光华管理学院
Guanghua School of Management

商务统计与经济计量系
2018 年

工
作
报
告

2018 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 5

1、讲座交流 5

2、出访交流 7

四、 教学工作 9

1、开设课程 9

2、培养学生情况 11

五、 系活动 11

1、系主办会议 11

2、来访交流 12

一、 师资概况

1、 商务统计与经济计量系目前全职教员 10 人，其中教授 4 人，副教授 4 人，助理教授 2 人；博导 10 人；面试新教员 1 人，正在办理招聘手续。

2、 商务统计与经济计量系目前聘请了 2 名特聘教授，分别是来自沃顿商学院的蔡天文教授和澳大利亚莫纳什大学的高集体教授。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、 新教员苗旺博士已于 18 年 7 月入职，苗旺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。

4、 陈松蹊老师当选中国统计教育学会第七届常务理事。

5、 陈松蹊老师加入中国工业统计学研究会健康医疗大数据学会。

6、 陈松蹊教授当选美国科学促进会会士（AAAS Fellow）。

7、 李辰旭老师获由国际工业与系统工程学会（The Institute of Industrial and Systems Engineers）颁发的 IIE Transactions 运筹学最佳论文奖“2018 Operations Engineering and Analytics Best Paper Award”。

二、 科研成果

1、项目成果

商务统计与经济计量系 18 年在研国家自然科学基金资助项目 4 项，国家重点研发计划重点专项项目课题 3 项。另有基金协作项目 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
基金协作项目	王汉生	多源异构数据的融合、特征提取与分析方法	基金协作项目	在研

（注：数据来源于学院科研办公室）

2、论文发表

2018 年，商务统计与经济计量系在学术期刊上发表论文 27 篇，22 篇为国际论文发表，5 篇为国内论文发表；其中光华 A 类论文 5 篇，光华 B 类论文 10 篇。另有出版著作 2 篇。

English Article：

[1] Chen, L., Guo, B., Huang, J., He, J., Wang, H., Shuyi Zhang, and **S.X. Chen**., (2018) Assessing air-quality in Beijing-Tianjing-Hebei region: the method and mixed tales of PM2.5 and O3. *Atmospheric Environment*, 193, 290-301.

[2] J. He and **S. X. Chen**, (2018) High-Dimensional Two-Sample Covariance Matrix Testing via Super-diagonals, *Statistica Sinica*, 28, 2671- 2696. B

[3] Mao, X., **Chen, SX** and Wong, R., (2018) Matrix Completion with Covariate Information, *Journal of the American Statistical Association*. A

[4] Qiu, Y., **Chen, S.X**. and Nettleton, D., (2018) Detecting Rare and Faint Signals via Thresholding Maximum Likelihood Estimators, *Annals of Statistics*, 46, 895-923. A

[5] Lan, W., Fang, Z., **Wang, H**., and Tsai, C. L., (2018) Covariance matrix estimation via network structure, *Journal of Business and Economics Statistics*, 36, 359-369. B

[6] Xu, K., Sun, J., Liu, J., and **Wang, H**., (2018) An empirical investigation of taxi driver response behavior to ride-hailing requests: A spatio-temporal perspective, *Plos One*, 13.

[7] Pan, R., Guan, R., Zhu, X., and **Wang, H**., (2018) A latent moving average model for network regression, *Statistics and Its Interface*, 11, 641-648.

[8] Huang, D., Guan, G., Zhou, J., and **Wang, H**., (2018) Network-based naive Bayes model for social network, *Science China Mathematics*, 61, 627-640.

[9]Huang, M., Wang, S., **Wang, H.**, and Jin, T. Maximum smoothed likelihood estimation for a class of semiparametric Pareto mixture densities, *Statistics and Its Interface*, 11(1), 31-40.

[10]Cai, W., Guan, G., Pan, R. *, Zhu, X., and **Wang, H.**, Network Linear Discriminant Analysis, *Computational Statistics and Data Analysis*, 117, 32-44. B

[11]Lan, W., Ma, Y., Zhao, J., **Wang, H.** Tsai, C.L. Sequential model averaging for high dimensional linear regression models, *Statistica Sinica*, 28, 449-469. B

[12] Huang, D., Chang, X., and **Wang, H.**, Spatial Autoregression with Repeated Measurements for Social Networks, *Communications in Statistics -Theory and Methods*, 47, 3715-3727.

[13] Zhou, J., Huang,D., **Wang, H.** A note on estimating network dependence in a discrete choice model, *Statistics and its Interface*, 11, 433-439.

[14] Huang, D., Zhou, J., and **Wang, H.** RFMS method for credit scoring based on bank card transaction data, *Statistica Sinica*, 28, 2903-2919. B

[15] Yang Yang, Wang Feifei, **Zhang Junni**, Xu Jin, Yu Philip S., A topic model for co-occurring normal documents and short texts, *WORLD WIDE WEB-INTERNET AND WEB INFORMATION SYSTEMS*, 21, 487-513.

[16] Delgado Miguel A., **Song Xiaojun**, Nonparametric Tests for Conditional Symmetry, *Journal of Econometrics*, 2, 447-471. A

[17] **Song Xiaojun**, Taamouti Abderrahim, Measuring Nonlinear Granger Causality in Mean, *JOURNAL OF BUSINESS & ECONOMIC STATISTICS*, 36, 321-333. B

[18]C. Ho, W. Wang and **J. Yu**, (2018) International Knowledge Spillover through Trade: A Time-Varying Spatial Panel Data Approach. *Economics Letters*, 162,

30-33.B

[19]Zhang, X. and **J. Yu**, (2018). Spatial Weights Matrix Selection and Model Averaging for Spatial Autoregressive Models. *Journal of Econometrics*, 203, 1-18. A

[20]**Miao W.**, Geng Z., and Tchetgen Tchetgen E.. (2018) Identifying causal effects with proxy variables of an unmeasured confounder, *Biometrika*, 4, 987-993. A

[21]**Miao W.** and Tchetgen Tchetgen E., (2018) Identification and inference with nonignorable missing covariate data. *Statistica Sinica*, 28, 2049-2067. B

[22]Sun B., Liu L., **Miao W.**, Wirth K., Robins J. M., and Tchetgen Tchetgen E., (2018) Semiparametric estimation with data missing not at random using an instrumental variable. *Statistica Sinica*, 28, 1965-1983. B

中文论文：

[1] **王汉生**，朴素的数据价值观，新经济导刊，第 62 页-第 66 页。

[2]李晨煦，**李辰旭**，随机杠杆效应对隐含波动率曲面期限结构的影响分析，金融学季刊，第 12 卷第 1 期，第 151 页-第 177.页 B

[3] 吴涵卿，**徐敏亚**，刘古权, 数字化协同催升企业绩效，董事会，第 8 期，第 80 页-81 页。

[4]董晶，魏娜，**张俊妮**，基于社交网络的组织非正式沟通实证研究，现代管理科学，第四期，第 67 页-69 页。

[5]**苗旺**，刘春晨，耿直，因果推断的统计方法，中国科学：数学，第 48 卷，第 1 页-33 页。

出版著作：

[1]John Bryant, **Junni L. Zhang**, Bayesian Demographic Estimation and Forecasting, *CRC Press, Taylor & Francis Group*.

[2]张俊妮，数据挖掘与应用（第二版）：以 SAS 和 R 为工具|光华思想力书系•教材领航，北京大学出版社。

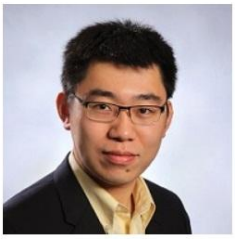
三、 学术交流

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。2018 年共组织了 25 场学术讲座，2 场短期课程活动，详情如下表所示：

No.	Date	Speaker	Affiliation	Topic
1	2018/3/1	Young Min Kim	Kyungpook National University	Nonparametric Spectral Density Estimation under Long-Range Dependence
2	2018/3/22	Xiangyu Cui	Shanghai University of Finance and Economics	Forecasting security's volatility using low-frequency and high-frequency historical data and option-implied information
3	2018/3/29	Alessandro Fasso	University of Bergamo, Italy	Case studies on functional control charts and atmospheric profiles uncertainty
4	2018/4/19	Yuhong Yang	School of Statistics, University of Minnesota	Treatment Allocations Based on Multi-Armed Bandit Strategies
5	2018/5/10	金焰	纯信资产管理（深圳）有限公司董事长	Quantitative Investment in China
6	2018/5/17	Xiaohu Wang	Chinese University of Hong Kong	Estimation for Persistence Matrix in Multivariate Diffusion Processes
7	2018/5/21	Alicia Carriquiry	爱荷华州立大学院士	Learning algorithms to evaluate forensic evidence
8	2018/5/25	Jun Yu	Singapore Management University	Bubble Testing under Deterministic Trends
9	2018/6/11	Dachuan Chen	University of Illinois at Chicago	The Five Trolls under the Bridge: Principal Component Analysis with Asynchronous and Noisy High Frequency Data
10	2018/6/25	Jun Yan	University of Connecticut	Combined Score Equations for Spatial Extremes Modeling with Application to Detection and Attribution of Climate Change
11	2018/6/4 2018/6/8	Aad van der Vaart	University of Leiden	Bayesian Statistics for High-Dimensional and Nonparametric Models
12	2018/6/26 2018/7/1	Jiashun Jin、Cheng	Carnegie Mellon University、	Higher Criticism for Large Scale Inference, especially for Rare and Weak effects

		Yong Tang、Yuan Yao、Zheng Tracy Ke	Temple University Hong Kong 、University of Science and Technology、University of Chicago	Parsimonious statistical modeling approaches for longitudinal studies Differential Inclusion Method in high dimensional statistics and Deep Learning toward deeper understanding New Tools for Analyzing Complicated and High-dimensional Data
13	2018/9/20	Xi Wang	Shanghai Lixin University of Accounting and Finance	Nonparametric Estimation of Generalized Transformation Panel Data Models with Fixed Effects
14	2018/10/15	陈良富	中国科学院	大气污染卫星监测技术的现状与发展态势
15	2018/10/18	chih-ling Tsai	University of California Davis	Writing Data-Driven Business Reports
16	2018/11/1	Le Bao(暴乐)	Penn State University	Leaving No One Behind: Size Estimation of People at High Risk for HIV Infections
17	2018/11/27	Xiaojun Mao	Fudan University	Matrix Completion under Low-Rank Missing Mechanism
18	2018/12/6	SHUFE 曾旭东	Shanghai University of Finance and Economics	Circuit Breakers and Contagion
19	2018/12/12	严加安	中国科学院	我心目中的科学与艺术
20	2018/12/13	Peng Ding (丁鹏)	UC Berkeley	Randomization inference for peer effects, with application to the roommate assignment in Peking University
21	2018/12/14	Weichen Wang	North Carolina State University	Robust Large Covariance Estimation for Heavy-tailed Factor Models
22	2018/12/19	Rui Song	North Carolina State University	On statistical learning for personalized wealth management
23	2018/12/20	李勇	人民大学	Integrated Deviance Information Criterion for Latent Variable Models
24	2018/12/27	Renyu (Philip) Zhang	New York University Shanghai	Recommender Systems on Platforms (Joint work with Xuan Wang and Dennis J. Zhang)
25	2018/12/27	Xinran Li	University of Pennsylvania	RERANDOMIZATION IN 2^K FACTORIAL EXPERIMENTS














2、出访交流

商务统计与经济计量系老师们也多次受邀赴外参加学术交流。

NO.	出访日期	姓名	出访国家	出访城市	邀请单位	出访任务
1	2018.01.16-02.11.	张俊妮	新西兰	基督城	新西兰统计局	主题演讲，合作研究
2	2018.01.18-31	涂云东	澳大利亚	墨尔本	莫纳什大学	合作研究《带非平稳波动率的半参数预测模型》
3	2018.02.07-16	陈松蹊	新加坡	新加坡	Insitute of Mathematical Science	参加国际会议
4	2018.02.07-10	李辰旭	香港	香港	香港科技大学	学术交流
5	2018.03.04-10	李辰旭	美国	普林斯顿	普林斯顿大学	深化关于研究生培养和相关合作学术科研的国际交流
6	2018.03.21-26	涂云东	日本	东京	the Institute of Statistical Mathematics	学术会议和研究

7	2018.03.21-26	陈松蹊	日本	东京	the Institute of Statistical Mathematics	学术会议和研究
8	2018.04.21-05.04	陈松蹊	美国	Ames	Iowa 州立大学	合作研究
9	2018.05.10-13	陈松蹊	台湾	台北	中央研究院经济研究所	学术交流
10	2018.05.10-13	虞吉海	台湾	台北	中央研究院经济研究所	学术交流
11	2018.05.10-13	涂云东	台湾	台北	中央研究院经济研究所	学术交流
12	2018.05.10-13	宋晓军	台湾	台北	中央研究院经济研究所	学术交流
13	2018.06.23-07.01	张俊妮	英国	爱丁堡	International Centre for Mathematical Sciences	参加国际贝叶斯分析学会 2018 年度会议
14	2018.06.24-29	徐敏亚	美国	Minneapolis	Academy of International Business	参加 AIB 会议并报告论文
15	2018.07.23-08.02	虞吉海	加拿大	埃德蒙顿	阿尔伯塔大学	合作研究
16	2018.08.09-17	徐敏亚	美国	芝加哥	美国管理学学会 Academy of Management	参加会议
17	2018.08.12-09.16.	陈松蹊	美国	Ames Iowa, 芝加哥	Iowa State University	合作研究
18	2018.08.26-09.02	虞吉海	德国	科隆	71st European Meeting of the Econometric Society	参加学术会议
19	2018.11.02-05	陈松蹊	韩国	首尔	汉城国立大学	参加韩国统计学年会
20	2018.11.18-12.12	陈松蹊	美国	Ames	Iowa State University	合作研究，有关大气污染
21	2018.11.22-12.09	涂云东	澳大利亚，新西兰	墨尔本，奥克兰，悉尼	莫纳什大学，悉尼大学，奥克兰大学	学术访问和合作，学术会议

（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 18 年上半年承担课程 20 门。其中，本科课程 6 门，研究生课程 2 门，本科、研究生合上 8 门，MBA 课程 4 门，教学工作量共 50 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	数据思维：从数据分析到商业价值	公选	2	32	100	王汉生
2	本科&研究生	大样本理论	选修	2	36	40	陈松蹊、宋晓军
3	本科&研究生	大样本理论	选修	2	36	30	陈松蹊、宋晓军
4	本科	计量经济学	必修	3	48	70	虞吉海 2、宋晓军 1
5	研究生	微观计量理论	选修	3	48	70	虞吉海 2、宋晓军 1
6	本科&金融硕士	金融中的数学方法	选修	2	36	50	李辰旭
7	本科&研究生	随机分析与应用	选修	2	36	60	李辰旭
8	本科&研究生	随机分析与应用	选修	2	36	30	李辰旭
9	本科&金融硕士	金融中的数学方法	选修	2	36	50	李辰旭
10	本科	数据分析与统计软件	选修	2	32	80	涂云东
11	本科&研究生	时间序列分析	选修	3	48	40	涂云东
12	研究生	高级计量经济专题	专业必修	3	48	70	涂云东
13	本科&研究生	时间序列分析	专业必修	3	48	30	涂云东
14	本科	概率统计	必修	4	64	150	徐敏亚
15	本科	Introduction to the Probability and Statistics(英文)	必修	4	64	140+10	张俊妮
16	本科	应用计量经济学	大类	3	48	100	宋晓军

			平台				
17	MBA	实用商务数据分析与预测	选修	2	30	50	王汉生
18	MBA	行业课：互联网+大数据	选修	2	30	80	邱凌云 王汉生
19	MBA	量化投资与高频交易	选修	2	30	70	杨云红 王明进
20	MBA	数据挖掘与行业应用	选修	2	30	50	张俊妮

2）商务统计与经济计量系 18 年下半年承担课程 19 门。其中，本科课程 3 门，研究生课程 4 门，本科、研究生合上 6 门，MBA 课程 5 门，MSEM 课程 1 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	数据分析与统计软件	选修	2	32	150	徐敏亚
2	本科&金融硕士	金融中的数学方法	选修	2	36	80	李辰旭
3	本科&研究生	管理学中的回归方法	选修	2	36	60	李辰旭
4	本科&研究生	高等多元统计分析	选修	2	36	40	陈松蹊
5	本科	应用计量经济学	大类平台	3	48	70	宋晓军
6	本科	统计文化和实践	选修	3	48	70	苗旺
7	研究生	高级计量经济学	院必修	3	48	100	虞吉海
8	研究生	应用统计学	院必修	3	48	90	徐敏亚
9	本科&研究生	Regression Analysis in Management Research	专业必修	2	36	30	李辰旭
10	研究生	数据挖掘与应用	专业必修	3	48	70	张俊妮
11	本科&研究生	高等多元统计分析	选修	2	36	30	陈松蹊

12	研究生	统计学研究专题之三	选修	2	36	30	王明进
13	本科&金融硕士	金融中的数学方法	选修	2	36	20	李辰旭
14	MBA	数据统计与决策分析	必修	2	30	90	徐敏亚
15	MBA	数据统计与决策分析	必修	2	30	50	王明进
16	MBA	数据统计与决策分析	必修	2	30	50	王明进
17	MBA	数据统计与决策分析	必修	2	30	50	王明进
18	MBA	Data Analysis and Statistical Decisions	必修	2	30	80	陈松蹊
19	MSEM	数据分析与统计决策	必修	2	30	30	王明进

（注：数据来源于学期初项目办公室发布的课程安排通知）

2、培养学生情况

商务统计与经济计量系 18 年在读硕士生 9 人，在读博士生 11 人，其中，18 年 7 月毕业硕士生 1 人，毕业博士生 2 人。

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	“大气污染成因与控制技术研究”重点专项 “空气质量统计诊断模型”项目工作推进会	30 人
2	7 月 2 日	北京大学-统计局数据开发中心会议	11 人



注：北京大学-统计局数据开发中心会议照片

2、来访交流

序号	来访	离开	姓名	学校
1	12 月 25 日	1 月 8 日	董朝华	西南财经大学
2	1 月 6 日	1 月 7 日	姚琦伟	London School of Economics and Political Science
3	1 月 9 日	1 月 12 日	Hengfang Wang	Iowa State University of Science and Technology
4	1 月 12 日	1 月 18 日	姚琦伟	London School of Economics and Political Science
5	2 月 1 日	2 月 8 日	易艳萍	上海财经大学
6	2 月 5 日	2 月 8 日	任宇	厦门大学
7	3 月 13 日	3 月 31 日	Alessandro Fassò	意大利贝加莫大学
8	3 月 12 日	3 月 21 日	Jiashun Jin	Carnegie Mellon University
9	3 月 13 日	3 月 25 日	Lung-fei Lee	美国俄亥俄州立大学
10	4 月 15 日	4 月 17 日	李劭珉	山东大学博士生
11	4 月 24 日	5 月 18 日	姚琦伟	London School of Economics and Political Science

12	5月10日	5月15日	常晋源	西南财经大学
13	5月10日	5月15日	张龙茂	浙江大学
14	5月20日	5月24日	Alicia Laura Carriquiry	爱荷华州立大学院士
15	5月20日	5月26日	Qiu Yumou 邱宇谋	University of Nebraska - Lincoln
16	5月27日	6月2日	王莹	奥克兰大学
17	5月29日	5月31日	蔡天文	Wharton School of the University of Pennsylvania
18	6月2日	6月20日	朱国忠	加拿大阿尔伯特大学
19	6月3日	6月10日	Aad van der Vaart	荷兰皇家艺术与科学院院士
20	6月5日	6月6日	Qiu Yumou 邱宇谋	University of Nebraska - Lincoln
21	6月17日	7月1日	马舒洁	美国加州大学
22	6月17日	7月4日	高集体	澳大利亚莫纳什大学
23	6月22日	6月24日	董朝华	西南财大
24	6月23日	6月25日	彭彬	university of bath
25	6月24日	6月26日	王莹	奥克兰大学
26	6月19日	6月20日	Jiashun Jin	Carnegie Mellon University
27	6月29日	7月1日	Jiashun Jin	Carnegie Mellon University
28	6月26日	7月2日	汤琤咏	Temple University Hong Kong
29	6月29日	7月1日	柯峥	University of Chicago
30	6月29日	7月2日	Yuan Yao	University of Science and Technology

31	7 月 6 日	7 月 13 日	闫军	University of Connecticut
32	7 月 11 日	7 月 28 日	毛晓军	复旦大学
33	7 月 16 日	7 月 19 日	蔡天文	澳大利亚莫纳什大学
34	7 月 24 日	8 月 5 日	姚琦伟	英国伦敦经济
35	8 月 1 日	8 月 18 日	常晋源	西南财经大学
36	8 月 4 日	8 月 7 日	何旭明	University of Michigan
37	8 月 29 日	9 月 3 日	庄额嘉	武汉大学
38	9 月 2 日	9 月 5 日	朱雪宁	复旦大学
39	9 月 19 日	9 月 21 日	王曦	Shanghai Lixin University of Accounting and Finance
40	10 月 16 日	10 月 30 日	蔡知令	University of California Davis
41	10 月 31 日	11 月 2 日	董朝华	西南财经大学
42	11 月 8 日	11 月 9 日	朱雪宁	复旦大学
43	11 月 11 日	11 月 13 日	施涛	Citadel LLC
44	11 月 16 日	11 月 18 日	朱国忠	加拿大阿尔伯特大学
45	12 月 10 日	12 月 11 日	蔡天文	澳大利亚莫纳什大学
46	12 月 19 日	12 月 21 日	宋瑞	North Carolina State University

---------在此感谢全系老师对系里工作的支持----------