use between RC and AHP</b> .....	CHEN Wei Smieliauskas Wally (1768)
<b>Reinforcement learning for DSS based on multi-agent model: A case of lake water environment DSS</b> .....	NI Jian-jun LIU Ming-hua REN Li ZHANG Chuan-biao (1777)
<b>LSVDD: Rare class analysis based on local support vector data description</b> .....	XIONG Hai-tao WU Jun-jie LIU Lu LI Ming (1784)
<b>Two-stage heuristic algorithm for multi-depot vehicle routing problem with time windows</b> .....	YU Bin JIN Peng-huan YANG Zhong-zhen (1793)
<b>Modeling and algorithm for open vehicle routing problem with full-truckloads and time windows</b> .....	SUN Guo-hua (1801)
<b>On the degree distribution of adaptive C2 relationship networks</b> .....	TAO Jiu-yang ZHANG Dong-ge ZHAO Pu-shan (1808)
<b>A new timed influence net model with stochastic delay</b> .....	ZHU Yan-guang ZHU Yi-fan LEI Yong-lin CAO Xing-ping (1814)
<b>Fault diagnosis of aircraft control surface based on ontology</b> .....	YUAN Kan HU Shou-song (1826)
<b>EM-Plant-based parameterization virtual cluster tool</b> .....	PAN Chun-rong WU Nai-qi HUANG Xue-jia (1831)
<b>Robust parameter design for dynamic multi-response system</b> .....	MA Yi-zhong WANG Jian-jun SU Guo-jin (1841)
<b>Modeling risk preference in equilibrium analysis of electricity markets with wind power</b> .....	WANG Xian KANG Xiao-ning ZHANG Shao-hua (1850)
<b>System dynamic simulation of island composite ecosystem</b> .....	LI Hua (1858)
<b>Development on integrated simulation platform for opto-electrical tracking system</b> .....	SHI Jian-liang REN Ge TAN Yi (1864)