

## 教师资料

姓名	魏宇	系别	金融与财务学系
职务/职称	教授, 博导, 系主任	研究方向	金融风险、金融工程与金融复杂性
学历	博士	政治面貌	党员
办公电话	87634660	电子邮箱	ywei@swjtu.cn



### 教育背景:

2004年毕业于西南交通大学经济管理学院, 获管理学博士学位。

### 工作经历:

2004年留校任教至今, 2006年晋升为副教授, 2008年被聘为博士生导师

### 科学研究:

#### (一) 文献及获奖情况概述:

目前已在各类期刊发表论文60余篇, 其中在国家自然科学基金委管理科学部认定的重要管理学期刊上发表论文30余篇, 另外在SSCI、SCI、Econlit收录期刊发表论文10篇, 并先后主持3项国家自然科学基金课题, 主研了国家自然科学基金杰出青年基金和教育部长江学者与创新团队发展计划项目各一项。

#### (二) 代表专著及论文

[1] Wang, Y., Wei, Y., Wu, C. Analysis of efficiency and multifractality of gold market based on multifractal detrended fluctuation analysis [J]. Physica A, 2011, 390, 817-827.

[2] Wang, Y., Wei, Y., Wu, C. Detrended fluctuation analysis on spot and futures markets of West Texas Intermediate crude oil [J]. Physica A, 2011, 390, 864-875.

[3] 林宇, 黄登仕, 魏宇. 胖尾分布及长记忆下的动态EVT\_VaR测度研究[J]. 管理科学学报, 2011, 14 (7) : 71-82.

[4] Wang, Y., Wu, C., Wei, Y. Can GARCH-class models capture long memory in WTI crude oil markets[J]? Economic Modelling, 2010, doi:10.1016/j.econmod.2010.11.002.

[5] Wei, Y., Wang, Y., Huang, D., Forecasting crude oil market volatility: Further evidence using GARCH-class models[J]. Energy Economics, 2010, 32, 1477 - 1484.

[6] Wang, Y., Wei, Y., Wu, C. Auto-correlated behavior of WTI crude oil volatilities: A multiscale perspective[J]. Physica A, 2010, 389, 5759 - 5766.

[7] Wang, Y., Wei, Y., Wu, C. Cross-correlations between Chinese A-share and B-share markets[J]. Physica A, 2010, 389, 5468 - 5478.

[8] 魏宇, 黄登仕, 王建琼, 朱宏泉, 余江, 赖晓东. 我国黄金现货市场的动态VaR预测模型研究[J]. 管理评论, 2010, 22 (8) : 30-38.

[9] 王鹏, 魏宇. 不同抽样频率波动模型的预测精度比较[J]. 管理学报, 2010, 7 (8) : 1258-1262.



- [10] 魏宇, 温晓倩, 赖晓东. 金融市场风险测度方法研究评述[J]. 中国地质大学学报(社科版), 2010, 10(7): 112-118.
- [11] 王鹏, 魏宇, 王建琼. 不同矩属性波动模型对中国股市波动率的预测精度分析[J]. 数理统计与管理, 2010, 29(3): 550-559.
- [12] 郭彦峰, 黄登仕, 魏宇, 林宇. A+H交叉上市股票间信息传递的不对称性研究[J]. 中国管理科学, 2010, 18(3): 10-16.
- [13] 林宇, 谭斌, 魏宇. 基于多元GARCH与极值理论的资产组合风险测度研究[J]. 管理学报, 2010, 7(4): 605-610.
- [14] 魏宇. 沪深300股指期货的波动率预测模型研究[J]. 管理科学学报, 2010, 13(2): 66-76.
- [15] 卫贵武, 黄登仕, 魏宇. 基于ET-WG和ET-OWG算子的二元语义群决策法[J]. 系统工程学报, 2009, 24(6): 744-748.
- [16] 林宇, 卫贵武, 魏宇, 谭斌. 基于Skew-t-FIAPARCH的金融市场动态风险VaR测度研究[J]. 中国管理科学, 2009(6): 17-24.
- [17] 王鹏, 魏宇. 金融市场的多分形特征及与波动率测度的关系[J]. 管理工程学报, 2009(4): 166-169.
- [18] 魏宇. 金融市场的多分形波动率测度、模型及其SPA检验[J]. 管理科学学报, 2009(5): 88-99.
- [19] 魏宇. 多分形波动率测度的VaR计算模型[J]. 系统工程理论与实践, 2009(9): 7-15. (EI)
- [20] 王鹏, 王建琼, 魏宇. 自回归条件方差-偏度-峰度: 一个新的模型[J]. 管理科学学报, 2009(5): 121-129.

主持或参与科研项目:

1.主研: 教育部长江学者和创新团队发展计划项目: “行为决策理论及其在管理中的应用研究”, 资助号: IRT0860, 资助额: 150万元, 资助时间: 2009.1~2011.12;