光华管理学院
Guanghua School of Management

商务统计与经济计量系

工作报告

2016 年

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 4

1、讲座交流 4

2、出访交流 7

四、 教学工作 8

1、开设课程 8

2、新生见面会 10

3、培养学生情况 10

五、 系活动 11

1、系主办会议 11

2、来访交流（不含讲座嘉宾） 11

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），澳大利亚莫纳什大学高集体教授（16 年 9 月新聘），以及沃顿商学院的蔡天文教授（16 年 11 月新聘）。另外芝加哥商学院的刁锦寰教授自我系 2002 年成立以来一直担任荣誉教授。

二、 科研成果

1、项目成果

商务统计与经济计量系 16 年获批国家自然科学基金资助面上项目 2 项，批准金额为 94.4 万元；国家重点研发计划重点专项项目 1 项（项目名称：空气质量统计诊断模型），批准金额为 1603 万元。陈松蹊教授担任此国家重点专项项目课题组（共 5 个课题）组长，陈松蹊、王汉生、虞吉海 3 位教授分别担任此项目中三个课题的课题负责人，课题批准金额合计 1003.7 万元。

项目类别	姓名	项目名称	批准金额（万元）
自科面上项目	涂云东	高维非线性模型中的因子分析：理论和应用	46.4
自科面上项目	李辰旭	金融衍生品定价中的计量经济学分析	48
国家重点专项	陈松蹊	空气质量统计评估方法	414.6
国家重点专项	王汉生	大气污染数据质量监控	233.5
国家重点专项	虞吉海	污染与宏观经济、人口健康的计量分析	355.6

（注：数据来源于学院科研办公室）

2、论文发表

2016 年，商务统计与经济计量系在学术期刊上发表论文 22 篇，21 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 4 篇，光华 B 类论文 13 篇。另有即将发表的国际论文 8 篇，其中光华 A 类论文 2 篇，光华 B 类论文 5 篇。

英文论文：

[1] Bryant, J., **Zhang, J.** L. (2016), "Bayesian Forecasting of Small Area Demographic Rates," *Statistica Sinica*, 26, 1337-1363. **B**

[2] **Chen, S. X.** (2016) Peter Hall's Contribution to the Bootstrap, *The Annals of Statistics*, 44, No. 5, 1821–1836. **A**

[3] **Chen, S. X.**, Lei, L.-H. and **Tu, Y-D** (2016). Functional Coefficient Moving Average Models with Applications to Forecasting Chinese CPI, *Statistica Sinica*, 26, 1649-1672. **B**

[4] He, J. and **S. X. Chen** (2016) Testing Super-Diagonal Structure in High Dimensional Covariance Matrices, *Journal of Econometrics,* 194, 283-297 **A**

[5] J. Dong， X. Qin， **M. Xu**， MS Direnzo (2016). Boundary Conditoins of the Emotional Exhaustion-Unsafe Behavior Link: The Dark Side of Group Norms and Personal Control. *Asia Pacific Journal of Management*, 33(1), 113-140.

[6] Lee, L.F. and **J. Yu**, 2016. Identification of Spatial Panel Durbin Models. *Journal of Applied Econometrics,* 31, 133-162. **B**

[7] **Li. C** (2016). Bessel Processes, Stochastic Volatility, and Timer Options, *Mathematical Finance*, 26(1), 122-148. **B**

[8] Li, Sand **Y. D. Tu** (2016). “On Estimating Nonparametric Multiplicative Error Models,” *Economics Letters*, 143, 66-68, June 2016. **B**

[9] Li, Sand **Y. D. Tu** (2016). “Root-n Consistent Density Estimation in Semiparametric Regression Models,” *Computational Statistics and Data Analysis*, 104, 91-109, December 2016.

[10] Liang, X., Li, S., Zhang, SY, Huang, H. and **S. X. Chen** (2016). PM2.5 Data Reliability, Consistency and Air Quality Assessment in Five Chinese Cities, *Journal of Geophysical Research—Atmosphere*, 121, 10,220–10,236.

[11] Lu, X., Zhao, J., Chen, Y., and **Wang, H.**, A Choice Model with a Diverging Choice Set for POI Data Analysis, *Statistics and its Interface*, 9, 355-363.

[12] **Xu, M. Y.**, Zhong, P. S. and W. Wang (2016). Detecting Variance Change-Points for Blocked Time Series and Dependent Panel Data. *Journal of*

Business & Economic Statistics, 34(2): 213-226. **B**

[13] Pan, R., **Wang, H.**, and Li, R. Ultrahigh Dimensional Multi-Class Linear Discriminant Analysis by Pairwise Sure Independence Screening. *Journal of the American Statistical Association*, 2016, 111(513), 169-179. **A**

[14] Peng, L. H, **S. X. Chen** and W, Zhou (2016) More Powerful Tests for Sparse High-Dimensional Covariances Matrices, *Journal of Multivariate Analysis*, 149, 124-143. **B**

[15] **Tu, Y. D.** and Y. P. Yi (2017). "Forecasting CointegratedNonstationary Time Series with Time-varying Variance," *Journal of Econometrics*, 196(1), 83-98, January 2017. **A**

[16] Wang, Y., **Tu, Y-D** and **S. X. Chen** (2016) Improving Inflation Prediction with the Quantity Theory. *Economics Letters*, 149, 112-115. **B**

[17] Yan, T., Qin, H., and **Wang, H.**, Asymptotics in Undirected Random Graph Models Parameterized by the Strengths of Vertices. *Statistica Sinica*,26,273-293 **B**

[18] Yang, Z, **J. Yu** and S.F. Liu, 2016. Bias Correction for Fixed Effects Spatial Panel Data Models. *Regional Science and Urban Economics* 61, 52-72. **B**

[19] **Yu, J.**, L.A. Zhou and G. Zhu, 2016. Strategic Interaction in Political Competition: Evidence from Spatial Effects across Chinese Cities. *Regional Science and Urban Economics,* 57, 23-37. **B**

[20] **Zhang, J**. L., Härdle, W. H., Chen, C. Y., Bommes, E. (2016), "Distillation of News Flow into Analysis of Stock Reactions," *Journal of Business and Economic Statistics*, 34 (4), 547-563. **B**

[21] Zhu, X., Huang, D., and Pan, R., and **Wang, H.**, An EM Algorithm for Click Fraud Detection, *Statistics and its Interface*, 9, 389-394.

[22] **C. Li** and D. Chen (2016). Estimating Jump-Diffusions Using Closed-form Likelihood Expansions. *Journal of Econometrics*, To appear. **A**

[23] Guo, B. and **S. X. Chen** (2016). Tests for High Dimensional Generalized Linear Models. *Journal of the Royal Statistical Society, Series B*. To appear. **A**

[24] Huang, D., Yin, J., Shi, T., and **Wang, H.**, A Statistical Model for Social Network Labeling, *Journal of Business and Economic Statistics*, To appear. **B**

[25] Lan, W., Fang, Z., **Wang, H.**, and Tsai, C. L. Covariance Matrix Estimation via Network Structure, *Journal of Business and Economic Statistics*, To appear. **B**

[26] **Song X.** & Abderrahim Taamouti, Measuring Nonlinear Granger Causality in Mean, *Journal of Business and Economic Statistics*, To appear. **B**

[27] **Tu, Y. D.** (2017).“Efficient Nonparametric Estimation in Simultaneous Equation Models,” *Communications in Statistics - Theory and Methods,* To appear.

[28] Zhou, J., **Tu, Y.**, Chen, Y., and **Wang, H.** Estimating spatial autocorrelation with sampled network data, *Journal of Business and Economic Statistics*, To appear. **B**

[29] Zuo, T. and **S. X. Chen** (2016). Enhancing Estimation for Interest Rate Diffusion Models with Bond Prices. *Journal of Business and Economic Statistics*, To appear. **B**

中文论文

[1] 刘威仪、孙便霞、**王明进**，“基于日度低频价格的波动率预测”，《管理科学学报》， 2016 年 1 月，第 19 卷第 1 期，60-71 **B**

三、 学术交流

1、讲座交流

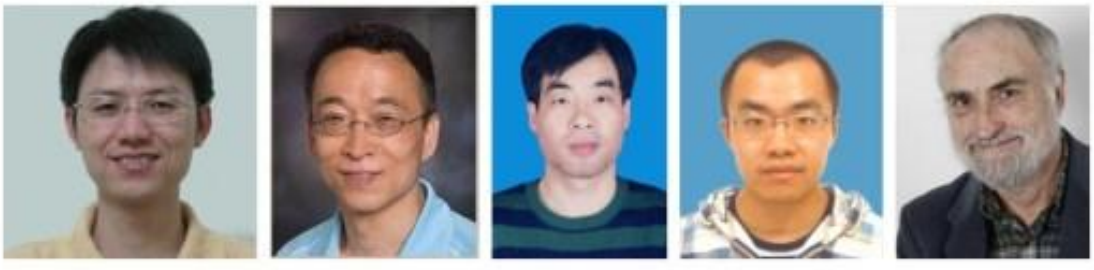
商务统计与经济计量系为拓宽教师及学生的视野，了解学科发展的前沿信息，多次邀请国内外知名专家学者来我院讲学，加强学术交流。2016 年共组织了 24 场学术讲座，详情如下表所示：

No.	Date	Speaker	Affiliation	Topic
1	2016/3/24	Haiqiang Chen	Xiamen University	A Regime Shift Model with Nonparametric Switching Mechanism
2	2016/3/31	Yanchu Liu	Sun Yat-Sen University	A New Smoothed Perturbation Analysis Estimation of Greeks for Financial Options with Discontinuous Payoffs
3	2016/4/5	Ke Wu	Renmin University of China	Asymmetry in Stock Comovements: An Entropy Measure
4	2016/4/14	Qiwei Yao	London School of Economics and Political Science	Kriging Over Space and Time Based on a Latent Reduced Rank Structure
5	2016/5/5	Haoxi Yang	Nankai University	Implications of Return Predictability across Horizons for Asset Pricing Models
6	2016/5/12	Xu Guo	Nanjing University of	Model checking for parametric single-index models: A dimension

			Aeronautics and Astronautics	reduction model-adaptive approach
7	2016/5/19	O-Chia Chuang	Wuhan University	Intergenerational Top Income Mobility in Taiwan
8	2016/5/19	Xiaogu Zheng	Beijing Normal University	Global Carbon Assimilation System using a modified Ensemble Kalman filter
9	2016/5/26	Ping Yu	The University of Hong Kong	Treatment Effects Estimators Under Misspecification
10	2016/5/30	Ji-Liang Shiu	Renmin University of China	Internally Consistent Estimation of Nonlinear Panel Data Models with Correlated Random Effects
11	2016/6/2	Nianqing Liu	Shanghai University of Finance and Economics	Nonparametric Test of Monotonicity of Bidding Strategy in First Price Auctions
12	2016/6/3	Myoung-jae Lee	Korea University	Regression Discontinuity with Integer Running Variables: Effect of Education on Fertility
13	2016/6/8	Lijun Bo	University of Science and Technology of China	Optimal Credit Investment with Borrowing Costs
14	2016/6/14	Lei Huang	Southwest Jiaotong University	Estimation of Semi-Varying Coefficient Time Series Models With ARMA Errors
15	2016/7/1	Peter M. Robinson	London School of Economics and Political Science	Semiparametric Inference on Trending Panel Data with Spatial Dependence
16	2016/7/6	Lawrence D. Brown	The Wharton School, Riverside	Empirical Bayes Prediction under Check Loss
17	2016/9/8	Shujie Ma	University of California, Riverside	Estimating Subgroup-Specific Treatment Effects via Concave Fusion
18	2016/9/14	Cheng-Der Fuh	National Central University	Model Selection in Hidden Markov Models via Marginal Likelihood
19	2016/10/20	Jintai Lin	School of Physics	Economic Trade and Transboundary Air Pollution
20	2016/10/27	John Bryant	Senior Researcher, Statistics New Zealand	The World's First Fully Bayesian Official Statistics
21	2016/	Per	Uppsala	Economic Status, Air Quality, and

	10/28	Johansson	University	Child Health: Evidence from Inversion Episodes
22	2016/11/3	Xingguo Luo	Zhejiang University	Instantaneous Squared VIX and VIX Derivatives
23	2016/11/24	Hongbiao Zhao	Xiamen University	A Beautiful Breakdown of CIR Intensity: Exact Simulation and Financial Application
24	2016/12/14	Ping Ma	University of Georgia	Leveraging methods for massive data logistic regression
25	2016/12/23	高健	中国环境科学研究院	颗粒物监测及源解析新技术发展与应用







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	2016.01.24-31	陈松蹊	澳大利亚	墨尔本	墨尔本大学	合作研究
2	2016.01.31-03.01	陈松蹊	美国	埃姆斯	爱荷华州立大学	合作研究
3	2016.04.09-15	陈松蹊	台湾	台北	中央研究院经济研究所	参加学术会议：2016 两岸对话（三）
4	2016.04.09-15	虞吉海	台湾	台北	中央研究院经济研究所	参加学术会议：2016 两岸对话（三）
5	2016.04.09-15	涂云东	台湾	台北	中央研究院经济研究所	参加学术会议：2016 两岸对话（三）
6	2016.04.09-15	宋晓军	台湾	台北	中央研究院经济研究所	参加学术会议：2016 两岸对话（三）
7	2016.04.23-05.10	陈松蹊	美国	埃姆斯	爱荷华州立大学	合作研究
8	2016.05.20-05.21	王汉生	韩国	大邱	韩国统计学会春季会议	作为主讲嘉宾参加国际会议
9	2016.06.11-20	张俊妮	意大利	撒丁岛	国际贝叶斯分析学会 2016 会务组	参加国际会议
10	2016.06.27-06.30	王汉生	中国	香港	第四届数理统计研究所亚太环会议	作为杰出演讲者参加国际会议
11	2016.07.31-10.25	陈松蹊	美国	芝加哥，爱荷华	美国统计协会，爱荷华州立大学	参加学术会议，合作研究
12	2016.10.30-12.10	陈松蹊	美国	爱荷华	爱荷华州立大学	合作研究
13	2016.11.09-12.11	涂云东	澳大利亚	悉尼，墨尔本	悉尼大学，莫纳什大学	进行学术访问，参加学术会议
14	2016.12.09-12.22	陈松蹊	澳大利亚	墨尔本	莫纳什大学	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16年上半年承担课程12门，其中：本科课程3门，研究生课程6门，本科、研究生合上1门，MBA课程1门，MPACC课程1门，教学工作量共28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（中文）	必修	4	72	130	涂云东
2	本科	Introduction to the Probability and Statistics(英文)	必修	4	72	130+5	张俊妮 宋晓军
3	本科	计量经济学	必修	3	54	65+5	虞吉海
4	本科&研究生	随机分析与应用	选修	2	36	30	李辰旭
5	研究生	高级计量经济专题	专业必修	3	54	70	涂云东
6	研究生	微观计量理论	选修	3	54	70	虞吉海
7	研究生	时间序列分析	专业必修	3	54	30	涂云东 姚琦伟
8	研究生	大样本理论	选修	2	36	30	陈松蹊
9	研究生	统计学研究专题之一	选修	2	36	30	陈松蹊
10	本科&研究生	随机分析与应用	选修	2	36	30	李辰旭
11	MBA	实用商务数据分析与预测	方选	2	30	50	王汉生
12	MPACC	数量分析方法	专业选修	2	30	60	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）

2）商务统计与经济计量系16年下半年承担课程13门，其中：本科课程3门，研究生课程5门， MBA课程5门，教学工作量共25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	本科生	数据分析与统计软件	选修	2	36	150	徐敏亚
2	本科生	金融中的数学方法	选修	2	36	160	李辰旭
3	本科生	应用计量经济学	大类平台	3	54	100	宋晓军
4	研究生	高级计量经济学	院必修	3	54	100	虞吉海
5	研究生	应用统计学	院必修	3	54	100	徐敏亚
6	研究生	Regression Analysis in Management Research	专业必修	2	36	30	李辰旭
7	研究生	数据挖掘与应用	专业必修	3	54	70	张俊妮
8	研究生	统计学研究专题之三	选修	2	36	30	宋晓军
9	MBA	数据分析与统计决策	必修	2	30	80	王汉生
10	MBA	数据分析与统计决策	必修	2	30	75	王明进
11	MBA	数据分析与统计决策	必修	2	30	75	王明进
12	MBA	数据分析与统计决策	必修	2	30	80	王明进
13	MBA	Data Analysis and Statistical Decisions	R	2	30	50	Wang Hansheng

（注：数据来源于学期初项目办公室发布的课程安排通知）

2、新生见面会

时间	新生人数	参加老师	地点
9 月 8 日	硕士： 5 人 硕转博： 3 人	王汉生、王明进、虞吉海、张俊妮、李辰旭、涂云东、宋晓军	2 号楼 477 室



3、培养学生情况

商务统计与经济计量系 16 年上半年在读硕士生 5 人，在读博士生 18 人，其中，16 年 7 月毕业硕士生 1 人，毕业博士生 4 人。16 年 9 月新入学硕士 5 人，硕转博 3 人。

五、 系活动

1、系主办会议

序号	时间	地点	会议名称	参会人数
1	1 月 13 日	北京大学光华管理学院	网络结构数据分析论坛：理论与实践	60 人
2	5 月 17-18 日	北京大学光华管理学院	大数据时代下的高维统计建模与分析研讨会	300 人
3	8 月 1-5 日	西安欧亚学院	第三届光华时间序列论坛	30 人
4	8 月 17 日	北京大学光华管理学院	国家重点研发计划项目“空气质量统计诊断模型”开题会议	30 人

（注：数据来源于行政中心会务与活动部）

2、来访交流（不含讲座嘉宾）

序号	来访日期	离开日期	姓名	学校
1	3 月 21 日	4 月 16 日	姚琦伟	London School of Economics and Political Science
2	3 月 21 日	7 月 31 日	Theis Lange	University of Copenhagen
3	4 月 27 日	5 月 3 日	范青亮	厦门大学
4	5 月 1 日	5 月 3 日	蔡天文	Wharton School of the University of Pennsylvania
5	5 月 1 日	5 月 13 日	Alan Welsh	ANU
6	6 月 2 日	6 月 3 日	Marc G. Genton	King Abdullah University of Science and Technology (KAUST)
7	6 月 2 日	6 月 3 日	Ying Sun	King Abdullah University of Science and Technology (KAUST)
8	6 月 4 日	6 月 7 日	姚方	University of Toronto
9	6 月 6 日	6 月 25 日	官永涛	University of Miami
10	6 月 8 日	6 月 16 日	陈玉国	University of Illinois at Urbana-Champaign
11	6 月 13 日	6 月 27 日	Rasmus Waagepetersen	Aalborg University
12	6 月 16 日	6 月 17 日	蔡天文	Wharton School of the University of Pennsylvania
13	6 月 18 日	6 月 23 日	王玮宁	The Humboldt University of Berlin

14	6 月 22 日	6 月 26 日	Zhu Ji	
15	6 月 23 日	6 月 26 日	Zhang Cui-Hui	
16	6 月 30 日	7 月 14 日	蔡知令	University of California, Davis
17	7 月 18 日	7 月 20 日	姚琦伟	London School of Economics and Political Science
18	7 月 19 日	7 月 21 日	蔡天文	Wharton School of the University of Pennsylvania
19	7 月 25 日	7 月 29 日	Yiwen Shen	Columbia University
20	8 月 6 日	8 月 21 日	姚琦伟	London School of Economics and Political Science
21	10 月 2 日	10 月 29 日	John Bryant	Senior Researcher. Statistics New Zealand

---------在此感谢全系老师对系里工作的支持----------