



QK2039493

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 第七期  
第28卷



# 中国管理科学

第 28 卷 第 7 期(总第 189 期)

考虑投资者情绪的中国股市自激发效应研究	唐振鹏 吴俊传 冉 梦 张婷婷(1)
宏观压力测试下商业银行零售信贷产品 PD 模型预测研究	熊一鹏 熊正德 姚 柱(13)
基于 LSTHAR 模型的投资者关注对股市波动影响研究	瞿 慧 沈 微(23)
中国影子银行违约风险和防范机制研究——来自上市公司委托贷款数据的经验证据	钱雪松 屈 伸 康 瑾 杜 立(35)
基于近邻截断的跳跃扩散过程波动函数的设定检验	陈 强 龚玉婷(45)
流动性供给与日内价格效率——基于中国股票市场的实证研究	马 丹 王春峰 房振明(57)
基于局部相关系数和截尾扭曲混合 Copula 的杠杆效应识别和度量	沈根祥 邹欣悦(68)
中国货币政策对美国的溢出效应研究——基于两国开放经济 DSGE 模型的分析	赵 星 崔百胜(77)
需求扰动下供应链反向保理鲁棒决策	陈中洁 于 辉(89)
不确定需求下考虑供应商参与机制的应急资源配置鲁棒优化研究	张梦玲 王 晶 黄 钧(102)
基于风险规避的双渠道制造商在线推介策略研究	李增禄 郭 强 聂佳佳(112)
部分信息下生鲜农产品采购外包问题研究	周继祥 王 勇 邱晗光(122)
考虑消费者策略行为的供应链两周期定价与契约设计	张旭梅 王大飞 任廷海 官子力 但 斌(132)
基于消费者损失效用的概率销售策略研究	杨 光 刘新旺 秦晋栋(146)
存在议价能力和副产品协同生产的制造商最优产量决策	周 品 徐 和 陆 芬(156)
信息技术治理影响分销渠道敏捷的机理研究	池毛毛 李延晖 王伟军 卢新元(164)
企业集群产品质量监管演化与仿真研究	孔庆山 张 芹 杨蕙馨 施建刚(174)
电子中介中考虑第三方评价的多属性商品交易匹配研究	李永海 樊治平(184)
成本控制、棘轮效应与最优激励契约	崔健波 罗正英(196)
带时间窗装卸货问题的改进多策略分组编码遗传算法	郭东威 丁根宏 刘 伟(204)
基于进度计划分形特征的缓冲确定方法研究	张俊光 李 凯(212)
基于柔性资源约束的前摄性项目调度优化研究	马 咏 何正文 郑维博(220)
简讯：“第二十二届中国管理科学学术年会征文通知”	(163)

[期刊基本参数]CN11-2835/G3 \* 1984 \* b \* 16 \* 230 \* zh \* p \* ¥30.00 \* 2200 \* 22 \* 2020-7

刊名题词: 华罗庚

本刊责任编辑: 付宝娟 吴登生 高敏刚

# Chinese Journal of Management Science

Vol. 28 No. 7 2020

## CONTENTS

- Research on The Self-exciting Effect of Chinese Stock Market Considering Investor Sentiment ..... TANG Zhen-peng, WU Jun-chuan, RAN Meng, ZHANG Ting-ting(1)(1)
- Under the Macroscopic Stress Test Commercial Bank Retail Credit Products PD Model Prediction Research ..... XIONG Yi-peng, XIONG Zheng-de, YAO Zhu(13)
- The Impact of Investor Attention on Market Volatility Based on the LSTHAR Model ..... QU Hui, SHEN Wei(23)
- A Study on Default Risk and Prevention Mechanism of China Shadow Banking—Evidence from Entrusted Loans of Listed Firm ..... QIAN Xue-song, QU Shen, KANG Jin, DU Li(35)
- Specification Test of Volatility Functions in Jump Diffusion Processes using Nearest Neighbor Truncation ..... CHEN Qiang GONG Yu-ting(45)
- Liquidity Provision and Intraday Price Efficiency—Evidence on Chinese Stock Market ..... MA Dan, WANG Chun-feng, FANG Zhen-ming(57)
- Identification and Measurement of Leverage Effects Using Local Correlation and Truncated Distorted Mix Copula Constructing ..... SHEN Gen-xiang, ZOU Xin-yue(68)
- The Spillover Effects of China's Monetary Policy on the United States—An Analysis based on the Two Countries' Open DSGE Model ..... ZHAO Xing, CUI Bai-sheng(77)
- Robust Decision to Reverse Factoring Supply Chain with Demand Disturbance ..... CHEN Zhong-jie, YU Hui(89)
- Research on Robust Optimization of Emergency Resource Allocation Based on Supplier Participation Mechanism under Uncertain Demand ..... ZHANG Meng-ling, WANG Jing, HUANG Jun(102)
- Dual-channel Manufacturer's Referral Strategies Based on Risk Aversion ..... LI Zeng-lu, GUO Qiang, NIE Jia-jia(112)
- Study on the Outsourcing of Fresh Agricultural Products under Partial Information ..... ZHOU Ji-xiang, WANG Yong, QIU Han-guang(122)
- Two-period Pricing and Contract Design of Supply Chain Considering Consumers' Strategic Behavior ..... ZHANG Xu-mei, WANG Da-fei, REN Ting-hai, GUAN Zi-li, DAN Bin(132)
- Probabilistic Selling Policy Based on Consumers' Loss Utility ..... YANG Guang, LIU Xin-wang, QIN Jin-dong(146)
- The Optimal Production Decision with By-Product Synergy and Bargaining ..... ZHOU Pin, XU He, LU Fen(156)
- How to Generate Channel Agility through Information Technology Governance ..... CHI Mao-mao, LI Yan-hui, WANG Wei-jun, LU Xin-yuan(164)
- The Evolution and Simulation of Product Quality Supervision in Enterprise Clusters ..... KONG Qing-shan, ZHANG Qin, YANG Hui-xin, SHI Jian-gang(174)
- Method for Multiple-Attributes Trade Matching Considering Evaluations of the Third-Party in E-Brokerage ..... LI Yong-hai, FAN Zhi-ping(184)
- Cost Control, Ratchet Effect and Optimal Incentive Contract ..... CUI Jian-bo, LUO Zheng-ying(196)
- Improved Multi-Strategy Grouping Genetic Algorithm for the Pickup and Delivery Problem with Time Windows ..... GUO Dong-wei, DING Gen-hong, LIU Wei(204)
- Critical Chain Buffer Sizing Based on the Schedule Fractal Dimension ..... ZHANG Jun-guang, LI Kai(212)
- Proactive Project Scheduling Optimization Based on Flexible Resource Constraint ..... MA Yong, HE Zheng-wen, ZHENG Wei-bo(220)



《中国管理科学》(月刊、1984年创刊) 2020年7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: 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