光华管理学院
Guanghua School of Management

商务统计与经济计量系

2021 年度

工作报告

2022 年 3 月 18 日

光华管理学院
Guanghua School of Management

目　录

一、　概述 1

二、　师资概况 1

三、　科研工作 1

1. 项目成果 1
2. 论文发表 2

四、　学术交流 7

1. 讲座交流 7

五、　教学工作 8

1. 开设课程 8
2. 培养学生情况 10

一、概述

截止到2022年2月，商务统计与经济计量系在学术期刊上共发表论文44篇；组织学术交流讲座6场；开设各类课程25门；组织考核面试1场，招生考试2场，论文答辩4场；组织系工作会议3次。2021年毕业博士生3人。

二、师资概况

1. 商务统计与经济计量系目前在职教员8人：正教授5人、副教授3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：沃顿商学院的蔡天文教授，澳大利亚莫纳什大学的高集体教授，英国伦敦经济与政治科学学院的姚琦伟教授。另外还聘请了芝加哥商学院的刁锦寰教授作为荣誉教授。
3. 李辰旭老师于2021年晋升教授。
4. 陈松蹊老师于2021年11月当选中国科学院院士。

（此数据来源于人力资源部）

三、科研工作

1. 项目成果

商务统计与经济计量系2021年获批国家自然科学基金项目1项：

批准年	项目来源	负责人	名称	类别
2021	国家自然科学基金项目	李辰旭	连续时间模型极大似然估计的大样本理论与应用	面上项目

（此数据来源于学科建设与学位管理办公室）

2. 论文发表

2021 年，商务统计与经济计量系在学术期刊上共发表论文 44 篇，其中，国际 A 类刊物 6 篇，国际 B 类刊物 14 篇，国际其他刊物 16 篇；国内 A 类刊物 1 篇，国内 B 类刊物 1 篇，国内其他刊物 6 篇。

✧ 国际 A 类刊物（6 篇）

【1】 **Chen, Song Xi**; Peng, Liuhua. Distributed Statistical Inference for Massive Data[J]. *Annals of Statistics.* 2021,5(49):2851-2869.

【2】 Chang, Jinyuan; **Chen, Song Xi**; Tang, Cheng Yong; Wu, Tong Tong. High-Dimensional Empirical Likelihood Inference[J]. *Biometrika.* 2021,1(108):127-147.

【3】 Ait-Sahalia, Yacine; **Li, Chenxu**; Li, Chen Xu. Implied Stochastic Volatility Models[J]. *Review of Financial Studies.* 2021,1(34):394-450.

【4】 Ait-Sahalia, Yacine; **Li, Chenxu**. Closed-Form Implied Volatility Surfaces for Stochastic Volatility Models with Jumps[J]. *Journal of Econometrics.* 2021,1(222):364-39.

【5】 **Tu, Yundong**; Wang, Ying. Spurious Functional-coefficient Regression Models and Robust Inference with Marginal Integration[J]. *Journal of Econometrics.* Forthcoming.

【6】 **Tu, Yundong**; Liang, Han-Ying; Wang, Qiying. Nonparametric Inference in Quantile Cointegrations with Stationary Covariates[J]. *Journal of Econometrics.* Forthcoming

✧ 国际 B 类刊物（14 篇）

【1】 Mao Xiaojun; Raymond K. W. Wong; **Chen**, **Song Xi**. Matrix Completion Under Low-Rank Missing Mechanism[J]. *Statistica Sinica*.2021,31(4):2005-2030.

【2】 Cai, Ning; **Li, Chenxu**; Shi, Chao. Pricing Discretely Monitored Barrier Options: When Malliavin Calculus Expansions Meet Hilbert Transforms[J]. *Journal of Economic Dynamics & Control.* 2021,127.

【3】 **Song, Xiaojun**; Taamouti, Abderrahim. A Nonparametric Measure of Heteroskedasticity[J]. *Journal of Statistical Planning and Inference*. 2021,212:45-68.

【4】 **Song, Xiaojun**; Taamouti, Abderrahim. Measuring Granger Causality in Quantiles[J]. *Journal of Business & Economic Statistics*.2021,4(39):937-952.

【5】 Lin, Yingqian; **Tu, Yundong**. On Transformed Linear Cointegration Models[J]. *Economics Letters*.2021,198.

【6】 Pan, Rui; Ren, Tunan; Guo, Baishan; Li, Feng; Li, Guodong; **Wang, Hansheng**. A Note on Distributed Quantile Regression by Pilot Sampling and One-Step Updating[J]. *Journal of Business & Economic Statistics*. 2021,9.

【7】 Zhou, Jing; Liu, Jin; Wang, Feifei; **Wang, Hansheng**. Autoregressive Model with Spatial Dependence and Missing Data[J]. *Journal of Business & Economic Statistics.* Early Access.

【8】 Wang, Feifei; Zhu, Yingqiu; Huang, Danyang; Qi, Haobo; **Wang, Hansheng**. Distributed One-Step Upgraded Estimation for Non-Uniformly and Non-Randomly Distributed Data[J]. *Computational Statistics & Data Analysis.*2021,162.

【9】 Zhu, Xuening; Pan, Rui; Wu, Shuyuan; **Wang, Hansheng**. Feature Screening for Massive Data Analysis by Subsampling[J]. *Journal of Business & Economic Statistics.* Early Access.

【10】 Huang, Danyang; Zhu, Xuening; Li, Runze; **Wang, Hansheng**. Feature Screening for Network Autoregression Model[J]. *Statistica Sinica*. 2021,3(31):1239-1259.

【11】 Zhu, Xuening; Li, Feng; **Wang, Hansheng**. Least-Square Approximation for A Distributed System[J]. *Journal of Computational and Graphical Statistics*. Early Access.

【12】 Wang, Feifei; Liu, Jingyuan; **Wang, Hansheng**. Sequential Text-Term Selection in Vector Space Models[J]. *Journal Of Business & Economic Statistics*. 2021,1(39):82-97.

【13】 Liu, Haiyang; Dust, Scott B.; **Xu, Minya**; Ji, Yueting. Leader-Follower Risk Orientation Incongruence, Intellectual Stimulation, and Creativity: A Configurational Approach[J]. *Personnel Psychology*. 2021,1(74):143-173.

【14】 Jin, Fei; Lee, Lung-fei; **Yu, Jihai**. Sequential And Efficient Gmm Estimation of Dynamic Short Panel Data Models[J]. *Econometric Reviews*. 2021,10(40):1007-1037.

✧ 其他英文发表（16 篇）

【1】 Zhu, Yuru; Liang, Yinshuang; **Chen, Song Xi**. Assessing Local Emission for Air Pollution Via Data Experiments[J]. *Atmospheric Environment*. 2021,252.

【2】 Yan, Han; Zhu, Yuru; Gu, Jia; Huang, Yaxuan; Sun, Haoxuan; Zhang, Xinyu; Wang, Yuqing; Qiu, Yumou; **Chen, Song Xi**. Better Strategies for Containing Covid-19 Pandemic: A Study of 25 Countries Via a Vsiadr Model[J]. *Proceedings of the Royal Society A-Mathematical Physical and Engineering Sciences*. 2021,2248(477).

【3】 Zhang Huiming; **Chen, Songxi**. Concentration Inequalities for Statistical Inference[J]. *Communications in Mathematical Research*. 2021,1(37):1-85.

【4】 **Chen, Song Xi**; Zheng, Xianyu. Discussion on the Timing and Effectiveness of Implementing Mild Interventions of Covid-19 In Large Industrial Regions via a Synthetic Control Method by Tian Et Al.[J]. *Statistics and Its Interface.* 2021,1(14):23-24.

【5】 Zheng, Xiangyu; Guo, Bin; He, Jing; **Chen, Song Xi**. Effects of Corona Virus Disease-19 Control Measures on Air Quality in North China[J]. *Environmetrics*. 2021,2(32).

【6】 Huang, Yaxuan; Guo, Bin; Sun, Haoxuan; Liu, Huijie; **Chen, Song Xi.** Relative Importance of Meteorological Variables on Air Quality and Role of Boundary Layer Height[J]. *Atmospheric Environment*. 2021,267.

【7】 Zhang, S., **Chen, Song Xi**; Lu, L. Inference for Variance Risk Premium[J]. *China Finance Review International*. 2021, 11:26-52.

【8】 Li, S-M, Liu, R., Wang, S.; **Chen, Song Xi**. Radiative E ects of Particular Matters on Ozone Pollution in Six North China Cities, *Journal of Geophysical Research*, Forthcoming.

【9】 Xu, Minya, Wang, Yaqiong; **Tu, Yundong**. Uncovering the Invisible Effect of PM2.5 on Stock Returns[J]. *Finance Research Letters.* 2021,39:1-10.

【10】 Zhu, Yingqiu; Huang, Danyang; Gao, Yuan; Wu, Rui; Chen, Yu; Zhang, Bo; **Wang, Hansheng**. Automatic, Dynamic, and Nearly Optimal Learning Rate Specification via Local Quadratic Approximation[J]. *Neural Networks*.2021, (141):11-29.

【11】 Zhu, Xuening; Pan, Rui; Zhang, Yuxuan; Chen, Yu; Mi, Wenquan; **Wang, Hansheng**. Information Diffusion with Network Structures[J]. *Statistics and Its Interface*. 2021,2(14):115-129.

【12】 Zhou, Jing; Qi, Haobo; Chen, Yu; **Wang, Hansheng**. Progressive Principle Component Analysis for Compressing Deep Convolutional Neural Networks[J]. *Neurocomputing*. 2021, (440):197-206.

【13】 Yao, Lei; **Xu, Minya**; Pellegrini, Ekin K. The Boss's Long Arm: The Differential Impact of Authoritarian and Benevolent Leadership on Spousal Family Satisfaction[J]. *Frontiers in Psychology*. 2021,12.

【14】 **Xu, Minya**; Wang, Yaqiong; **Tu, Yundong**. Uncovering the Invisible Effect of Air Pollution on Stock Returns: A Moderation and Mediation Analysis[J]. *Finance Research Letters*. 2021,39.

【15】 **Xu, Minya**; Wan, Yating; Huang, Hui; **Chen, Songxi**. A Spatio-temporal Model for the Analysis and Prediction of Fine Particulate Matter Concentration in Beijing. *Environmetrics*. 2021, 32(1):26-48.

【16】 Chang, Hsuan-Yu; Wang, Wei; **Yu, Jihai**. Revisiting the Environmental Kuznets Curve in China: A Spatial Dynamic Panel Data Approach[J]. *Energy Economics*. 2021,104.

✧ 国内 A 类刊物（1 篇）

【1】 **陈松蹊**，毛晓军，王聪. 大数据情境下的数据完备化：挑战与对策[J]. 管理世界，接受待发表。

✧ 国内 B 类刊物（1 篇）

【1】 顾嘉;**陈松蹊**;董倩;邱宇谋. 基于 vseidrm 模型的人口迁移以及离汉交通管控对新冠肺炎疫情发展的影响分析[J]. 统计研究，2021，09(38)：114-127。

✧ 其他发表（6 篇）

【1】 王振中;**陈松蹊;涂云东**.中国居民消费价格指数的动态结构研究及中美量化比较[J]. 数理统计与管理，2021，12（01）：18。

【2】 吴煌坚;林伟;孔磊;唐晓;王威;王自发;**陈松蹊**. 一种基于集合最优插值的排放源快速反演方法[J]. 气候与环境研究，2021，02（26）：191-201。

【3】 黄丹阳;朱映秋;南金伶;**王汉生**. 基于交易流水的信用卡套现交易及商户识别[J]. 数理统计与管理，2021,12（03）：18。

【4】 **徐敏亚**;马力;王为久. 数字化时代销售人员自我领导行为对离职的影响[J]. 外国经济与管理，2021，11（43）：26-40。

【5】 **徐敏亚**;陈丽萍. 牛顿式管理与量子管理[J]. 企业管理，2021，1（473）：122-123。

【6】 **徐敏亚**;王雅琼，王菲菲. 隐含动态地理统计校准模型--以 PM2.5 污染分析为例[J]. 数理统计与管理，2021，2：191-204。

（此数据来源于学科建设与学位管理办公室）

四、 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座，加强学术交流。2021 年共组织了 6 场学术讲座。详情如下表所示：

No.	Date	Speaker	Affiliation	Topic
1	2021/4/29	Yongmiao Hong	University of Chinese Academy of Sciences	Estimation of High-dimensional Multivariate GARCH Models: A New Regularization Approach
2	2021/5/13	Wei Lin	The University of International Business and Economics	Seasonal Adjustment of Time Series Observed at Mixed Frequencies Using Singular Value Decomposition with Wavelet Thresholding
4	2021/5/27	Yuying Sun	Academy of Mathematics and Systems Science	Time-varying Model Averaging via Adaptive LASSO
3	2021/7/19	Yuhong Yang	University of Minnesota	Goodness of Fit Assessment for Binary Classification Learning
5	2021/9/23	Yanbo Liu	Shandong University	Robust Inference for Time-varying Predictability: A Sieve-IVX Approach
6	2021/10/14	Xia Wang	Renmin University of China	Specification Tests for Time-Varying Coefficient Models

五、 教学工作

1. 开设课程

商务统计与经济计量系 21 年共承担课程 25 门。其中，本科课程 11 门，研究生课程 9 门，BA 课程 2 门，专硕课程 1 门，MBA 课程 8 门。

21 年春季学期：

序号	类别	课程名称	课类	学分	周学时	起止周	任课教师
1	本科	概率统计	必修	4	4	1-15	徐敏亚
2	本科	概率统计	必修	4	4	1-15	宋晓军
3	本科	计量经济学	必修	3	3	1-15	虞吉海
4	本科	金融中的数学方法	选修	2	3	1-12	李辰旭
5	本科&研究生	随机分析与应用	选修	2	3	1-12	李辰旭
6	本科&研究生	时间序列分析	选修	3	3	1-15	涂云东
7	本科&研究生	大样本统计理论	选修	3	3	1-15	陈松蹊 宋晓军
8	研究生	高级计量经济专题	必修	3	3	1-15	涂云东
9	研究生	微观计量理论	选修	3	3	1-15	虞吉海
10	本科&研究生	时间序列分析	必修	3	3	1-15	涂云东
11	本科&研究生	大样本统计理论	必修	3	3	1-15	陈松蹊 宋晓军
12	本科&研究生	随机分析与应用	选修	2	3	1-12	李辰旭

13	BA	深度学习与人工智能	专业必修	2	4	0-9	王汉生
14	BA	整合实践	专业必修	2	3	1-12	王汉生
15	MBA	深度学习入门与图像数据分析	选修	2	3.8	0-9	王汉生
16	MBA	实用商务数据分析与预测	选修	2	3.8	0-9	王汉生
17	MBA	量化投资与高频交易	选修	2	3.8	1-8	杨云红 王明进
18	MBA	行业课：互联网与数据化转型	选修	2	30	10	王汉生 王聪

（此数据来源于本研项目、MBA 项目办公室）

21 年秋季学期：

序号	类别	课程名称	课类	学分	周学时	起止周	任课教师
1	本科	因果推断与商业应用	必修	2	3	1-12	虞吉海
2	研究生	高级计量经济学 （英文）	院必修	3	3	1-16	虞吉海
3	专硕	回归分析与数据思维	专业必修	2	3.5	0-8	王汉生
4	MBA	数据分析与统计决策	必修	2	3.8	2-10	徐敏亚
5	MBA	数据分析与统计决策	必修	2	3.8	2-10	王明进
6	MBA	数据分析与统计决策	必修	2	3.8	2-10	王明进
7	MBA	数据分析与统计决策	必修	2	3.8	4-10	王明进

（此数据来源于本研项目、MBA 项目办公室）

2. 培养学生情况

商务统计与经济计量系目前在读博士生 15 人。2021 年毕业博士生 3 人。

.....感谢各位老师对系里工作的支持和帮助.....