

教师资料

姓名	朱宏泉	系别	金融与财务 ²
职务/职称	教授, 博导, 副院长	研究方向	资产定价、金融市场与金 务
学历	博士	政治面貌	党员
办公电话	87601865	电子邮箱	hqzhu@swjtu

教育背景:

2001年毕业于中国科学院数学与系统科学研究院, 获管理科学与工程博士学位

1991年毕业于中国科学院系统科学研究所, 获系统科学硕士学位

1985年毕业于四川大学数学系, 获理学学士学位

社会活动及兼职:

中国运筹学会金融工程与金融风险分会理事

工作经历:

1985年进入西南交通大学应用数学系工作, 2001年-2004年先后在香港科技大学商学院、香港大学7月加入西南交通大学经济管理学院。先后任金融与会计学系、金融与财务学系系主任、院长助理。2004年至今, 多次在中国金融国际年会、中国系统工程学会年会等国际、国内学术会议上交流。2005年获四川省交流访问。为国家自然和社会科学基金等事项评审专家。

科学研究:

(一) 文献及获奖情况概述:

主要从事资产定价、金融市场与机构、公司财务的研究。特别关注中国证券市场中的相关问题, 对深刻的见解。主持国家自然科学基金、教育部人文社科基金, 参与教育部创新团队的研究工作。在《Journal of Banking and Finance》、《管理科学学报》、《系统科学学报》、《系统工程的理论与应用》等期刊上发表多篇论文。多次在中国金融国际年会、中国系统工程学会年会等国际、国内学术会议上交流。2005年获四川省自然科学基金项目, 获四川省优秀毕业生、一人获校优秀硕士学位论文称号, 指导的本科生获校级优秀毕业论文称号。

(二) 代表专著及论

[1]Meng Rujing, Ning Xiangdong, Zhou Xianming, Zhu Hongquan, 2011. Do ESOPs Enhance Firm Performance? An Empirical Study. *Journal of Banking and Finance*. 35: 1541-1551.

[2]朱宏泉, 陈林, 潘宁宁. 行业、地区与市场信息, 谁主导中国证券市场价格变化[J]. 中国管理科学, 2011, 23(6): 2

[3]朱宏泉, 舒兰, 王鸿, 范露萍. 杜邦分析与价值判断—基于A股上市公司的实证研究[J]. 管理评论, 2011, 23(6): 2

[4]朱宏泉, 周丽, 余江. 我国商业银行非利息收入及其影响因素分析[J]. 管理评论, 2011, 23(6): 2



- [5]潘宁宇, 朱宏泉, 陈林. 股票流动性与资产流动性的相关性—理论与实证分析[J]. 系统工程理论
- [6]王鸿, 朱宏泉, 涂瑞. 机构投资者持股与应计质量相关性的资产定价—来自中国A股市场的证据[J].
- [7]王鸿, 朱宏泉. 应计质量的资本市场定价—来自中国A股市场的证据[J]. 系统工程, 2010, 28(1): 2
- [8]朱宏泉, 马晓维, 李亚静, 段妮妮, 朱宏志. 基金投资者投资行为影响因素研究[J]. 管理评论, 2
- [9]Zhu Hongquan, Li Jie, Ma Xiaowei, 2009. Liquidity, Liquidity Measures and Expected Return: A Market. *China Finance Review*, 3(1): 1-20.
- [10]朱宏泉, 李亚静. 集中与分散化投资—谁是基金的最优选择? [J] 管理评论, 2008, 20(2): 9-13.
- [11]Li Yajing, Zhu Hongquan, Luan Mingjing, 2008. Realizing Profits Immediately: the Disposition Effect *Journal of Southeast University*, 2008, 24(6): 180-186.
- [12]李亚静, 朱宏泉, 黄登仕, 周应峰. 股权结构与公司价值创造[J]. 管理科学学报, 2006, 9(5): 6
- [13]朱宏泉, 李亚静. 不依赖市场基准指数的基金投资能力分析[J]. 系统工程, 2005, 23(11): 11-17.
- [14]朱宏泉, 李亚静. 基于季度投资组合的基金投资能力分析[J]. 管理评论, 2005, 17(7): 3-9.
- [15]李亚静, 朱宏泉, 黄登仕, 周应峰. 董事会控制、经理报酬与公司经营绩效[J]. 系统工程理论
- [16]李亚静, 朱宏泉, 黄登仕, 周应峰. EVA与传统会计指标的比较—中国证券市场的实证分析[J].
- [17]Zhu Hongquan, Lu Zudi, Wang Shouyang, Abdol S. Soofi, 2004. Causal Linkages Among Shanghai, S *International Journal of Theoretical and Applied Finance*, 2004, 7(2): 135-149.
- [18]李亚静, 何跃, 朱宏泉. 中国股市收益率与波动性长记忆性的实证研究[J]. 系统工程理论与实
- [19]朱宏泉, 卢祖帝, 汪寿阳. Value-at-Risk的核估计理论[J]. 系统科学与数学, 2002, 22(3): 365-3
- [20]朱宏泉, 卢祖帝, 汪寿阳. 中国股市的Granger 因果关系分析[J]. 管理科学学报, 2001, 4(5): 7-1

主持或参与科研项目:

- 1.投资者信心对资产定价的影响研究, 国家自然科学基金, 2010年-2012年, 批准经费26万元, 项目团队成员: Junbo Wang、王剑虹等。
- 2.异质信念、市场环境与资产定价, 国家自然科学基金, 2012年-2015年, 批准经费35万元, 项目团队成员: Junbo Wang、董大勇等。
- 3.流动性、流动性风险的测度有效性研究—基于资产定价的视角, 教育部人文社会科学研究项目, 编号: 09YJA790169, 项目主持人, 项目团队成员: 董大勇、王剑虹等。
- 4.行为决策理论及其在管理中的应用研究, 教育部创新团队项目, 2009年-2011年, 批准经费300万(第3)。

教学概况:

金融市场学 本科

投资学 MBA

金融衍生工具 MBA

金融市场微观结构理论 硕士

实证金融学 博士

