光华管理学院
Guanghua School of Management

商务统计与经济计量系
2017 年

工
作
报
告

2017 年 12 月

光华管理学院
Guanghua School of Management

目 录

一、 师资概况 1

二、 科研成果 1

1、项目成果 1

2、论文发表 2

三、 学术交流 3

1、讲座交流 3

2、出访交流 5

四、 教学工作 6

1、开设课程 6

2、培养学生情况 8

五、 系活动 9

1、系主办会议 9

2、来访交流（不含讲座嘉宾） 10

一、 师资概况

1、 商务统计与经济计量系目前在职教员 9 人，其中正教授 4 人，副教授 3 人，助理教授 2 人，博导 8 人。

2、 商务统计与经济计量系目前聘请了 3 名特聘教授，分别是来自伦敦经济与政治科学学院的姚琦伟教授（千人计划）、沃顿商学院的蔡天文教授、以及澳大利亚莫纳什大学的高集体教授。另外还有聘请了芝加哥商学院的刁锦寰教授作为荣誉教授。

3、 王汉生老师 6 月申报长江学者。

4、 涂云东老师晋升副教授聘任职称。

5、 17 年上半年组织院内面试 2 人次，引进新教员 1 人（18 年入职）。

6、 引进新教员苗旺博士，博士毕业于北京大学数学科学学院概率统计系。17 年 7 月赴哈佛大学进修博士后，将于 18 年 7 月入职。

二、 科研成果

1、项目成果

商务统计与经济计量系 17 年在研国家自然科学基金资助项目 5 项，国家重点研发计划重点专项项目课题 3 项，其中自科基金结题 1 项。另有横向课题入账 1 项。

项目来源	负责人	名称	类别	状态
自然科学基金项目	陈松蹊	大数据驱动的管理决策模型与算法	重点项目	在研
自然科学基金项目	王汉生	高维复杂数据的理论与应用	杰出青年基金	在研
国家重点研发计划	陈松蹊	空气质量统计评估方法	重点专项	在研
国家重点研发计划	王汉生	大气污染数据质量监控	重点专项	在研
国家重点研发计划	虞吉海	污染与宏观经济、人口健康的计量分析	重点专项	在研
自然科学基金项目	李辰旭	金融衍生品定价中的计量经济学分析	面上项目	在研

自然科学基金项目	涂云东	高维非线性模型中的因子分析：理论和应用	面上项目	在研
国家自然科学基金项目	陈松蹊	金融连续时间随机过程的统计推断	面上项目	12 月结题

（注：数据来源于学院科研办公室）

2、论文发表

2017 年，商务统计与经济计量系在学术期刊上发表论文 17 篇，16 篇为国际论文发表，1 篇为国内论文发表，其中光华 A 类论文 6 篇，光华 B 类论文 7 篇。另有即将发表的国际论文 2 篇，均为光华 A 类论文。

[1] Chen, Q., Hu, M., and **Song, X.** (2017). A nonparametric specification test for the volatility functions of diffusion processes. *Econometric Reviews*, 1-20. **B**

[2] Ho, C. Y., Wang, W., and **Yu, J.** (2018). International knowledge spillover through trade: A time-varying spatial panel data approach. *Economics Letters*, *162*, 30-33. **B**

[3] Ke, Y., Li, D., **Yao, Q.** (2017). Nonlinear regression estimation using subset-based kernel principal components, *Statistica Sinica*. **B**

[4] Liu, H., Chiang, J. T. J., Fehr, R., **Xu, M.**, and Wang, S. (2017). How do leaders react when treated unfairly? Leader narcissism and self-interested behavior in response to unfair treatment. *Journal of Applied Psychology*, *102*(11), 1590. **A**

[5] Qu, X., Lee, L. F., and **Yu, J.** (2017), QML estimation of spatial dynamic panel data models with endogenous time varying spatial weights matrices, *Journal of Econometrics*,197(2), 173-201. **A**

[6] **Song, X.,** Taamouti, A. (2017), Measuring Nonlinear Granger Causality in Mean. *Journal of Business & Economic Statistics*, 1-13. **B**

[7] **Tu, Y.** (2017). Efficient Nonparametric Estimation in Simultaneous Equation Models, *Communications in Statistics - Theory and Methods*, 46(7), 3411-3416

[8] **Tu, Y.** (2017). On spurious regressions with partial unit root processes. *Economics Letters*, *150*, 142-145. **B**

[9] **Tu, Y.**， and Yi, Y. (2017). Forecasting Cointegrated Nonstationary Time Series with Time-varying Variance, *Journal of Econometrics*, 196(1), 83-98. **A**

[10] Yang, Y., Wang, F., **Zhang, J.**, Xu, J., and Philip, S. Y. (2017). A topic model for co-occurring normal documents and short texts. *World Wide Web*, 1-27.

[11] Zhang, S., Guo, B., Dong, A., He, J., Xu, Z., and **Chen, S. X.** (2017, September). Cautionary tales on air-quality improvement in Beijing. In *Proc. R. Soc. A* (Vol. 473, No. 2205, p. 20170457). The Royal Society.

[12] Zhou, J., **Tu, Y.**, Chen, Y., and **Wang, H.** (2017). Estimating spatial autocorrelation with sampled network data, *Journal of Business and Economics Statistics*, 35(1), 130-138. **B**

[13] Zhu, X., Pan, R., Li, G., Liu, Y. and **Wang, H.**(2017). Network Vector Autoregression, *The Annals of Statistics*, 45(3), 1096-1123. **A**

[14] Zhou, J., Huang, D., **Wang, H.** (2017). A Dynamic Logistic Regression for Network Link Prediction, *Science China: Mathematics,* 60(1), 165-176.

[15] Zou, T., and **Chen, S. X.** (2017). Enhancing Estimation for Interest Rate Diffusion Models with Bond Prices. *Journal of Business & Economic Statistics*, 1-13. **B**

[16] Zou, T., Lan, W., **Wang, H.**, and Tsai, C. L.(2017). Covariance Regression Analysis, *Journal of the American Statistical Association*, 112, 266-281. **A**

[17] Mao, X., **Chen, S. X.**, and Wong, R. K. (2017). Matrix Completion with Covariate Information. *Journal of the American Statistical Association*, To appear. **A**

[18] Qiu, Y., **Chen, S. X.,** and Nettleton, D. (2017). Detecting Rare and Faint Signals via Thresholding Maximum Likelihood Estimators, *Annals of Statistics,* To appear. **A**

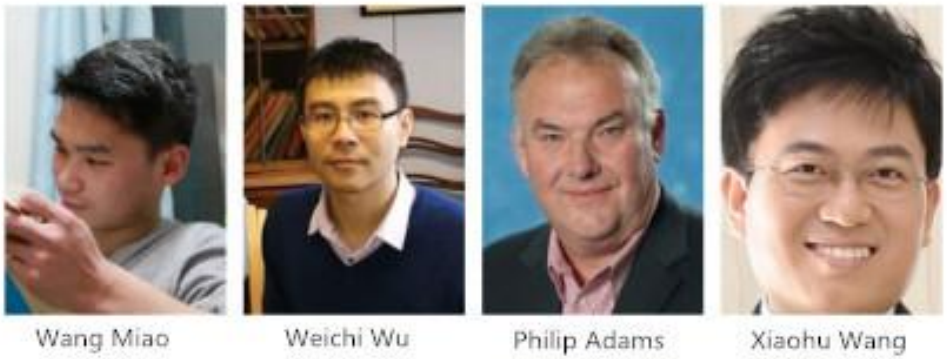
[19] 王健、**张俊妮**，2017，统计模型在中文文本挖掘中的应用，《数理统计与管理》, *36*(4), 609-619. **A**

三、 学术交流

1、讲座交流

商务统计与经济计量系为拓宽教师及学生的视野，了解学科发展的前沿信息，多次邀请国内外知名专家学者来我院讲学，加强学术交流。2017 年共组织了 23 场学术讲座，详情如下表所示：

No.	Date	Speaker	Affiliation	Topic
1	2017/6/13	Will Wei Sun	University of Miami	Provable Sparse Tensor Decomposition for Personalized Recommendation and Dynamic Clustering
2	2017/6/8	Lingjiong Zhu	Florida State University	Approximate Variational Estimation for a Model of Network Formation
3	2017/5/29	Balgobin Nandram	Worcester Polytechnic Institute	Bayesian Predictive Inference for Numerous Sub-Areas Using Logistic Regression
4	2017/5/25	Yong Bao	Purdue University, USA & University of Macau, China	Indirect Inference Estimation of Dynamic Panel Data Models
5	2017/5/18	Tailen Hsing	University of Michigan	Analyzing spatial data locally
6	2017/5/11	Dong Li	Tsinghua University	Inference in Threshold GARCH Models
7	2017/4/26	Dacheng Xiu	The University of Chicago Booth School of Business	Taming the Factor Zoo
8	2017/4/6	Xuewei Yang	Nanjing University	Can Financial Innovation Succeed by Catering to Behavioral Preferences? Evidence from a Callable Options Market
9	2017/3/30	Chunsheng Zhao	Peking University	What have we learned from HaChi (HAZE IN CHINA) project?
10	2017/3/10	Yacine Ait-Sahalia	Princeton University	An Introduction to Expansion Methods for the Transition Density of Continuous-Time Models
11	2017/2/23	Xiaohu Wang	The Chinese University of Hong Kong	New Distribution Theory for the Estimation of Structural Break Point in Mean
12	2017/1/11	Philip D. Adams	Victoria University	一般均衡模型在气候变化政策中的应用-以澳大利亚碳减排方案为例
13	2017/1/10	Weichi Wu	University College London	Gradient-Based Structural Change Detection For Non-Stationary Time Series M-estimation
14	2017/1/5	Wang Miao	Peking University	Identifying Causal Effects With Proxy Variables of an Unmeasured Confounder





2、出访交流

商务统计与经济计量系也多次受邀赴外参加学术交流。

序号	出访日期	姓名	出访国家	出访城市	邀请单位	出访任务
1	2017.03.29-04.08	宋晓军	英国	利物浦	利物浦大学	学术合作，并参加利物浦大学举办的第六届计量经济学研讨会
2	2017.04.23-27	李辰旭	韩国	首尔	会议组委会	国际学术会议
3	2017.05.24-06.14	陈松蹊	美国	埃姆斯	爱荷华州立大学	合作研究
4	2017.06.01-05	宋晓军	香港	香港	香港中文大学	合作研究
5	2017.06.02-06	李辰旭	香港	香港	会议组委会	参加学术会议
6	2017.06.14-18	涂云东	香港	香港	香港科技大学	参加会议
7	2017.06.14-18	徐敏亚	香港	香港	香港科技大学	参加会议
8	2017.06.25-30	宋晓军	日本	札幌	北海道大学	参加国际会议并报告论文
9	2017.07.05-07	李辰旭	新加坡	新加坡	新加坡国立大学	参加学术会议
10	2017.07.06-21	张俊妮	法国，卢森堡，德国	巴黎，卢森堡，汉堡	法国统计局，法国国立统计与信息分析学校，卢森堡社会经济研究所，德国斯夫中心	参加国际会议
11	2017.07.09-19	陈松蹊	日本	东京	日本统计数学所	合作研究
12	2017.07.20-08.05	陈松蹊	意大利	贝加莫	贝尔加莫大学	参加国际会议，合作研究
13	2017.07.20-28	徐敏亚	意大利	贝加莫	贝尔加莫大学	参加国际会议，合作研究
14	2017.08.06-09.11	陈松蹊	美国	埃姆斯	爱荷华州立大学	合作研究

（注：数据来源于学院国际合作部）

四、 教学工作

1、开设课程

1）商务统计与经济计量系 17 年上半年承担课程 18 门，其中：本科课程 6 门，研究生课程 6 门，本科、研究生合上 2 门，MBA 课程 2 门，教学工作量共 43 学分。

序号	类别	课程名称	课类	学分	总学时	上课人数	任课教师
1	本科	概率统计	必修	4	72	130	徐敏亚
2	本科	Introduction to the Probability and Statistics(英文)	必修	4	72	130+5	张俊妮
3	本科	计量经济学	必修	3	54	65+5	虞吉海
4	本科	数据分析与统计软件	选修	2	36	150	涂云东
5	本科&研究生	随机分析与应用	选修	2	36	60	李辰旭
6	本科	应用计量经济学	大类平台	3	54	100	宋晓军
7	本科	数据价值与产业实践	全校公选	2	36	200	王汉生
8	本科&研究生	时间序列分析	学院选修	2	36	50	涂云东
9	研究生	高级计量经济专题	专业必修	3	54	70	涂云东
10	研究生	微观计量理论	选修	3	54	70	虞吉海
11	研究生&本科生	时间序列分析	专业必修	3	54	30	涂云东
12	研究生	大样本理论	选修	2	36	30	陈松蹊
13	研究生	统计学研究专题之一	选修	2	36	30	宋晓军
14	本科&研究生	随机分析与应用	选修	2	36	30	李辰旭
15	研究生	统计学研究专题之二	选修	2	36	30	陈松蹊
16	研究生	贝叶斯数据分析	选修	2	36	30	张俊妮
17	MBA	实用商务数据分析与预测	方选	2	30	50	王汉生
18	MBA	数据价值与产业实践	选修	2	30	70	王汉生

2）商务统计与经济计量系 17 年下半年承担课程 16 门，其中：本科课程 3 门，研究生课程 4 门，本科、研究生合上 2 门，MBA 课程 5 门，MPAcc 课程 1 门，MSEM1 门，教学工作量共 29 学分。

序号	类别	课程名称	课类	学分	总学时	上课人数	任课教师
1	本科	数据分析与统计软件	选修	2	32	150	徐敏亚
2	本科	金融中的数学方法	选修	2	32	160	李辰旭
3	本科	应用计量经济学	大类平台	3	48	100	宋晓军
4	本科&研究生	管理学中的回归方法	选修	2	32	60	李辰旭
5	本科&研究生	高等多元统计分析	选修	2	32	60	陈松蹊
6	研究生	高级计量经济学	院必修	3	48	100	虞吉海
7	研究生	应用统计学	院必修	3	48	100	徐敏亚
8	本科&研究生	Regression Analysis in Management Research	专业必修	2	32	30	李辰旭
9	研究生	数据挖掘与应用	专业必修	3	48	70	张俊妮
10	本科&研究生	高等多元统计分析	选修	2	32	30	陈松蹊
11	研究生	统计学研究专题之三	选修	2	32	30	王明进
12	MBA	数据分析与统计决策	必修	2	30	80	王汉生
13	MBA	数据分析与统计决策	必修	2	30	70	王明进
14	MBA	数据分析与统计决策	必修	2	30	75	王明进
15	MBA	数据分析与统计决策	必修	2	30	80	王明进
16	MBA	Data Analysis and Statistical Decisions	R	2	30	50	Chen Songxi

17	MSEM	数据分析与统计决策	必修	2	30	30	王明进
18	MPAcc	数量分析方法	必修	2	30	43	李辰旭

（注：数据来源于学期初项目办公室发布的课程安排通知）

3）商务统计与经济计量系 17 年为 EMBA 开设“量化决策与变异管理”课程 5 个班；开设“数据思维与价值发现”课程 1 个班 。

4）商务统计与经济计量系 17 年为 ExEd 项目开设 1 门课程，共计 5.83 天。

2、培养学生情况

商务统计与经济计量系 17 年上半年在读硕士生 5 人，在读博士生 18 人，其中，17 年 7 月毕业硕士生 1 人，毕业博士生 6 人。



17 届博士毕业生合影

五、 系活动

1、系主办会议

序号	时间	会议名称	规模
1	4 月 10 日	第四届海峡两岸经济计量和环境统计交流与对话 Cross-Strait Dialogue IV	40 人
2	5 月 14-16 日	第二届大数据时代下的高维统计建模与分析研讨会	260 人
3	6 月 13-14 日	第十三届计量经济学理论与应用国际研讨会（SETA2017）	70+
4	6 月 16 日	管理学部大数据重点项目报告会	15 人
5	6 月 19 日	商务统计与经济计量系十五周年	40 人
6	6 月 22 日	大气污染、气候变化与统计分析研讨会	40 人



注：商务统计与经济计量系 15 周年活动照片

2、来访交流（不含讲座嘉宾）

序号	来访	离开	姓名	学校
1	1月2日	1月17日	高集体	澳大利亚莫纳什大学
2	1月6日	1月8日	Tingting Cheng	Nankai University
3	1月11日	1月13日	蔡天文	Wharton School of the University of Pennsylvania
4	1月13日	1月16日	董朝华	西南财大
5	2月6日	3月12日	John Bryant	Senior Researcher. Statistics New Zealand
6	3月9日	3月15日	Yacine Ait-Sahalia	Princeton University
7	3月14日	3月16日	蔡天文	Wharton School of the University of Pennsylvania
8	3月22日	3月24日	蔡天文	Wharton School of the University of Pennsylvania
9	4月17日	4月19日	李国栋	香港大学
10	4月21日	4月23日	董朝华	西南财大
11	5月6日	5月27日	Tailen Hsing	University of Michigan
12	5月6日	5月8日	刘宝强	
13	5月10日	5月17日	Ed George	Wharton School of the University of Pennsylvania
14	5月10日	5月21日	Dan Nettleton	Iowa State University
15	5月18日	5月20日	程建华	安徽大学
16	6月8日	6月15日	Hsein Kew	Monash University
17	6月20日	6月23日	Xueyan Zhao	Monash University
18	6月21日	6月24日	吕文斌	North Carolina State University
19	6月29日	7月15日	蔡知令	University of California, Davis
20	6月30日	7月9日	邹韬	The Australian National University
21	7月13日	7月14日	蔡天文	Wharton School of the University of Pennsylvania
22	8月5日	9月6日	姚琦伟	London School of Economics and Political Science

---------在此感谢全系老师对系里工作的支持----------