



师资队伍

师资力量

全体教师

博士生导师

硕士生导师

当前位置: [首页](#)>>[师资队伍](#)>>[全体教师](#)>>正文

王伟

2019-03-11 13:30 (点击: 419)

基本信息:

姓名: 王伟
专业: 概率论与数理统计
职称: 副教授
E-mail: wangwei2@nbu.edu.cn

研究方向:

1. 金融工程 Financial Engineering
2. 保险精算 Actuarial

教育背景:

2007.09-2010.06 华东师范大学金融与统计学院 博士
2003.09-2006.06 中南大学概率研究所 硕士
1999.09-2003.06 中南大学应用软件系 本科

工作经历:

2015.12-至今 宁波大学金融工程系 副教授
2010.07-2015.12 宁波大学金融工程系 讲师

访学经历:

2017.08-2018.08 加拿大约克大学数学与统计系
2013.08-2013.12 美国中田纳西州立大学数学与统计系

学术兼职:

《Math Review》评论员

代表性论文与出版物:

1. Qian Linyi, Shen Yang, Wang Wei, Yang Zhixin. Valuation of risk-based premium of DB pension plan with terminations, *Insurance: Mathematics and Economics*, 2019, In Press.
2. Qian Linyi, Wang Wei, Wang Ning, Wang Shuai. Pricing and hedging equity-indexed annuities via local risk-minimization, *Communications in Statistics-Theory and Methods*, 2019, In Press.
3. Qian Linyi, Jin Zhuo, Wang Wei, Chen Lyu. Pricing dynamic fund protections for a hyperexponential jump diffusion process, *Communications in Statistics-Theory and Methods*, 2018, 47(1): 210-221.
4. Su Xiaonan, Wang Wei, Wang Wensheng. Pricing warrant bonds with credit risk under a jump diffusor process, *Discrete Dynamics in Nature and Society*, 2018, 1-10.
5. Han Miao, Song Xuefeng, Wang Wei, Niu Huawei. Pricing equity-linked foreign exchange option under a regime switching multi-scale jump diffusion model, *Dynamic Systems and Applications*, 2018, 27(3): 475-493.
6. 甘少波, 王伟. 随机成本下再保险公司的最优投资及再保险策略, *统计与决策*, 2017, 2:152-155.
7. 王伟, 甘少波. 存货利差下确定缴费型养老金的最优投资策略, *统计与决策*, 2017, 8: 162-165.
8. 张林娜, 温利民, 王江峰, 王伟. 基于广义线性模型的个体索赔RBNS准备金评估, *应用数学学报*, 2017, 40(4): 573-593.
9. Wang Wei, Su Xiaonan, Gan Shaobo, Qian Linyi. Pricing vulnerable European options under a Markov-modulated jump diffusion process, *WSEAS Transactions on Mathematics*, 2017, 16: 123-132.
10. 甘少波, 王伟. 马尔可夫机制转换模型下确定缴费型养老金计划的最优投资策略, *数学的实践与认识*, 2016, 46(22): 97-104.
11. Wang Wei, Jin Zhuo, Qian Linyi, Su Xiaonan. Local risk minimization for vulnerable European contingent claims written on nontraded assets under Markov-modulated models, *Stochastic Analysis and Application*, 2016, 34: 662-678.
12. Chen Lv, Qian Linyi, Shen Yang, Wang Wei. Constrained investment reinsurance optimization with regime switching under variance premium principle, *Insurance: Mathematics and Economics*, 2016, 71: 253-267.
13. Jin Zhuo, Qian Linyi, Wang Wei, Wang Rongming. Pricing dynamic fund protections with regime

- switching, *Journal of Computational and Applied Mathematics*, 2016, 297:13-25.
14. Wang Wei, Dong Liegang, Su Xiaonan. Pricing forward starting options under regime switching jump diffusion models, *WSEAS Transactions on Mathematics*, 2016, 15:185-195.
 15. Wang Wei, Qian Linyi, Wang Wensheng. Hedging of contingent claims written on nontraded assets under Markov-modulated models, *Communications in Statistics – Theory and Methods*, 2016, 45(12):3575-3595.
 16. 章溢, 温利民, 王江峰, 王伟. 随机B-F准备金模型中事故年索赔均值的信度估计, *应用数学学报*, 2016, 39(2): 306-320.
 17. Wang Wei, Qian Linyi, Su XiaoNan. Pricing and hedging catastrophe equity put options under a Markov-modulated jump diffusion model, *Journal of Industrial & Management Optimization*, 2015, 11(2):493-514.
 18. Qian Linyi, Wang Wei, Wang Rongmin. Risk minimizing hedging strategy for an equity indexed annuity under a regime switching model, *Acta Mathematicae Applicatae Sinica*, 2015, 31(1): 101-110.
 19. 王伟, 赵奇杰. 马尔可夫调制的跳扩散过程下可分离交易可转换债券的定价, *华东师范大学学报* 2014, 6:39-48.
 20. 王伟, 苏小囡, 赵奇杰. 马尔可夫调制的跳扩散模型下远期生效看涨期权的定价, *应用概率统计* 2014, 30(6): 585-597.
 21. Wang Wei, Qian Linyi, Wang Wensheng. Hedging strategy for unit-linked life insurance contract in stochastic volatility models, *WSEAS Transactions on Mathematics*, 2013, 12(4): 363-373.
 22. Qian Linyi, Wang Wei, Wang Rongming. Risk-minimizing portfolio selection for insurance payment process under a Markov-modulated model, *Journal of Industrial & Management Optimization*, 2013, 9(2) 411-429.
 23. 王伟, 钱林义, 温利民. Regime switching Lévy 模型下局部风险最小套期保值策略, *应用数学学报* 2013, 11(6): 1053-1071.
 24. 王伟, 赵奇杰. 带有违约风险的可转换债券的简约型定价, *应用概率统计*, 2013, 29(3): 287-296.
 25. Wen Liming, Wang Wei, Wang Jinglong. The credibility premiums for exponential principle, *Acta Mathematica Sinica*, 2011, 27(11): 2217-2228.
 26. Su Xiaonan, Wang Wei, Wang Wensheng. Insider's hedging for jump diffusion processes with applications to index tracking, *Journal of Dong Hua University*, 2011, 6: 571-575.
 27. Wang Wei, Wang Wensheng. Pricing vulnerable options under a Markov-modulated regime switching model, *Communications in Statistics – Theory and Methods*, 2010, 39(19): 3423-3433.
 28. Qian liyi, Wang Wei, Wang Rongming, Tang yincai. Valuation of equity indexed annuity under stochastic mortality and interest rate, *Insurance: Mathematics and Economics*, 2010, 47(2): 123-129.
 29. 王伟, 温利民, 章溢. Esscher保费下信度估计的比较, *华东师范大学学报*, 2010, 3:126-133.
 30. Wang Wei, Wang Wensheng, Wang Shuai. Pricing forward starting call option in a jump diffusion model *Journal of East China Normal University*, 2009, 5: 107-117.

科研项目:

1. 国家教育部人文社会科学基金: 马尔可夫机制转换模型下含信用风险的衍生品定价及稳健最优投资, 18YJC910012, 2017年3月—2020年12月, 主持。
2. 浙江省自然科学基金: 马尔可夫调节模型下含信用风险的衍生产品的定价及最优投资研究, LY17G010003, 2017年1月—2019年12月, 主持。
3. 浙江省自然科学基金: 图分解及相关设计的构造研究, LY17A010008, 2017年1月—2019年12月, 参与。
4. 宁波市自然科学基金: 马尔可夫机制转换模型下最优投资组合研究, 2016A610076, 2016年1月—2018年1月, 主持。
5. 国家教育部人文社会科学基金: 截面相依面板数据半参数动态混合双因子模型的理论及其在经济中的应用研究, 15YJA910004, 2015年1月—2018年12月, 参与。
6. 国家自然科学基金: 中国股市过度波动与崩溃的成因及对策--基于计算实验金融方法, 71373135, 2014年1月—2017年12月, 参与。
7. 宁波市自然科学基金: 马尔可夫机制转换模型下衍生产品的定价, 2013A610106, 2013年2月—2015年1月, 主持。
8. 国家自然科学基金: 单光子发射断层成像图像重建的定量优化分析研究, 61271398, 2013年1月—2016年12月, 参与。
9. 国家自然科学基金专项基金: Regime switching模型下衍生产品的套期保值11126124, 2012年1月—2012年12月, 主持。
10. 国家教育部人文社会科学基金: 马尔可夫调节模型下衍生产品的定价及套期保值, 12YJC910009, 2012年1月—2014年12月, 主持。
11. 浙江省自然科学基金: 马尔可夫体制变换模型下衍生产品的定价及风险对冲, LQ12A01006, 2012年1月—2014年12月, 主持。
12. 浙江省教育厅基金: 随机波动率模型下权益连结保险产品的风险对冲, Y201120129, 2011年10月—2013年10月, 主持。
13. 浙江省自然科学基金: 不连续随机系统的稳定性与应用研究, LY12F03010, 2012年1月—2014年12月, 参与。

教学状况:

1. 主讲本科《金融数学》、《金融工程学》、《概率统计》、《金融风险管理》、《公司财务》、《数理统计》等课程。
2. 主讲研究生《测度论》、《金融数学》等课程。

【关闭窗口】

宁波大学 | 图书馆

地址：宁波市江北区风华路818号宁波大学龙赛理科楼北楼；邮编：315211；电话：0574-87600795