

## 韩立岩简历



**韩立岩**，1955 年出生于北京。

北京航空航天大学经济管理学院经济学科二级岗责任教授（退休返聘）、博士生导师；珠海复旦创新研究院金融科技首席科学家。

理学博士，北京市教学名师，享受国务院政府特殊津贴。1982 年 1 月毕业于北京师范大学数学系，1991 年在北师大获得理学博士学位，师从汪培庄教授，研究方向：模糊信息与知识工程；1995 年在维也纳经济大学完成经济学博士后研究。1982 年至 1999 年在首都经济贸易大学任教，2000 年至今在北航任教。1993 年获北京市高校（青年）学科带头人，2011 年获得北京市教书育人先进个人，2012 年获北京市教学名师。获得 6 项部级优秀成果奖，其中 1991 年获得高校优秀教材国家教委一等奖、2005 年获得国防科技进步三等奖、2009 年获得全国挑战杯优秀指导教师（学生特等奖）、2013 年获得北京市教学成果二等奖。2017 年获得中国数量经济杰出学者。中国数量经济学会常务理事暨学术委员、中国软科学研究会常务理事、中国金融学年会理事、中国金融系统工程专业委员会理事、中航工业集团科技委委员、顾问、新华文轩（A+H 股）、柳工股份（A 股）、航天投资控股有限公司独立董事。主持完成 20 项国家和部级科学基金项目，其中国家自然科学基金重点项目“国家外汇储备的多元化和国际资产配置模型”以优秀验收。发表国际 SSCI/SCI 高水平杂志发表论文 70 余篇、国内权威学术期刊论文 150 余篇。重要期刊有《经济研究》、《管理世界》、《管理科学学报》、《经济学季刊》、《世界经济》、《金融研究》、Energy Economics、Ecological Economics、Journal of Futures Markets、Quantitative Finance、Economics Letters、Annuals of Operation Research、Nonlinear Analysis 等。2007 年编制发布以贸易与投资信息为权重的人民币指数，在国家发改委内外网同时使用。2019 年与中金所研究院联合推出新版人民币指数。主持国家自然科学基金重点项目：汇率市场变化、资本跨境流动与金融风险防范。最近应用相关课题：2019-2020，国防科技基础项目子课题：中国航空工业供应网络区块链集成；2021-2022，建龙集团数字治理与供应链数

字金融研究。

**研究重点：**资产定价、汇率、金融科技、绿色金融

➤ **代表性成果：**

1. 韩立岩、赵尚梅.《宏观经济学 12 讲：中国情景》[M]，北京大学出版社，2022.
2. 韩立岩、汪培庄.《应用模糊数学》（修订版）[M]，首都经济贸易大学出版社，1998.
3. 韩立岩、王允贵等. 人民币外汇衍生品市场：策略与路径[M]，科学出版社，2009.
4. 韩立岩、王晓萌：《中国上市公司并购的市场评价》[M]，中国财政经济出版社，2006-12.
5. 韩立岩，部慧，金融资产风险与定价[M]，机械工业出版社，华章经管，2015-12.
6. 一带一路背景下的能源安全与信息安全[R]，钓鱼台智库论坛. 2017.
7. 韩立岩、吴优、赵庆明等. 新版人民币指数[R]，中国金融期货交易所研究报告，2019.
8. 韩立岩、喻雪莹、顾雪松等. 中美间技术转移的模式演化及对中国创新活动的影响研究[R]，科技部研究报告（中美高层对话专项）. 2016.
9. 韩立岩、王哲兵. 中国实体经济资本配置效率研究[J]，《经济研究》，2005 年第 1 期：77-84.
10. 顾雪松、韩立岩\*、周伊敏. 产业结构差异与对外直接投资的出口效应—东道国视角的理论与实证[J]，经济研究，2016 年第 4 期：102-115.
11. 韩立岩\*、尹力博. 投机还是刚需？国际大宗商品价格影响因素的广义视角分析[J]，经济研究，2012 年第 12 期：83-96.
12. 韩立岩\*，尤苗. 主权财富基金的战略价值---基于风险对冲与国民效用的视角[J]. 经济研究（封面文章），2012，(6)：88-100
13. 韩立岩\*，杜春越. 城市家庭消费金融效应的地区差异研究[J]. 经济研究（封面文章），2011，S1：30-42.
14. 韩立岩\*，杜春越. 收入差距、借贷水平与居民消费的地区及城乡差异[J]. 经济研究，2012，S1.
15. 董锋，韩立岩. 中国股市透明度提高对市场质量影响的实证分析[J]，经济研究，2006，5：87-96.
16. 伍燕然、韩立岩：不完全理性、投资者情绪与封闭式基金之谜，《经济研究》，2007-3：117-129.
17. 尹力博、韩立岩，人民币外汇期权套保价值与策略：基于随机规划的视角[J]，

管理科学学报, 2012 年第 11 期: 31-44.

18. 林忠国, 韩立岩, 李伟. 股价波动非同步性——信息还是噪音?[J]. 管理科学学报, 2012(06): 68-81.
19. 杨华蔚, 韩立岩. 外部风险、异质信念与特质波动率风险溢价[J]. 管理科学学报, 2011(3):71-80.
20. 韩立岩\*, 崔旻抒. 人民币指数美式期货期权定价研究[J]. 管理科学学报, 2010, 13(3): 50-63.
21. 谢飞, 韩立岩\*. 对冲基金与国际资产价格的波动性传递[J]. 管理科学学报, 2010, 13(11): 94-103.
22. 谢飞, 韩立岩\*. 投机还是刚需: 国际商品期货价格的影响因素分析[J]. 管理世界, 2012 (10): 71-82.
23. 尹力博, 韩立岩\*. 大宗商品战略配置——基于国民效用和风险对冲的视角[J], 管理世界, 2014, (7): 39-51.
24. 郭璐, 韩立岩, 李东辉. 交叉上市的信息传递及整合性: 股改前后的变化[J]. 管理世界, 2009, (1): 29-37.
25. 闵丹, 韩立岩. 市场结构, 行业周期与资本结构——基于战略公司财务理论的分析[J]. 管理世界, 2008, (2): 82-89.
26. 韩立岩, 伍燕然. 投资者情绪与 IPOs 之谜——抑价或者溢价?[J]. 管理世界, 2007, (3): 51-61.
27. 牟晖, 韩立岩, 谢朵, 陈之安. 中国资本市场融资顺序新证: 可转债发行公告效应研究[J]. 管理世界, 2006, (4): 19-27.
28. 韩立岩, 牟晖, 王哲兵. 市政债券的风险识别与控制策略[J]. 管理世界, 2005, (3): 58-66.
29. 韩立岩, 熊菲, 蔡红艳. 基于股市行业市盈率的资本配置评价研究[J]. 管理世界, 2003, (1): 43-50.
30. 韩立岩, 蔡红艳. 我国资本配置效率及其与金融市场关系评价研究[J]. 管理世界, 2002, (1): 65-70.
31. 王哲兵, 韩立岩\*. 民主还是集权——创业者治理结构的选择[J]. 经济学(季刊), 2013, 第 12 卷第 2 期: 475—492.
32. 李蕾, 韩立岩(\*), 价值投资还是价值创造?——基于境内外机构投资者比较的经验研究, 经济学(季刊), 2014, (01): 351-372.
33. 韩立岩、孙海峰、李东辉: 投资偏向分析: 基于全球银行股票投资的实证研究[J], 《金融研究》2008-10.
34. 李燕平、韩立岩: 特许权价值、隐性保险与风险承担—中国银行业的经验分析[J], 《金融研究》2008-1.
35. 韩立岩、蔡立新、尹力博. 中国证券市场的绿色激励: 一个四因素模型[J].

《金融研究》，2017,1: 145-161.（封面文章，2017 年度优秀论文）

36. 冯超楠; 韩立岩\*; 任若恩; 短期跨境资本流动因何而来? , 数量经济技术经济研究, 2020,(9): 119-139. CSSCI.
37. William L. Megginson, Miao You, **Liyan HAN**. Determinants of Sovereign Wealth Fund Cross-Border Investments [J]. The Financial Review (Statesboro), 2013, (48): 539-572. Annual Best Paper Award.
38. Yanran Wu, **Liyan Han**, et.al. Investor Sentiment and Asset Pricing[M], VDM Berlin, 2009
39. Xinkuo Xu, **Liyan Han\***, Xiaofeng Lv. Household carbon inequality in urban China, its sources and determinants[J]. Ecological Economics 128 (2016) 77 - 86
40. Han Liyan, Zheng Chengli. Fuzzy options with application to default risk analysis for municipal bonds in China[J]. Nonlinear Analysis, Theory, Methods & Applications, 2005, 63 (5-7): 2353-2365. (SSCI).
41. Libo Yin\*, **Liyan Han**. Options strategies for international portfolios with overall risk management via multi-stage stochastic programming [J]. Annals of Operations Research, 2013, 206: 557-576. (SCI)
42. **Liyan Han**, Xue Jiang, Libo Yin. The predictive performance of the currency futures basis for spot returns[J]. Quantitative Finance, 2019, 19(3): 391-405, SSCI.
43. Ding, D., **Han, L.**, Yin, L. Systemic risk and dynamics of contagion: a duplex inter-bank network [J]. Quantitative Finance, online, 2017, 17(9): 1435-1445, SSCI.
44. **Han, L.**, Li, Z., Yin, L. The effects of investor attention on commodity futures markets [J]. Journal of Futures Markets, 2017,37: 1031-1049, SSCI.
45. **Han, L.**, Lv, Q., Yin, L. Can investor attention predict oil prices? [J]. Energy Economics, 2017, 66: 547-558, SSCI.
46. **Han, L.**, Xu, Y., Yin, L. Does investor attention matter? The attention-return relationships in FX [J]. Economic Modelling, 2018, 68: 644-660, SSCI.
47. **Han Liyan**, Zheng Qingqing, Li Lei, Yin Libo. Do Foreign Institutional Investors Stabilize the Capital Market?[J]. Economics Letters, 2015, 136: 73-75. (SSCI).
48. **Han, Liyan**, Rong Liang, \*Ke Tang. Cross-market Soybean Futures Price Discovery: Does the Dalian Commodity Exchange Affect the Chicago Board of Trade?[J]. Quantitative Finance, 2013, 13(2), (SSCI).
49. Xiaoyun, Wei; **Liyan, Han\***; Targeted reduction in reserve requirement ratio and optimal monetary policy in China, International Review of Economics & Finance, 2020, 69: 209-230. SSCI.
50. Wei, Xiaoyun; Li, Jie; **Han, Liyan\***; Optimal targeted reduction in reserve requirement ratio in China, Economic Modelling, 2020, 85: 1-15. SSCI.
51. Jin, Jiayu; **Han, Liyan**; Wu, Lei; Zeng, Hongchao; The hedging effectiveness of global sectors in emerging and developed stock markets, International Review of

Economics & Finance, 2020, 66: 92-117. SSCI.

52. **Liyan Han**, Yang Xu, Libo Yin. Forecasting the CNY-CNH pricing differential: The role of investor attention [J]. Pacific-Basin Finance Journal, 2018, 49: 232-247, SSCI.