



北京大学中文核心期刊要目总览
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
中国科学院科技战略咨询研究院

ISSN 1003-207X



2020 第四期
第28卷

中国管理科学

第 28 卷 第 4 期(总第 186 期)

股指期货交易加剧了中国股票市场波动性吗?——基于投资者结构的理论和实证研究	陈其安 张 慧 陈抒妤(1)
基于贝叶斯方法的中国商业银行同业借贷网络中系统风险研究	严 冠 刘志东(14)
基于 LSTM 神经网络的金融时间序列预测	欧阳红兵 黄 亢 闫洪举(27)
跨部门金融机构系统重要性和共振效应的动态演化研究——基于中国 A 股市场的实证	陈暮紫 赵婷婷 刘承林 陈 敏(36)
考虑微观结构噪声与测量误差的波动率预测	赵 华 肖佳文(48)
动态 Nelson—Siegel 模型与无套利约束相容吗?——来自中债国债收益率曲线的经验证据	孔继红 岳 伟(61)
零售商运营视角下投贷联动最优投资结构模型	李 鑫 于 辉(73)
回收模式相异的零售商主导型闭环供应链竞争模型研究	孙 浩 王 磊 李 晨 胡劲松 钟永光 达庆利(86)
考虑社会责任的供应链定价与碳减排决策	唐书传 刘云志 肖条军(99)
考虑排污权市场价格不确定性的企业生产决策	金 帅 顾 敏 盛昭瀚 苑玉锋(109)
自建 VS. 并购:物流一体化竞争下的电商平台演化博弈	夏德建 王 勇 石国强(122)
风险集聚类邻避冲突事件随机演化情景分析	陈 恒 卢 巍 杜 蕾(131)
群体性突发事件化解机制的随机演化博弈模型	宋民雪 刘德海(142)
基于演化博弈的 PPP 项目绩效支付机制仿真与优化	梁秀峰 张飞涟 颜红艳(153)
带权重约束的 DEA 超效率评价模型及其应用研究	龚日朝 刘俞希 潘芬萍(164)
一种基于时差的工期索赔分析方法	张立辉 柴剑雪 乞建勋 邹 鑫(174)
有限理性下序贯价格竞争的动态演化	宫庆彬 杨 哲(186)
现代服务业是否有助于推动城镇化?——基于产城融合视角的 PVAR 模型分析	徐海峰 王晓东(195)
公众参与下政府与游戏企业发展策略的演化博弈分析	曲国华 刘 雪 曲卫华 张 强(207)
基于一致性度量的概率模糊语言多属性群决策方法	任嵘嵘 孟一鸣 李晓奇 赵 萌(220)

Chinese Journal of Management Science

Vol. 28 No. 4 2020

CONTENTS

Does Stock Index Futures Trading Increase the Stock Market Volatility in China? —Theoretical and Empirical	
Research Based on Investor Structure	CHEN Qi-an, ZHANG Hui, CHEN Shu-yu(1)
Systemic Risk in China's Interbank Liability Networks Based on the Bayesian Methodology	
YAN Guan, LIU Zhi-dong(14)	
Prediction of Financial Time Series Based on LSTM Neural Network	
OUYANG Hong-bing, HUANG Kang, YAN Hong-ju(27)	
Dynamic Evolution Study on Inter-sector Financial Institution Systemic Importance and Resonance Effects	
CHEN Mu-zi, ZHAO Ting-ting, LIU Cheng-lin, CHEN Min(36)	
Volatility Forecasting in the Presence of Microstructure Noise and Measurement Error	
ZHAO Hua, XIAO Jia-wen(48)	
Is Dynamic Nelson-Siegel Model Compatible with Arbitrage Free —— Empirical Evidence from China Treasury	
Yield Curves	KONG Ji-hong, YUE Wei(61)
Optimal Investment Structure Model on Investment Linkage from the Perspective of Retailer Operation	
LI Xin, YU Hui(73)	
Research on Game Models of Competitive Retailer-led Closed Loop Supply Chains with Different Collection Modes	
SUN Hao, WANG Lei, LI Chen, HU Jin-song, ZHONG Yong-guang, DA Qing-li(86)	
Pricing and Carbon Emission Reduction Decisions in A Socially Responsible Supply Chain	
TANG Shu-zhuan, LIU Yun-zhi, XIAO Tiao-jun(99)	
Firm's Production Decision under Emission Permits Price Uncertainty	
JIN Shuai, GU Min, SHENG Zhao-han, YUAN Yu-feng(109)	
Self-construction Versus Merger and Acquisition: Evolutionary Game of E-commerce Platforms on Logistics Integration	
Competition	XIA De-jian, WANG Yong, SHI Guo-qiang(122)
Stochastic Evolutionary Scenario Analysis of Risk Set Clustering NIMBY Conflicts Events	
CHEN Heng, LU Wei, DU Lei(131)	
Stochastic Evolutionary Game Model for Resolution Mechanism of Mass Events	
SONG Min-xue, LIU De-hai(142)	
Simulation and Optimization of PPP Project Performance Payment Mechanism Based on Evolutionary Game	
LIANG Xiu-feng, ZHANG Fei-lian, YAN Hong-yan(153)	
DEA Super Efficiency Evaluation Model with Weight Constraints and Its Application	
GONG Ri-zhao, LIU Yu-xi, PAN Fen-ping(164)	
A Time Claim Method Based on Float	
ZHANG Li-hui, CHAI Jian-xue, QI Jian-xun, ZOU Xin(174)	
Dynamics of Sequential Pricing Game Model with Bounded Rationality	
GONG Qing-bin, YANG Zhe(186)	
Can Modern Service Industry Promote Urbanization? —— An PVAR Analysis Based on the Perspective of City-industry	
Integration	XU Hai-feng, WANG Xiao-dong(195)
Evolutionary Game Analysis of Development Strategies of Government and Game Enterprises under Public	
Participation	QU Guo-hua, LIU Xue, QU Wei-hua, ZHANG Qiang(207)
Consensus Measure Method for Probabilistic Linguistic Information in Multi-attribute Group Decision Making	
REN Rong-rong, MENG Yi-ming, LI Xiao-qi, ZHAO Meng(220)	

《中国管理科学》(月刊、1984 年创刊) 2020 年 4 月 第 28 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: zgglkx@casipm.ac.cn

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

编 辑 出 版: 《中国管理科学》编辑部

印 刷 单 位: 北京科信印刷有限公司

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: 30 元