

[网站首页](#)[学院概况](#)[本科教育](#)[研究生教育](#)[学术研究](#)[党建工作](#)[团学天地](#)[校友工作](#)您当前所在位置：[首页](#)>>[学院概况](#)>>[学院师资](#)>>[教授](#)>>正文

教授

姓 名：凌爱凡
 性 别：男
 出生年月：
 政治面貌：中共党员
 毕业院校：西安交通大学
 毕业专业：计算数学
 职 务：副院长
 职 称：教授/博导
 邮 箱：aiffling@163.com
 自我介绍



一、基本情况

凌爱凡：江西财经大学金融学院教授，博士生导师，金融学院副院长，江西财经大学金融科技与监管研究中心主任。西安交通大学理学博士，中国科学院数学院博士后，新加坡国立大学访问学者，哥伦比亚大学商学院访问学者。江西省百千万人才工程人选，江西省青年井冈学者，江西财经大学首批百名人才计划资助者。

他主要从事金融工程与风险管理，资产定价，公司金融理论，系统性风险管理等研究，在 *Journal of Economics and Dynamic Control*, *European Journal of Operational Research*, *管理科学学报*, *系统工程理论与实践* 等国内外学术期刊发表论文20余篇。获得国家自然科学基金项目3项，省部级项目多项。

二、教育背景

1996.9-2000.7：江西师范大学，数学专业，理学学士
 2002.9-2005.7：南昌大学，基础数学专业：理学硕士
 2005.9-2008.11：西安交通大学，计算数学专业，理学博士

三、开设课程

本科生课程：金融风险管理；金融工程；金融科技与区块链

研究生课程：金融数学；金融随机分析；动态最优化与货币政策；金融经济学；资产定价

四、研究领域

金融衍生产品定价
 鲁棒投资组合决策与模糊厌恶决策理论
 DSGE 模型及其应用
 系统性风险管理
 资产定价
 金融科技与区块链
 契约理论

科研成果

五、科研成果

1. 已发表论文

英文期刊论文

[14] Aifan Ling (凌爱凡), Jie Sun, Meihua Wang, Robust Multi-period Portfolio Selection Based on Downside Risk with Asymmetrically Distributed Uncertainty Set. 2019, *European Journal of Operational Research*, 2019, forthcoming, In press. (SCI, Top in Management science)

[13] Aifan Ling (凌爱凡), Jie Sun, Naihua Xiu, Xiaoguang Yang, Robust two-stage stochastic linear optimization with risk aversion, *European Journal of Operational Research* 256 (2017) 215-229. (SCI, Top in Management science)

- [12] Aifan Ling (凌爱凡), An inexact non-interior continuation method for semidefinite programming: convergence analysis and numerical results, *Numerical Algorithms* (2016) 73:219–244, (SCI, 二区 in Applied math)
- [11] Aifan Ling (凌爱凡), Jie Sun, Xiaoguang Yang. Robust tracking error portfolio selection with worst-case downside risk measures, *Journal of Economic Dynamics and Control*, V39, February 2014(2): 178–207, (SSCI 经济学类国际著名期刊)
- [10] Aifan Ling (凌爱凡), Le Tang, A Numerical Study for Robust Active Portfolio Management with Worst-case Downside Risk Measure, *Mathematical Problems in Engineering*, V2014, 1-13, (SSCI/SCI)
- [9] Aifan Ling (凌爱凡), Chenxian Xu. Robust Portfolio Selection Involving Options under a Marginal + Joint Ellipsoidal Uncertainty Set, *Journal of Computational and Applied Mathematics* 236: 3373–3393. 2012, (SSCI/SCI, 二区 in Applied math)
- [8] Aifan Ling (凌爱凡), A VNS Metaheuristic with Stochastic Steps for Max 3-Cut and Max 3-Section. *Mathematical Problems in Engineering*, Volume 2012, Article ID 475018: 1-16, 2012, (SCI)
- [7] Aifan Ling (凌爱凡), Chenxian Xu, A new discrete filled function method for solving large scale max-cut problems, *Numerical Algorithm*, 60: 435–461, 2012, (SCI, 二区 in Applied math)
- [6] Aifan Ling (凌爱凡), Chenxian Xu, Approximation Algorithms for MAX RES CUT, *Journal of Applied Mathematics and Computing*, 2010, vol.33(1-2): 357-374, (SCI)
- [5] Aifan Ling (凌爱凡), Chenxian Xu A Discrete Filled Function Algorithm Embedded with Continuous Approximation, *European Journal of Operational Research* 197 (2009) 519–531. (SCI, Top in Management science)
- [4] Aifan Ling (凌爱凡), Approximation Algorithms for Max 3-Section Using Complex Semidefinite Programming Relaxation, 2009, LNCS 5573, pp. 219–230, (SCI)
- [3] Yu Li, Aifan Ling (凌爱凡), A Continuous Algorithm Based on A New NCP Function for the Max-Bisection Problem, *Chinese Journal of Engineering Mathematics*, 2009(5): 781-785.
- [2] Aifan Ling (凌爱凡), Chenxian Xu A modified VNS Metaheuristic for max-bisection problems, *Journal of Computational and Applied Mathematics*, 2008, 220 (1-2): 413–421. (SCI, 二区 in Applied math)
- [1] Ai-Fan Ling (凌爱凡), Cheng-Xian Xu, Feng-Min Xu, A discrete filled function algorithm for approximate global solutions of max-cut problems, *Journal of Computational and Applied Mathematics*, 2008, V220,(1–2): 643–660, (SCI, 二区 in Applied math)

中文期刊论文

- [9] 凌爱凡, 谢林利, 特异性尾部风险、系统性尾部风险、混合尾部风险与股票价格-----来自我国A股市场的证据. 2019, 管理科学学报, 已经录用, 排队发表。
- [8] 凌爱凡, 莫阳紫嫣, 我国开放式基金的“泵浦”现象, 中国管理科学, 2018年, 第9期
- [7] 凌爱凡, 陈骄阳, 嵌入GARCH波动率估计的Black-Litterman投资组合问题, 中国管理科学, 2018年, 第6期
- [6] 凌爱凡, 王嘉明, 严武, 好的开盘会有好的收盘吗——来自沪深 300 股指期货的经验证据, 当代财经, 2017年, 第12期。
- [5] 严武、熊航、凌爱凡, 公募基金年末业绩追逐与风险调整行为研究, 财贸经济, 2016年, 第9期
- [4] 凌爱凡, 杨晓光, 具有多元权值约束的鲁棒LPM 积极投资组合问题, 管理科学学报, 2013, 第8期
- [3] 凌爱凡, 杨晓光, 基于Google Trends注意力配置的金融传染问题, 管理科学学报, 2012年, 第11期
- [2] 凌爱凡, 吕江林, 具有联合椭圆不确定集与概率约束的鲁棒投资组合选择, 控制与决策, 2011年, 第4期
- [1] 凌爱凡, 吕江林, 有限周期内具有习惯形成与财富偏好的消费与储蓄问题, 系统工程理论与实践, 2011, 第1期。

2. 工作论文

- [6] Aifan Ling (凌爱凡), Zizi Cao, CVaR and Cross-section expected returns, Working paper in 2019
- [5] 凌爱凡, 朱志凯, “网络炒作效应”与加密货币市场的资产定价: 基于Google 搜索关注度方法, 2019年工作论文。
- [4] 胡志军, 凌爱凡, 杨超, 我国A股市场的模糊性溢价: 基于日内高频数据的实证分析, 2018年工作论文。
- [3] 凌爱凡, 朱志凯, 基于风险因子收益率预测的“风格投资”实证研究, 2018年工作论文。
- [2] 凌爱凡, 杨炎君, 基金的投资技能提高了基金绩效吗? ----基于 q -因子模型的实证分析, 2018年, 工作论文。
- [1] Aifan Ling (凌爱凡), Neng Wang, Jianjun Miao, Robust Financial contracting, Working paper in 2018。

六. 主持的科研项目

- [10] 国家自然科学基金面上项目: 系统性风险鲁棒度量及对资产价格的影响机制, 编号: 71771107, 执行时间: 2018.1–2021.12, 在研。
- [9] 江西省青年科学家培育资助项目, 执行时间: 2015.12–2018.12, 已结题。
- [8] 江西省教育厅重点项目: 系统性风险度量及在我省金融机构风险预警中的应用 GJJ150440, 2016.1–2018.12, 已结题。
- [7] 江西省自然科学基金项目: 基于鲁棒最优控制方法的动态系统性风险度量与配置研究, 编号: 20161BAB201026, 执行时间: 2016.1–2018.12, 已经结题。
- [6] 国家自然科学基金面上项目: 有限注意力配置下的鲁棒动态投资决策与金融传染问题研究, 编号: 71300190, 执行时间: 2014.1--2017.12. 已完成。
- [5] 国家自然科学基金青年基金项目: 含交易费用的鲁棒投资组合问题的全局优化算法研究, 编号: 71001045, 执行时间: 2011.1--2013.12. 已完成。

- [4] 第5批中国博士后特别资助项目：有限注意力配置与金融传染：理论与实证研究，编号：2012T0148，已完成。
- [3] 第48批中国博士后科学基金面上资助项目：极端市场环境下的鲁棒最优投资决策研究，编号：20100480491，已完成。
- [2] 江西省教育厅科学项目：不确定环境下的投资组合优化问题研究，编号：GJJ10114. 已完成。
- [1] 江西省自然科学基金青年项目：图的划分问题与非凸二次规划及其在投资决策中的应用研究，编号：20114BAB211008，执行时间：2012.1-2014.12. 项目负责人。已完成。

七、研究生招生

研究生可以根据兴趣从事如下研究方向之一（但不限于）：

- A. DSGE 模型及其应用
- B. 金融衍生产品定价
- C. 系统性风险度量与金融稳定性
- D. 鲁棒投资决策理论和模糊厌恶模型
- E. 契约理论
- F. 金融科技与区块链、ICO 与数字货币
- G. 资产定价理论与实证

欢迎具有数学、计算机与信息科学、金融、经济、管理科学与工程、控制工程等专业背景的优秀学子报考其博士生和硕士研究生。



版权所有 Copyright © 2013 江西财经大学金融学院 院长信箱: jxcdjrxy@jxufe.edu.cn
学院地址：江西财经大学蛟桥园 邮编：330013 联系电话：0791-83816792

友情链接: ▼