

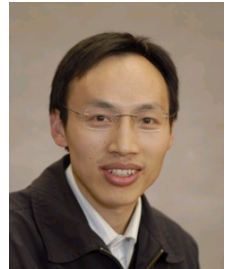
以学立业
厚德惠人



- ▶ 教师个人信息
- ▶ 科研成果
- ▶ 学术活动及社会服务
- ▶ 色彩空间

朱书尚

副教授
管理科学系
思源教授楼515室
25011170(TEL)
65642412(FAX)
sszhu@fudan.edu.cn



研究方向：投资组合选择、金融风险管理、运筹优化
学术观点：做至少自己看着有兴趣、有意义的研究

教育背景：

2003.07, 博士, 管理科学与工程, 中国科学院
2000.06, 硕士, 应用数学, 湘潭大学
1997.06, 学士, 概率统计, 湘潭大学

学术经历：

2010.07--2010.08, 访问学者, 香港中文大学
2009.07--2009.08, 访问学者, 香港中文大学
2006.07--2006.08, 访问学者, 香港中文大学
2005.04--2005.09, 访问学者, 日本京都大学
2003.01--2003.01, 访问学者, 香港中文大学
2001.10--2001.11, 访问学者, 香港中文大学

科研获奖：

2010.10, 2010年度“复旦大学复华奖教金文科科研成果个人奖”, 复旦大学

荣誉称号：

2006.05, 复旦大学世纪之星, 复旦大学

期刊论文：

1. Shushang Zhu, Guozhen Ruan, Xuexiang Huang. 2010. Some Fundamental Issues of Basic Line Search Algorithm for Linear Programming Problems. *Optimization* vol.59(8) 1283-1295.
2. Shushang Zhu, Duan Li, Xiaoling Sun. 2010. Portfolio Selection with Marginal Risk Control. *The Journal of Computational Finance* vol.14(1) 3-28.
3. Dashan Huang, Shushang Zhu, Frank J. Fabozzi, Masao Fukushima. 2010. Portfolio Selection under Distributional Uncertainty: A Relative Robust CVaR Approach. *European Journal of Operational Research* vol.203(1) 185-194.

4. Shushang Zhu, Fukushima Masao. 2009. Worst-Case Conditional Value-at-Risk with Application to Robust Portfolio Management. *Operations Research* Vol.57(5) 1155-1168.
5. Shushang Zhu, Duan Li, Shouyang Wang. 2009. Robust Portfolio Selection under Downside Risk Measures. *Quantitative Finance* Vol.9(7) 869-885.
6. Dashan Huang, Shu-Shang Zhu, Frank J.Fabozzi, Masao Fukushima. 2008. Portfolio selection with uncertain exit time: A robust CVaR approach. *Journal of Economic Dynamics & Control* Vol. 32(2) 594-623.
7. Xiaodong Ji, Shushang Zhu, Shouyang Wang, Shuzhong Zhang. 2005. A stochastic linear goal programming approach to multistage portfolio management based on scenario generation via linear programming. *IIE Transactions* Vol.(37) 957-969.
8. Zhu S.S., D. Li ,S. Y. Wang. 2004. Risk control over bankruptcy in dynamic portfolio selection: a generalized mean-variance formulation. *IEEE Transactions on Automatic Control* Vol.49 (3) 447-457.
9. Ruan G. Z., S. Y. Wang, Y.Yamamoto ,S. S. Zhu. 2004. Optimality conditions and geometric properties of a linear multilevel programming problem with dominated objective functions. *Journal of Optimization Theory and Applications* Vol.123(2) 409-429.
10. SHOUYANG WANG, SHUSHANG ZHU. 2002. On Fuzzy Portfolio Selection Problems. *Fuzzy Optimization and Decision Making* 361-377.
11. 朱书尚,李瑞,周迅宇,汪寿阳. 论投资组合与金融优化——对理论研究和实践的分析与反思. *管理科学学报*, 2004, Vol.7(6): 1-12.
12. 阮国桢, 成央金, 朱书尚. 线性规划的对偶基线算法. *计算数学*, 2002, Vol.24(3): 257-264.

科研项目:

- 2011.01—2013.12, 项目负责人, 两类金融优化问题的研究——以消除理论与实践的差距为目标, 国家自然科学基金面上项目
- 2005.01—2007.12, 项目负责人, 多阶段投资组合管理中几个问题的研究, 国家自然科学基金面上申请青年项目