

# 俞学文

复旦大学 ◇ 管理学院 ◇ 应用经济学系

电话: +86-021-25011110 ◇ 邮箱: xuewenyu@fudan.edu.cn ◇ xuewentony.github.io/xuewenyu.github.io/

上海市杨浦区国顺路 670 号思源教授楼 315 室 ◇ 邮编: 200433

## 工作经历

青年副研究员/助理教授, 复旦大学管理学院 2022 年 9 月 - 至今

## 教育背景

美国普渡大学, 丹尼尔斯商学院, 经济学博士 2016 - 2022  
中国科学技术大学, 统计与金融系, 统计学硕士 2014 - 2016  
-意大利罗马大学, 交换生, 2016 年春  
中国科学技术大学, 统计与金融系, 金融学学士 2011 - 2014  
-化学物理学系, 2010 - 2011

## 研究领域

计量经济学, 实证宏观与金融, 金融科技 (DeFi)

## 论文发表

1. Inference in Mildly Explosive Autoregressions under Unconditional Heteroskedasticity, with Mohitosh Kejriwal, 2024, *Econometric Theory*, forthcoming.

2. Large Order-Invariant Bayesian VARs with Stochastic Volatility, with Joshua Chan and Gary Koop, 2024, *Journal of Business and Economic Statistics*, Volume 42, Issue 2, 825-837. [Link]

3. Multistep Forecast Averaging with Stochastic and Deterministic Trends, with Mohitosh Kejriwal and Linh Nguyen, 2023, *Econometrics*, Volume 11, Issue 4, 1-43.[Link]

4. Indirect Inference Estimation of Dynamic Panel Data Models, with Yong Bao, 2023, *Journal of Econometrics*, Volume 235, Issue 2, 1027-1053. [Link]

5. Fast and Accurate Variational Inference for Large Bayesian VARs with Stochastic Volatility, with Joshua Chan, 2022, *Journal of Economic Dynamics and Control*, Vol 143, 104505. [Link]

6. A Two-Step Procedure for Testing Partial Parameter Stability in Cointegrated Regression Models, with Mohitosh Kejriwal and Pierre Perron, 2022, *Journal of Time Series Analysis*, 43, 219-237. [Link]

7. Generalized Forecast Averaging in Autoregressions with a Near Unit Root, with Mohitosh Kejriwal, 2021, *Econometrics Journal*, 24, 83-102. [Link]

8. Bootstrap Procedures for Detecting Multiple Persistence Shifts in a Heteroskedastic Time Series, with Mohitosh Kejriwal and Pierre Perron, 2020, *Journal of Time Series Analysis*, 41, 676-690. [Link]

## 工作论文

9. Large Structural VARs with Multiple Sign and Ranking Restrictions, with Joshua Chan and Christian Matthes, 2023, *R&R, Quantitative Economics*.

10. VARs with Factor Stochastic Volatility: Identification, Order Invariance and Structural Analysis, with Joshua Chan and Eric Eisenstat, 2023, *working paper*.

11. A Test for Convergence Horizon, with Yong Bao, Dustin Chambers and Xiaotian Liu, 2024, *working paper*.

12. Bayesian Model Comparison for Large Bayesian VARs after the COVID-19 Pandemic, with Joshua Chan and Wei Zhang, 2024, *working paper*.

工作中论文

12. Testing for Multiple Bubbles under Nonstationary Volatility, with Mohitosh Kejriwal and Pierre Perron.

13. Complete Subset Averaging Methods for Program Evaluation by Panel Data Approach, with Xinyu Zhang.

14. A Spatial Model of Crop Yield Distributions, with Yong Bao and Xiaotian Liu.

教授课程

复旦大学管理学院	2022 年 9 月 - 至今
经济学原理 (本科, 2022&2023 年秋), 应用计量经济学 (博士, 2023&2024 年春), 计量经济学 II(博士, 2024 年春), Understanding Econometrics: Theory and Application (本科, 英文教学, 2024 年夏), Financial Econometrics (本科, 英文教学, 2024 年夏)	
普渡大学商学院	2018 年夏
计量经济学 (本科, 评分 4.5/5.0)	
普渡大学商学院, 助教	2016 - 2022
经济学原理 (本科), 国际经济学 (本科), 微观经济学 (M.B.A.), 宏观经济政策 (M.B.A.), 金融计量 (硕士), 概率论与统计 (博士), 计量经济学 II(博士), 时间序列计量 (博士), 高等面板数据计量 (博士)	

荣誉奖励

Denis Sargan 计量经济学奖, 英国皇家经济学会 <a href="#">[链接]</a>	2021
Bilsland 杰出论文奖, 普渡大学	2021
-普渡大学商学院每年仅奖励 1 人	
普渡大学商学院博士生研究基金	2019, 2020
普渡大学基金会研究基金	2019
普渡大学商学院最佳论文展示奖	2018, 2020, 2021
普渡大学商学院杰出教学奖	2018
欧盟 Erasmus Mundus 奖学金	2016
本科优秀学生奖学金	2011-2014

主持基金项目

国家自然科学基金青年项目	2024.01-2026.12
上海市科学技术委员会启明星扬帆计划	2023.04-2026.03

论文指导

复旦大学管理学院: MBA, EMBA 论文指导, 2024.

外部论文受邀指导: 莫纳什大学博士论文 (澳大利亚), 2024.

审稿经历

*Quantitative Economics, Journal of Econometrics, Journal of Business and Economic Statistics\*, Journal of Applied Econometrics, Econometric Reviews, Journal of Econometric Methods, Econometrics\*, Canadian Journal of Statistics, International Journal of Forecasting, Economic Inquiry, Managerial and Decision Economics, Economic Modelling\*, Review of Business, Applied Stochastic Models in Business and Industry, Journal of Quantitative Economics\*, Journal*

of Risk and Financial Management\*, IEEE Signal Processing Letters, Chinese Management Studies.  
(\* 表示该期刊多次审稿)

学术演讲

---

2024:

讲座邀请: 暨南大学 (经济与社会研究院)

学术会议: 计量经济学亚洲年会 (杭州), 东北财经大学计量经济研讨会 (大连), 第十三届数量经济学国际学术会议 (上海), 计量经济学北美夏季会议 \*

2023:

讲座邀请: 北京大学 (光华管理学院), 湖南大学 (经管研究中心), 中国科学技术大学 (管理学院), 伊利诺伊大学 \*, 北京航空航天大学 (经管学院), 首都经济贸易大学 (国际经管学院), MNB 研究所 (匈牙利央行), 赫尔辛基大学 (芬兰)

学术会议: 第二届大数据计量经济学会议 (长沙), 环亚计量青年学者会议 (上海), 中国经济学年会 (武汉), 计量经济学亚洲年会 (北京), 纪念萧政八十华诞计量研讨会 (厦门), 计量与统计年会 (东京)

2022:

讲座邀请: 香港城市大学 (商学院), Concordia 大学 (加拿大), 埃克塞特大学 (英国), 南洋理工大学, 波士顿大学, 复旦大学 (经济学院, 管理学院), 穆迪公司, 莫纳什大学 \*, 圣母大学 \*(美国), 普林斯顿大学 \*.

学术会议: 第十九届中国金融学年会 (上海), 上海财大高等研究院宏观经济研讨会 #, 计量理论与实践国际研讨会 \*, 中西部计量学者会议 (美国)\*, 计算与金融计量国际会议 \*

2018-2021: 国际应用计量学者年会 (在线), 计算与金融计量国际会议 (在线), 中西部经济学年会 (美国) 等  
(\* 合作者宣读, # 点评人)

更新于 2024 年 7 月