

国家中文核心期刊  
中国人文社会科学核心期刊  
中文社会科学引文索引期刊

ISSN 1003-207X  
国家自然科学基金委员会管理科学部认定  
管理科学 A 级重要期刊

ZHONGGUO GUANLI KEXUE

# 中国管理科学

CHINESE JOURNAL OF  
MANAGEMENT SCIENCE



中国科学院 主管

中国优选法统筹法与经济数学研究会 主办  
中国科学院科技政策与管理科学研究所

ISSN 1003-207X



9 771003 207147

2016 | 第十二期  
第24卷

万方数据

# 中国管理科学

第 24 卷 第 12 期(总第 146 期)

---

信贷资产证券化模式选择与产品设计	张 勇 杨招军 罗鹏飞(1)
考虑成分股联跳与宏观信息发布的沪深 300 指数已实现波动率模型研究	瞿 慧 程思逸(10)
指令不均衡与股票收益关系研究——基于大规模数据分位数回归的实证	许启发 蔡 超 蒋翠侠(20)
半参数 alpha 策略的反转效应研究	张 莉 邓礼英 周 勇(30)
奈特不确定性下的资产及其组合的惰性区间	何朝林 刘 梦(39)
基于实物期权的电信牌照类无形资产价值分析	王雪荣 李晴慧(47)
时变损失厌恶下基于动态 CVaR 的 ETF 基金最优资产配置策略研究	王 良 贾宇洁 刘 潇(54)
基于改进遗传算法的置换装配线调度问题研究	李 劲 李 洪 徐丽丽 王 华(63)
库存共享和服务水平限制下三级分销网络侧向转运模型与算法	戢守峰 万 鹏 孙 琦 罗嵘娟(72)
风险态度不对称下的企业间知识转移研究	陈 果 齐二石(82)
具有双重角色和非期望要素的供应商评价两阶段 DEA 模型	王美强 李勇军(91)
考虑路径可行性与仓储集货模式下的回收车辆路径问题研究	刘艳秋 徐世达 张 颖 李 佳(98)
基于后悔理论的混合型多属性案例决策方法	韩 菁 叶顺心 柴 建 黎建强(108)
对偶性在线性规划预处理中的应用分析	胡艳杰 黄思明 N. Adrien 武 昱(117)
供需同时不确定关系型供应链契约设计与决策	高 佳 王 旭(127)
动态博弈下引导企业低碳技术创新的政府低碳规制研究	王志国 李 磊 杨善林 龚本刚(139)
伙伴关系、物流能力与供应链整合关系研究	刘华明 王 勇 李后建(148)
基于持续运营机会约束的竞争设施点选址研究——一种有效的实数编码遗传求解算法	朱华桂(158)
基于改进量子进化算法的车货供需匹配方法研究	牟向伟 陈 燕 高书娟 姚思雨(166)
简讯：“2016 年中国管理科学第十八届学术年会优秀报告论文奖”获奖名单	(165)

---

[期刊基本参数]CN11-2835/G3 \* 1984 \* b \* 16 \* 176 \* zh \* p \* ¥20.00 \* 2300 \* 19 \* 2016-12

刊名题词:华罗庚

本刊责任编辑:付宝娟 吴登生 贾传亮

万方数据

# Chinese Journal of Management Science

Vol. 24 No. 12 2016

---

## CONTENTS

- The Model Choice and Design of Credit Assets Securitization** ..... ZHANG Yong, YANG Zhao-jun, LUO Peng-fei(1)
- The Role of Cojumps and Macro Announcements in Forecasting the Realized Volatility of Chinese CSI 300 Index**  
..... QU Hui, CHENG Si-yi(10)
- An Analysis of the Relationship between Order Imbalance and Stock Returns through Quantile Regression**  
**Approach for Large-scale Data** ..... XU Qi-fa, CAI Chao, JIANG Cui-xia(20)
- Contrarian Effect of Semi-Parametric Alpha Strategy** ..... ZHANG Li, DENG Li-ying, ZHOU Yong(30)
- The Inertia Interval of Asset and Its' Portfolio under the Knight Uncertainty** ..... HE Chao-lin, LIU Meng(39)
- The Value Analysis of Telecommunications License Based on Real Option** ..... WANG Xue-rong, LI Qing-hui(47)
- ETF Optimal Asset Allocation and Empirical Research based on Dynamic Conditional Risk Constraint under**  
**Time-Varying Loss-Aversion** ..... WANG Liang, JIA Yu-jie, LIU Xiao(54)
- Research on Assembly Line Scheduling Problem Based on Improved Genetic Algorithm**  
..... LI Jin, LI Hong, XU Li-Li, WANG Hua(63)
- The Lateral Transshipments Model and Algorithm for Three-echelon Spare Parts Logistics Network with**  
**Service Levels Constraints** ..... JI Shou-feng, WAN Peng, SUN Qi, LUO Rong-juan(72)
- Knowledge Transfer between Enterprises under Asymmetric Risk Attitude** ..... CHEN Guo, QI Er-shi(82)
- A Two-stage DEA Model for Evaluation of Supplier with Dual-role and Undesirable Output Factors**  
..... WANG Mei-qiang, LI Yong-jun(91)
- Research on Recycling Path Optimization Problem with Feasibility of Path and Concentrated Treatment Mode**  
..... LIU Yan-qiu, XU Shi-da, ZHANG Ying, LI Jia(98)
- Case-Based Decision Analysis Method based on Regret Theory for Hybrid Multiple Attributes Decision Making**  
..... HAN Jing, YE Shun-xin, CHAI Jian, LI Jian-qiang(108)
- Analysis of Using Duality for Presolving in Linear Programming**  
..... HU Yan-jie, HUANG Si-ming, N. Adrien, WU Yu(117)
- Contract Design and Decision Making of Multi-Uncertainty Relational Supply Chain** ..... GAO Jia, WANG Xu(127)
- The Research on Government Low-carbon Regulation Guiding Enterprise Low-carbon Technology Innovation**  
**in Dynamic Game** ..... WANG Zhi-guo, LI Lei, YANG Shan-lin, GONG Ben-gang(139)
- The Impact of Partnership and Logistics Capability on Supply Chain Integration**  
..... LIU Hua-ming, WANG Yong, LI Hou-jian(148)
- Research on Competitive Facility Location Under the Operation-sustainable Chance Constraint**  
**—An Efficient Real Coded Genetic Algorithm** ..... ZHU Hua-gui(158)
- Vehicle and Cargo Matching Method Based on Improved Quantum Evolutionary Algorithm**  
..... MU Xiang-wei, CHEN Yan, GAO Shu-juan, YAO Si-yu(166)

《中国管理科学》(月刊、1984年创刊) 2016年12月 第24卷

大统筹 广优选 联运输  
精统计 抓质量 理数据  
建系统 策发展 利工具  
巧计算 重实践 明真理

——华罗庚

通讯地址: 北京海淀区中关村北一条15号  
(北京8712信箱)

联系电话: 010-62542629

传 真: 010-62542629

邮政编码: 100190

电子信箱: zggkx@casipm.ac.cn

网 址: [Http://www.zggkx.com](http://www.zggkx.com)

编辑出版: 《中国管理科学》编辑部

印刷单位: 北京昌平百善印刷厂

国内总发行: 北京报刊发行局

国外总发行: 中国国际图书贸易总公司

国内发行代号: 82-50

国外发行代号: 1562BM

国际标准刊号: ISSN 1003-207X

国内统一刊号: CN11-2835/G3

定价: 20元