

学位授权点对应调整申请表

学位授予单位

名称：重庆大学

代码：10611

拟申请对应调整学位授权点

名称：统计学

学位授权级别（博士/硕士）

国务院学位委员会办公室
二〇一一年四月制

说 明

一、单位代码按照国务院学位委员会办公室编、北京大学出版社 2004 年 3 月出版的《高等学校和科研机构学位与研究生教育管理信息标准》中的代码填写。

二、“原学位授权点”的有关信息,按照国务院学位委员会、原国家教育委员会 1997 年颁布的《授予博士、硕士学位和培养研究生的学科、专业目录》填写,“调整后学位授权点”的有关信息,按照《学位授予和人才培养学科目录》(2011 年)填写。

三、本表填写中涉及的人员均指人事关系隶属本单位的在编人员,兼职人员不计在内。除学术带头人简况外,表中涉及的成果(论文、专著、专利、科研奖项、教学成果等)指本学科人员署名本单位获得的成果,凡署名其他单位所获得的成果不填写、不统计。

四、本表中的署名情况是指作者署名次序,填写格式为: N /M, N 为本人排名次序, M 为取得成果的总人数。论文的通讯作者可在 N 后加字母 T 进行标示。

五、本表中的科研经费应是本学科实际获得并计入本单位财务账目的经费。

六、本表中的招生人数、在学人数、获学位人数均包含各类研究生。

七、本表的统计范围应确属本学科,内容必须属实。除另有说明外,所填报各项与时间相关的内容均截至 2010 年 12 月 31 日,时间填写至月。

八、本表填写内容不涉及国家秘密并可公开。

九、本表复制(复印)时,必须保持原格式不变,纸张限用 A4 规格,装订要整齐。本表封面之上,不得另加其他封面。

I 原学位授权点基本情况**I-1 原学位授权点名单**

代码	学 科、专 业 名 称	学位授权级别	批 准 时 间
0701	数学	博士一级	201103
0202	应用经济学	博士一级	201103

I-2 原学位授权点各二级学科 2010 年招生情况

代码	学 科、专 业 名 称	录取博士生人数	录取硕士生人数
070103	概率论与数理统计	2	25

I-3 原学位授权点对应的重点学科情况

级 别	名 称	批 准 部 门	批 准 时 间
国 家 级			
省 部 级	计算数学	重庆市	200606
	应用数学	重庆市	200802

I-4 原学位授权点对应的国家(部、省)重点实验室(专业实验室、工程技术研究中心、工程研究中心、人文社会科学重点研究基地)

名 称	批准部门	批准时间
数学实验教学重庆市示范中心	重庆市教委	201012

II 学科简介

调整后学位授权点的特色、优势（限 600 字）

重庆大学1939年就设置了统计专修科，朱祖晦教授曾在系上讲授初等统计和数理统计，并著有《统计学教程》一书。上个世纪80年代，重庆大学何良材教授和天津大学马逢时教授等合编了国内较早的研究生统编教材《应用数理统计》，09年孙荣恒教授的《趣味随机概率》因《好玩的数学》丛书获得国家科技进步二等奖。杨虎教授从87年开始就一直从事数理统计前沿研究，近年来拓展到精算学领域，97年就担任了中国现场统计研究会副理事长，目前还是中国统计学会常务理事，教育部统计学专业教学指导委员。2005年设立重庆大学统计研究所，陈希孺院士受聘担任首任所长，2003年批准设立中国精算师考试中心，2004年建立北美精算师考试中心（SOA），2004年批准设立统计学专业，同年招收统计学专业本科生。2011年因获得数学和应用经济学一级学科博士点从而获得概率论与数理统计、统计学博士点。

重庆大学数学与统计学院有一支长期从事统计学研究与统计相关课程教学的师资队伍，有教授9人（含博士生导师5人），副教授8人，讲师13人，博士比例超过85%，近五年来，在国际统计学专业期刊发表论文逐年快速增长，近5年统计学论文被SCI收录60余篇，SSCI收录10余篇。

本学科一直跟踪统计学科的发展前沿，结合学校数学类和经济类相关学科优势与统计自身特色，形成了统计学下的四个特色学科方向——数理统计学、经济统计学、精算学与金融统计、应用统计。近5年来，各级各类项目实到总经费650.5万元，其中，纵向经费386.3万元。

注：此页不要另加附页。

III 学术队伍

III-1 调整后学位授权点现有在编人员结构								
专业技术职务	人数合计	35岁以下	36至45岁	46至55岁	56至60岁	61岁以上	具有博士学位人数	具有硕士学位人数
教授（或相当专业技术职务者）	9	0	1	8	0	0	26	31
副教授（或相当专业技术职务者）	8	4	2	2	0	0		
讲师（或相当专业技术职务者）	14	11	3	0	0	0		
III-2 调整后学位授权点的学科方向及其学术带头人、主要学术骨干								
学科方向	姓名	出生年月	获博士学位年月	专业技术职务及专家称谓	培养博士生		培养硕士生	
					近五年获学位人数	在学人数	近五年获学位人数	在学人数
数理统计学	杨虎	196312	200312	正高级	6	9	28	18
	何传江	196404	200406	正高级	0	8	23	19
	李寒宇	198112	200906	副高级	0	0	0	3
经济统计学	肖智	196101	200312	正高级	3	13	19	13
	何中市	196503	199606	正高级	1	6	15	21
	王昱	198210	200907	中级	0	0	0	4
精算学与金融统计	傅强	196304	199906	正高级	8	9	36	18
	刘琼荪	195905		正高级	0	0	21	18
	张志民	198111	201012	中级	0	0	0	2
应用统计	钟波	196403	200406	正高级	0	0	26	20
	龚劬	196309	200212	正高级	0	0	13	16
	易正俊	196310	200006	正高级	0	0	9	5

注：1. 学科方向的填写不少于4个，不超过6个。

2. 专家称谓指：院士、教育部长江学者奖励计划特聘教授、国家杰出青年基金获得者、“百千万人才工程”一层次或二层次入选者、教育部跨世纪人才、教育部新世纪人才。一人有多项专家称谓的只选填一项。

IV 学科方向

IV-1 学科方向名称：数理统计学

IV-1-1 本学科方向的特色、优势（限 500 字）

数理统计是统计学科的重要基础，也是上个世纪后半叶发展最迅速，最有国际影响的学科之一，广泛应用于生物、医学、经济、金融、环境、抽样调查和工程技术领域。重庆大学数理统计学科有着传统的优势地位，在科学研究和优秀教材编写中均有良好的声誉，2009 年我院教授编写的《趣味随机问题》因《好玩的数学》丛书而获得国家科技进步二等奖。

本专业方向早在 1987 年就开始从事数理统计中统计线性模型研究，在相对效率研究，Pitman 准则研究、统一有偏估计研究等方面获得了一些国际前沿的研究进展，近年来，我们的研究除了传统的无附加信息的线性模型各类有偏估计的研究外，系统研究了带随机约束或等式约束的线性模型下的各类有偏估计，并引入了刀切、谱分解、预检验、半参数等方法拓展现有研究，在降维技术上主要考虑主成份和 LASSO 等方法，同时重视数据分析和随机模拟研究。在非参数统计研究方面主要研究了半参数模型的经验似然统计推断和将半参数模型引入 GARCH 模型并用于证券实证研究，获得一些国际前沿性的研究成果。

本专业方向已经在国内外高水平期刊发表学术论文 150 余篇，被 SCI 检索 50 余篇

注：1. 该部分请按 III-2 所填学科方向逐个填写，依次编为 IV-1、IV-2、…。
2. 此页不要另加附页。

IV-1-2 本学科方向的学术带头人简况 (每个学科方向填写 1 人)							
姓名	杨虎	性别	男	出生年月	196312	专业技术职务及专家称谓	正高级
最高学位或最后学历 (包括学校、专业、时间)		博士, 重庆大学, 计算机软件与理论专业, 2003					
工作单位 (至院、系、所)		重庆大学 数学与统计学院 统计研究所					
2006 年 1 月至 2010 年 12 月期间最有代表性的成果	成果名称 (获奖、论文、专著、发明专利等)		获奖名称、等级及证书号, 刊物名称及 ISSN、检索号, 出版单位及 ISBN, 专利授权号			时间	署名情况
	Empirical likelihood for semiparametric varying coefficient partially linear models with longitudinal data		Statistics and Probability Letters, 80(2010)2:111-121. ISI:000273159100006			201002	1/2
	Weighted Polar Decomposition and WGL partial Ordering of Rectangular Complex Matrices		SIAM Journal on Matrix Analysis and Applications(SCI 期刊), 2008, 30(2): 898-924. ISI:000259955600026			200804	1/2
	Quasi minimax estimation in the general linear regression model		Journal of Statistical Planning and Inference(SCI 期刊), 2009, 139(7): 2117-2125. ISI:000265170600001			200907	1/2
	An alternative stochastic restricted Liu estimator in linear regression		Statistical Papers, 50(2009)3:639-647. ISI:000265651400015			200903	1/2
	培养大学生数学应用能力和创新素质的研究与实践		重庆市优秀教学成果一等奖 20091009(5-1)			200902	1/5
目前承担的主要科研项目、课题	名称		来源	起讫时间	经费 (万元)	本人承担任务	
	参数和半参数回归模型中的约束有偏和预检验估计理论研究		国家自然科学基金	201009-201312	18	主研	
	受约束线性模型参数的有偏估计理论在电力需求预测中的应用研究		重庆市科委	200909-201208	3	主研	
	矩阵广义逆与矩阵分解的相关理论在网络理论中的应用研究		重庆市科委	201009-201308	3	主研	
指导研究生情况	时间	招生人数		获学位人数			
		博士生	硕士生	博士	硕士		
	2006 年	2	6	0	6		
	2007 年	3	7	0	5		
	2008 年	3	8	0	4		
	2009 年	3	6	3	6		
2010 年	2	5	3	7			
主讲课程情况	时间	课程名称			学时	授课主要对象	
	每年春季 每年春季 每年秋季 每年春季 每年秋季 每年秋季	应用数理统计 矩阵不等式 线性模型 数值代数 广义线性模型与统计计算 统计新生研讨课			40 30 30 30 30 8	硕士生 硕士生 硕士生 博士生 博士生 本科生	

注: 授课主要对象填写“博士生”或“硕士生”或“本科生”。

IV-1-3 本学科方向 2006 年 1 月至 2010 年 12 月发表论文情况 (限填 10 篇)				
序号	论文名称	作者 (*)	发表时间	发表刊物、会议名称及检索号或 ISSN
1	Comparison of Two Estimators of Parameters under Pitman Nearness Criterion	杨虎 (1T/3)	201009	Comm. Stat. -Ther. Meth., A39(2010)17:3081-3094. ISI:000281315800006
2	An alternative form of the Watson efficiency	杨虎 (1/2)	200908	J. Stat. Plan. Infer. (SCI 期刊), ISI:000266417600022
3	Perturbation bounds for polar factors under weighted unitary invariant norm	杨虎 (1/2)	200808	Numer. Linear Alg. Appli. (SCI 期刊), ISI:000260153900002
4	The representation of generalized inverse $AT,S(2,3)$ and its applications	杨虎 (1/2)	200901	J. Compu. Appl. Math., 224(2009)1:204-209. ISI:000261980200020
5	Comparison of Two Estimators of Parameters under Pitman Nearness Criterion	杨虎 (1T/3)	201010	Comm. Stat. -Ther. Meth. (SCI 期刊), ISI: 000281315800006
6	A note on the perturbation analysis for the generalized Cholesky factorization	李寒宇(1T/3)	201002	Appl Math Compu.(SCI、EI 期刊), ISI:000273440600028
7	Relative Perturbation Bounds of Weighted Polar Decomposition	李寒宇(1T/2)	201001	Compu Math with Appli. (SCI、EI 期刊), ISI:000278887600023
8	Estimation in singular linear models with stochastic linear restrictions	徐建文(1/2)	200701	Comm. Stat. -Ther. Meth. (SCI 期刊), ISI: 000250013000022
9	A new stochastic mixed ridge estimator in linear regression model	黎雅莲(1T/2)	201006	Statistical Papers (SCI 期刊), ISI:000279486900008
10	Two Kinds of Restricted Estimators in Singular Linear Regression	黎雅莲(1T/2)	201007	Comm. Stat. -Ther. Meth. (SCI 期刊), ISI:000279839600009

注: 限填作者署名本单位发表的论文。(*) 作者姓名后括号内填写署名情况。

IV-1-4 本学科方向 2006 年 1 月至 2010 年 12 月承担的主要科研项目、课题清单 (限填 10 项)

序号	项目、课题名称 (下达编号)	来源	起讫时间	承担人 (*)	经费 (万元)
1	参数和半参数回归模型中的约束有偏和预检验估计理论研究(11001286), 经费 201011 到账	国家自然科学基金	201011-201312	徐建文 (1/5)	18
2	受约束线性模型参数的有偏估计理论在电力需求预测中的应用研究, 编号: CQ CSTC, 2009BB6189	重庆市科委	200909-201208	徐建文 (1/4)	3
3	矩阵广义逆与矩阵分解的相关理论在网络理论中的应用研究, 编号: CQ CSTC(2010BB9215)	重庆市自然科学基金项目	201009-201212	李寒宇 (1/3)	3
4	矩阵广义逆与矩阵分解的相关问题研究, 编号: CDJZR10100002	中央高校研究基金项目	201001-201112	李寒宇 (1/1)	5
5	线性模型参数的约束有偏估计理论与方法研究, 编号: CDJZR10100014	中央高校研究基金项目	201001-201112	黎雅莲(1/1)	5
6	参数和半参数回归模型的预检验估计研究, 编号: CDJZR10100001	中央高校研究基金项目	201001-201112	徐建文(1/1)	5
7	马氏链下融资融券保证金体系动态设置研究, 编号: CDJZR10100011	中央高校研究基金项目	201001-201212	黄光辉 (1/3)	5
8	基于期权博弈视角的西部风险投资发展研究, 项目编号: 201033020080042	国家社会科学基金项目	200806-201106	黄薇 (2/10)	9
9	可转换债券融资与项目柔性投资的互动机理研究, 编号: 70571089	国家自然科学基金	200601-200812	黄薇 (3/10)	16.5
10	基于精算的统计专业教学模式研究与实践, 编号: 0823050	重庆市教委	200808-201008	杨虎 (1/5)	2

注: (*) 承担人姓名后括号内填写署名情况。

IV-2 学科方向名称：经济统计学**IV-2-1 本学科方向的特色、优势（限 500 字）**

随着改革开放的进一步深入和全球经济一体化不断发展，人们对经济统计与经济信息，特别是经济统计信息需求的日益剧增，对经济统计信息服务的要求不断提高，经济统计相关问题层出不穷，其相关理论与方法正向着多学科交叉和多种信息融合的方向发展。

本方向从 1983 年以来一直从事经济统计的前沿研究，特别是 1997 年以来，将智能分析技术与经济统计相关理论相融合，针对多种统计信息融合的多因素多目标随机动态统计分析、预测、决策等问题开展了一系列前沿的研究。1998 年主持了国家统计局项目“企业统计信息自动化和智能化的问题研究—企业竞争力分析智能系统”。2000 年获国家统计局颁发的第五届全国统计科研成果三等奖。2000 年—2005 年在《统计研究》发表了 21 世纪企业竞争力评价指标体系、一种基于粗糙集理论的组合预测方法、基于软集合的企业竞争力综合评价方法研究、基于 LS-SVM 的信用评价方法等 4 篇论文。1999 年以来在系统工程理论与实践、系统工程学报、中国管理科学、南开管理评论、改革等国内期刊和 Computers and Mathematics with Application、Journal of Computational and Applied Mathematics、Expert Systems with Applications 等国外期刊上发表相关论文 60 余篇，被 SCI 检索 8 篇。

注：1. 该部分请按 III-2 所填学科方向逐个填写，依次编为 IV-1、IV-2、…。
2. 此页不要另加附页。

IV-2-2 本学科方向的学术带头人简况 (每个学科方向填写 1 人)							
姓名	肖智	性别	男	出生年月	196101	专业技术职务及专家称谓	正高级
最高学位或最后学历 (包括学校、专业、时间)		2003年12月获重庆大学技术经济及管理专业博士					
工作单位 (至院、系、所)		重庆大学经济与工商管理学院					
2006年1月至2010年12月期间最有代表性的成果	成果名称 (获奖、论文、专著、发明专利等)		获奖名称、等级及证书号, 刊物名称及 ISSN、检索号, 出版单位及 ISBN, 专利授权号			时间	署名情况
	Exclusive disjunctive soft sets		COMPUTERS & MATHEMATICS WITH APPLICATIONS ISSN:0898-1221, 617CA, ISI:000279257200025, EI20100912744060			201003	1/4
	A model based on rough set theory combined with algebraic structure and its application: Bridges maintenance management evaluation		Expert Systems with Applications, ISSN:0957-4174, 597AB, ISI:000277726300066, EI20101412820685			201007	1/3
	A combined forecasting approach based on fuzzy soft sets		Journal of Computational and Applied Mathematics, ISSN:0377-0427, 443EJ, ISI:000265892700036, EI20091412017273			200906	1/3
	BP neural network with rough set for short term load forecasting		Expert Systems with Applications, ISSN:0957-4174, 418XI, ISI:000264182800028, EI20084311651431			200901	1/4
The bijective soft set with its operation		COMPUTERS & MATHEMATICS WITH APPLICATIONS ISSN:0898-1221, ISI:000283449100012, EI 20104013275951			201010	1/4	
目前承担的主要科研项目、课题	名称		来源	起讫时间	经费 (万元)	本人承担任务	
	突发危机事件下基于软集合理论的企业供应链风险预测与决策模型研究		教育部人文社科及软科学研究计划项目 (10XJA630010)	201101-201312	9	项目负责人	
指导研究生情况	时间	招生人数		获学位人数			
		博士生	硕士生	博士	硕士		
	2006年	4	4	0	5		
	2007年	4	5	0	5		
	2008年	3	5	0	2		
	2009年	3	3	1	4		
2010年	2	5	2	3			
主讲课程情况	时间	课程名称			学时	授课主要对象	
	1997年至今 2000年至今 2006年至今 1998年至今 1998年至今 2000年至今 1998年至今	应用统计学 信息智能分析与预测 (原为: 信息智能分析与处理) 信息管理学 运筹学 运筹学 决策理论与方法 数据、模型与决策 (原为: 应用统计学)			54 32 32 64 30 30 54	本科生 本科生 本科生 本科生 硕士生 硕士生 硕士生	

注: 授课主要对象填写“博士生”或“硕士生”或“本科生”。

IV-2-3 本学科方向 2006 年 1 月至 2010 年 12 月发表论文情况 (限填 10 篇)

序号	论文名称	作者(*)	发表时间	发表刊物、会议名称及检索号或 ISSN
1	Exclusive disjunctive soft sets	肖智 (1)	201003	COMPUTERS & MATHEMATICS WITH APPLICATIONS ISSN:0898-1221, 617CA, ISI:000279257200025, EI20100912744060
2	A model based on rough set theory combined with algebraic structure and its application: Bridges maintenancemanagement evaluation	肖智 (1)	200906	Expert Systems with Applications, ISSN:0957-4174, 597AB, ?ISI:000277726300066, EI20101412820685
3	A combined forecasting approach based on fuzzy soft sets	肖智 (1)	200904	Journal of Computational and Applied Mathematics, ISSN:0377-0427, 443EJ, ?ISI:000265892700036, EI20091412017273
4	BP neural network with rough set for short term load forecasting	肖智 (1)	200901	Expert Systems with Applications, ISSN:0957-4174, 418XI, ISI:000264182800028, EI20084311651431
5	The bijective soft set with its operation	肖智 (2)	201010	COMPUTERS & MATHEMATICS WITH APPLICATIONS ISSN:0898-1221,
6	Data analysis approaches of soft sets under incomplete information	肖智 (2)	200812	Knowledge-Based Systems, ISSN:0950-7051, 384HQ, ISI:000261736300026, EI2004128071020
7	Research of Frequent Pattern Mining from XML Data Based on Heterogeneous XML Schema	何中市 (1)	200804	Journal of Computational Information Systems, 2008, 4(3):787-794
8	A Frequent Pattern Mining Algorithm on partially Labeled Subgraph	何中市 (1)	200808	Journal of Information & Computational Science, 2008, 5(5): 2203-2210
9	Image Bi-level Thresholding with the Shape_map	何中市 (1)	200810	Journal of Computational Information Systems, 2008, 4(5):2273-2281.
10	Semi-supervised learning based on nearest neighbor rule and cut edges	王昱 (1)	201008	Knowledge-Based Systems, ISI:000280532400007

注: 限填作者署名本单位发表的论文。(*) 作者姓名后括号内填写署名情况。

IV-2-4 本学科方向 2006 年 1 月至 2010 年 12 月承担的主要科研项目、课题清单 (限填 10 项)

序号	项目、课题名称 (下达编号)	来源	起讫时间	承担人 (*)	经费 (万元)
1	考虑特征空间异质性的分类技术及其在商务智能中的应用研究(71001112)	国家自然科学基金项目	201009-201312	王昱(1/3)	17.7
2	政府外贸信息智能监测与预警模型研究(CSTC, 2006BB2246)	重庆市自然科学基金项目	200609-200809	肖智(1/2)	3
3	基于软集合理论的软信息分析模型与方法研究(CSTC, 2004BB2183)	重庆市自然科学基金项目	200409-200609	肖智(1/2)	3
4	重庆市进出口信息智能监测预警系统研究	重庆市对外贸易经济委员会	200803-200912	肖智(1/2)	11
5	重庆市武隆县经济社会发展咨询研究(2006CW008)	国家开发银行重庆市分行计划项目	200609-200706	肖智(1/2)	12
6	重庆市双桥区经济社会发展咨询研究(2007CW0013)	国家开发银行重庆市分行计划项目	200706-200712	肖智(1/2)	12
7	成渝高速路通行量、通行费预测研究	重庆市高速公路发展建设公司项目	200812-200907	肖智(1/2)	12
8	视频图像文本提取与识别技术研究(2007BB2134)	重庆市自然科学基金项目	200701-200912	何中市(1/5)	3

注：(*) 承担人姓名后括号内填写署名情况。

IV-3 学科方向名称：精算学与金融统计**IV-3-1 本学科方向的特色、优势（限 500 字）**

本专业方向从 2005 年开始从事精算学与风险管理研究，涉及马尔科夫链、鞅论、随机微分方程等内容，重点在风险理论中的破产问题，它涉及到与破产概率相关的多个热点问题。本团队深入研究了具有相依关系和具有双边跳的风险模型，主要通过期望折现罚函数对破产概率、破产前瞬时盈余、破产后的赤字等多个问题展开研究，已经在国际精算领域 TOP 期刊 Insurance: Mathematics and Economics 及其他境外高水平期刊发表论文 12 篇，全部被 SCI 检索，其中 10 篇被 SSCI 检索，迅速进入国际精算研究前沿，刚刚成功主办了国际精算研讨会。

金融统计方面，在基于异质主体的非线性定价理论方面也取得了一系列的研究成果，该领域的主要研究工作包括金融市场中交易者异质行为类型及原因，区域和社会传染的非线性定价模型和金融格式化特征，多种风险资产的非线性定价模型，具有适应性理性均衡动态性和适应性信念系统的非线性定价模型，具有不同市场机制和差异交易者效用函数的非线性资产定价模型，具有不同私人信息或共同公共信息的非线性资产定价模型等

近 5 年来，在国际精算 Top 期刊 Insurance: Mathematics and Economics 等国际期刊发表论文 20 余篇，被 SSCI 检索 10 余篇次，在各种核心期刊上发表精算和金融统计方面的论文 60 余篇，承担科研项目 7 项，实到总经费 110 余万元。

- 注：1. 该部分请按 III-2 所填学科方向逐个填写，依次编为 IV-1、IV-2、…。
2. 此页不要另加附页。

IV-3-2 本学科方向的学术带头人简况 (每个学科方向填写 1 人)							
姓名	傅强	性别	男	出生年月	196304	专业技术职务及专家称谓	正高级
最高学位或最后学历 (包括学校、专业、时间)		博士(重庆大学, 技术经济与管理, 1999.6)					
工作单位(至院、系、所)		重庆大学经济与工商管理学院工商管理系					
2006年1月至2010年12月期间最有代表性的成果	成果名称 (获奖、论文、专著、发明专利等)		获奖名称、等级及证书号, 刊物名称及 ISSN、检索号, 出版单位及 ISBN, 专利授权号			时间	署名情况
	我国金融市场间投资转移和市场传染的阶段时变特征——股票与债券、黄金间关联性的实证分析		系统工程, 1001-4098			201005	1/2
	基于极值理论和 Copula 函数的条件 VaR 计算		系统工程学报, 1000-5781			200910	1/2
	基于信号博弈的中外在银行信贷竞争行为分析		管理工程学报, 1004-6062			201001	1/2
	基于帕累托偏好的公共产品服务相对效率的理论模型		管理世界, 1002-5502			200908	1/2
投资者买卖观点转换概率的非线性资产价格动态模型及实证研究		系统工程, 1001-4098			200906	1/2	
目前承担的主要科研项目、课题	名称		来源	起讫时间	经费(万元)	本人承担任务	
	基于异质主体的非线性定价理论		教育部	201009-201312	6	负责人	
	重庆市建立国家创新城市规划		重庆市政府	201009-201206	10	负责人	
渝北区建龙投资有限公司风险评估与对策		渝北区政府	201008-201108	8	负责人		
指导研究生情况	时间	招生人数		获学位人数			
		博士生	硕士生	博士		硕士	
	2006年	3	6	0		10	
	2007年	4	7	2		8	
	2008年	3	6	2		6	
	2009年	3	7	2		6	
2010年	3	5	2		6		
主讲课程情况	时间	课程名称				学时	授课主要对象
	2004.9—2005.9 2004.3—2011.3 2003.9—2011.9 2003.9—2011.9 2005.9—2011.9 2006.3—2011.3	应用统计学 风险管理 技术创新与管理 现代谈判艺术 管理研究方法 管理沟通				32 32 32 32 42 42	硕士生 硕士生 博士生 硕士生 本科生 本科生

注: 授课主要对象填写“博士生”或“硕士生”或“本科生”。

IV-3-3 本学科方向 2006 年 1 月至 2010 年 12 月发表论文情况 (限填 10 篇)				
序号	论文名称	作者(*)	发表时间	发表刊物、会议名称及检索号或 ISSN
1	Gerber - Shiu discounted penalty function in a Sparre Andersen model with multi-layer dividend strategy	张志民 (2)	200806	Insurance: Mathematics and Economics, Volume 42, Issue 3, June 2008, Pages 984-991
2	The Gerber-Shiu discounted penalty functions for a risk model with two classes of claims	张志民 (1)	200908	Journal of Computational and Applied Mathematics, Volume 230, Issue 2, 15 August 2009, Pages 643-655
3	A generalized penalty function in the Sparre-Andersen risk model with two-sided jumps	张志民 (1)	201004	Statistics and Probability Letters, Volume 80, Issues 7-8, 1 April 2010-15 April 2010, Pages 597-607
4	On a risk model with stochastic premiums income and dependence between income and loss	张志民 (1)	201005	Journal of Computational and Applied Mathematics, Volume 234, Issue 1, 1 May 2010, Pages 44-57
5	Optimal proportional reinsurance model with debt liabilities and bankruptcy value	李曼曼 (1)	201011	Proceedings of the 2010 International Conference on Engineering and Business Management, 2010, 4140-4143, ISTP 检索
6	Optimal Numerical Control of Volterra Integral Equations for a Regulated Risk Model	李曼曼 (2)	201011	Proceedings of 2010 International Conference on Computing, Control and Industrial Engineering, 2010, 399-402, ISTP, EI 检索
7	Methods for estimating optimal Dickson and Waters modification dividend barrier	李曼曼 (1)	200909	Economic Modeling, 2009, 886-892, SSCI 期刊
8	Risk Analysis of Portfolio by Time-Varying Copula	刘琼荪 (1)	200812	Proceeding of the 2nd International Conference on Risk Management & Engineering Management, 2008

注: 限填作者署名本单位发表的论文。(*) 作者姓名后括号内填写署名情况。

IV-3-4 本学科方向 2006 年 1 月至 2010 年 12 月承担的主要科研项目、课题清单（限填 10 项）

序号	项目、课题名称 (下达编号)	来源	起讫时间	承担人(*)	经费 (万元)
1	农业专家系统知识库与数据库规范与系统实现(编号:101010120050041)	科技部国家 高技术研究 发展计划 (863 计划)	200503-200712	刘琼荪(2/5)	13
2	广东省潜力产业发展战略及政策研究	广东省发 改委	200907-200912	傅强(1/4)	30
3	重庆市长寿区能源发展战略研究	重庆市长寿 区	200806-200912	傅强(1/5)	30
4	重庆市加强区域创新基础能力建设的对策研究	重庆市发 改委	201007-201012	傅强(1/2)	10
5	重庆国家创新型城市建设规划	重庆市发 改委	201011-201201	傅强(1/2)	10
6	重庆市重污染企业退出机制研究	重庆市发 改委	201008-201208	傅强(1/3)	15
7	马尔可夫到达排队系统的建模分析及算法研究(编号: NO.10971230)	重庆建桥工 业园区管 委会	200703-200712	傅强(1/2)	15
8	风险理论中若干问题的研究(编号: 200911B1B0110327)	重庆大学研 究生科技创 新基金(重点 项目)	200911-201011	张志民(1/3)	1.2
9	若干风险模型下的Gerber-Shiu分析及相关问题的研究(编号: CDJRC11100001)	重庆大学高 层次人才科 研启动基金	201007-201507	张志民(1)	5
10	保险公司红利分配策略与偿付能力研究(编号: CDJZR10100009)	重庆大学高 层次人才科 研启动基金	201007-201507	李曼曼(1)	5

注：(*) 承担人姓名后括号内填写署名情况。

IV-4 学科方向名称：应用统计**IV-4-1 本学科方向的特色、优势（限 500 字）**

应用统计主要包括统计学的一般理论和方法在社会，自然，经济，工程等各个领域的应用以及在应用中遇到的具体方法研究，它是统计学和其他学科之间形成的交叉学科，是理论统计学发展的源泉。本学科方向一直跟踪应用统计的发展前沿，主要研究内容有 Bayes 统计及应用、支持向量机、可靠性、工程和信息领域中的统计和方法研究等，以本团队为主，去年成功获得应用统计专业硕士授权点，已经录取 17 名应用统计专业硕士，我们的研究特色尤其强调统计建模和计算机模拟和程序分析工作，注重实际应用：如电气设备系统故障诊断模型研究；大电网概率风险评估的解析计算模型和算法研究；政府外贸信息智能监测与预警模型研究；重庆市进出口信息智能监测预警系统研究；交通紧急事件的预测处理模型等，还对口重庆市各个区县，开展了一系列社会发展咨询研究，已初具自身特色。

近 5 年来，在各种核心期刊上发表应用统计专业方面的论文 50 余篇，其中被 SCI 收录 10 余篇。近 5 年来承担科研项目 10 余项，实到总经费 80 余万元。

注：1. 该部分请按 III-2 所填学科方向逐个填写，依次编为 IV-1、IV-2、…。
2. 此页不要另加附页。

IV-4-2 本学科方向的学术带头人简况 (每个学科方向填写 1 人)							
姓名	钟波	性别	女	出生年月	196403	专业技术职务及专家称谓	正高级
最高学位或最后学历 (包括学校、专业、时间)		2004 年 06 月获重庆大学电力系统及其自动化专业 博士					
工作单位 (至院、系、所)		重庆大学数学与统计学院统计与精算学系					
2006 年 1 月至 2010 年 12 月期间最有代表性的成果	成果名称 (获奖、论文、专著、发明专利等)		获奖名称、等级及证书号,刊物名称及 ISSN、检索号, 出版单位及 ISBN, 专利授权号			时间	署名情况
	基于 Bayes 估计的金融风险值—VaR 计算		数理统计与管理, ISSN: 1002-1566			200710	1/2
	基于 Copula 构件相依的软件体系结构可靠性模型		计算机工程与应用, ISSN 1002-8331			201009	1/2
	支持向量分类机的修正核函数		计算机工程与应用, ISSN 1002-8331			200908	2/2
	基于 EVT-BM-FIGARCH 的动态 VaR 风险测度		中国管理科学, ISSN:1003-207X			200804	3/3
	基于 EVT-POT-FIGARCH 的动态 VaR 风险测度		南开管理评论, ISSN: 1008-3448			200804	3/3
目前承担的主要科研项目、课题	名称		来源	起讫时间	经费 (万元)	本人承担任务	
	突发危机事件下基于软集合理论的企业供应链风险预测与决策模型研究		教育部人文社科及软科学研究计划项目 (10XJA630010)	201101-201312	9	第三主研	
指导研究生情况	时间	招生人数		获学位人数			
		博士生	硕士生	博士	硕士		
	2006 年	0	7	0	4		
	2007 年	0	6	0	6		
	2008 年	0	6	0	3		
	2009 年	0	7	0	7		
2010 年	0	6	0	6			
主讲课程情况	时间	课程名称			学时	授课主要对象	
	1997 年至今 2009 年至今 2004 年 1997 年至今 2005 年至今 2005 年	概率论与数理统计 数理统计 多元统计分析 应用数理统计 统计决策理论 统计学习理论			48 48 40 40 30 30	本科生 本科生 本科生 硕士生 硕士生 本科生	

注: 授课主要对象填写“博士生”或“硕士生”或“本科生”。

IV-4-3 本学科方向 2006 年 1 月至 2010 年 12 月发表论文情况 (限填 10 篇)				
序号	论文名称	作者 (*)	发表时间	发表刊物、会议名称及检索号或 ISSN
1	基于 Bayes 估计的金融风险值—VaR 计算	钟波 (1/2)	200710	数理统计与管理, ISSN: 1002-1566
2	A model based on rough set theory combined with algebraic structure and its application: Bridges maintenancemanagement evaluation	钟波 (3/3)	200906	Expert Systems with Applications, ISSN:0957-4174, 597AB, ? ISI:000277726300066, EI20101412820685
3	BP neural network with rough set for short term load forecasting	钟波 (3/4)	200901	Expert Systems with Applications, ISSN:0957-4174, 418XI, ISI:000264182800028, EI20084311651431
4	Fuzzy multi-objective model for Environmental/Economic Power Dispatch	钟波 (3/4)	201009	Chongqing Daxue Xuebao/Journal of Chongqing University ISSN: 1000-582X, EI20104313323228
5	基于EVT-BM-FIGARCH的动态VaR风险测度	钟波 (3/3)	200808	中国管理科学, ISSN:1003-207X
6	有关顺序统计量的极大似然估计	荣腾中 (1/2)	201007	数学的实践与认识, 40(13)177-181
7	多维复杂分布的MCMC抽样	荣腾中 (1/3)	201008	重庆理工大学学报(自然科学版), 24(8)104-107
8	线性混合模型参数的部分岭型谱分解估计	黎雅莲 (2/2)	200806	应用概率统计 24(3):289-296
9	The Hodges-Lehmann VSI Control Chart	潘明勇 (1/2)	200902	南开大学学报(自然科学版) 42(1) 44-50
10	The Effect of Sample Size on the Estimated Limits for the Poisson Control Charts	潘明勇 (1/2)	200806	南开大学学报(自然科学版) 41(3) 41-46

注: 限填作者署名本单位发表的论文。(*) 作者姓名后括号内填写署名情况。

IV-4-4 本学科方向 2006 年 1 月至 2010 年 12 月承担的主要科研项目、课题清单 (限填 10 项)

序号	项目、课题名称 (下达编号)	来源	起讫时间	承担人 (*)	经费 (万元)
1	大电网概率风险评估的解析计算模型和算法研究 (50607021)	国家自然科学基金	200701-200912	钟波 (3/5)	27
2	计数抽样方案仿真数学模型及应用研究 (200508-006)	解放军总装	200508-200609	易正俊 (3/6)	2
3	电气设备系统故障诊断模型与方法研究 (CSTC, 2005BB3169)	重庆市科委 自然科学基金	200503-200702	钟波 (1/5)	2.3
4	政府外贸信息智能监测与预警模型研究 (CSTC, 2006BB2246)	重庆市自然 科学基金	200609-200809	钟波 (2/5)	3
5	基于软集合理论的软信息分析模型与方法研究 (CSTC, 2004BB2183)	重庆市自然 科学基金项目	200409-200609	钟波 (2/5)	3
6	重庆市进出口信息智能监测预警系统研究	重庆市对外 贸易经济委员会	200803-200912	钟波 (2/5)	11
7	重庆市武隆县经济社会发展咨询研究 (2006CW008)	国家开发银行 重庆市分行 计划项目	200609-200706	钟波 (2/5)	12
8	重庆市双桥区经济社会发展咨询研究 (2007CW0013)	国家开发银行 重庆市分行 计划项目	200706-200712	钟波 (2/5)	12
9	交通紧急事件的预测处理模型 (CSTC, 2005BB2199)	重庆市自然 科学基金项目	200505-200706	易正俊 (1/5)	2
10	大型设备智能预防性维护与自动化控制系统 (CSTC, 2009AC303)	重庆市科委 科技攻关项目	200905-201105	易正俊 (1/8)	10

注: (*) 承担人姓名后括号内填写署名情况。

VI 教学与人才培养

VI-1 调整后学位授权点研究生招生与授予学位人数							
		近五年人数 合计	2006年	2007年	2008年	2009年	2010年
硕士	招生人数	239	43	46	53	49	48
	授予学位人数	191	35	34	35	43	44
博士	招生人数	59	9	11	13	14	12
	授予学位人数	18	0	2	2	6	8

VI-2 调整后学位授权点 2006年1月至2010年12月获省部级以上优秀教学成果、教材奖情况（限填10项）			
序号	成果名称	获奖人(*)	获奖名称、等级及证书号、时间
1	培养大学生数学应用能力和创新素质的研究与实践	杨虎, 刘琼荪, 龚劬, 钟波, 段正敏	重庆市优秀教学成果奖; 一等; 20091009; 200902
2	应用数理统计	杨虎、钟波、刘琼荪	国家统计局全国统计科研优秀成果奖(统计教学奖); 三等; 2008E3-3; 200807

注：限填本单位取得的成果。此页不要另加附页。(*)获奖人姓名后括号内填写署名情况。

VI-3 调整后学位授权点研究生主要课程设置（不含全校公共课）

主要课程名称	主 讲 教 师			学时	注明已开设或拟开设
	姓 名	专业技术 职 务	所 在 单 位		
数值代数	王开荣	副高级	数学与统计学院	30	已开
近代数值计算方法	易正俊	正高级	数学与统计学院	30	已开
广义线性模型	杨虎	正高级	数学与统计学院	30	已开
非参数统计	刘琼荪	正高级	数学与统计学院	30	拟开
金融统计分析	黄光辉	副高级	数学与统计学院	30	拟开
随机精算模型	张志民	中级	数学与统计学院	30	拟开
统计计算	李寒宇	副高级	数学与统计学院	30	拟开

VI-4 调整后学位授权点 2006 年 1 月至 2010 年 12 月研究生在学期间有代表性学术成果 (限填 20 项)				
序号	研究生姓名	成果名称 (获奖、论文、专著、发明专利等)	获奖名称、等级及证书号, 刊物名称及 ISSN、 检索号, 出版单位及 ISBN, 专利授权号	时间
1	李婷婷	Empirical likelihood for semiparametric varying coefficient partially linear models with longitudinal data	Stat Prob Letters (SCI 期刊), 80(2010)2:111-121	201001
2	刘德强	The representation of generalized inverse AT,S-(2,S-3) and its applications	Journal of Computational and Applied Mathematics (SCI 期刊), 2009, vol.224, no.1	200902
3	王理同	Quasi minimax estimation in the general linear regression model	Journal of Statistical Planning and Inference (SCI 期刊), 139(2009)7:2117-2125	200907
4	徐建文	Estimation in Singular Linear Models with Stochastic Linear Restrictions	Commu Stat -Ther Meth (SCI 期刊), A36(2007)10:1945-1951	200705
5	李寒宇	A note on an unusual type of generalized polar decomposition	Linear Algebra and its Applications (SCI 期刊), 431(2009), 518-526.	200908
6	王理同	An Alternative form of the Watson Efficiency	Journal of Statistical Planning and Inference (SCI 期刊), 139(2009)8:2767-2774	200908
7	常新锋	A new two-parameter estimator in linear regression	Commu Stat -Ther Meth (SCI 期刊), A39(2010)6:923-934	201003
8	常新锋	Improvement of the Liu estimator in weighted mixed regression	Commu Stat -Ther Meth (SCI 期刊), A38(2009)2:285-292	200901
9	黎雅莲	Mean Squared Error Matrix Comparisons of Some Restricted Almost Unbiased Estimators	Commu Stat -Ther Meth (SCI 期刊), A38(2009)14:2321-2332	200907
10	郝媛媛	A ruin model with random income and dependence between claim sizes and claim intervals	Acta Math Appli Sinica, ES, (SCI 期刊) 26(2010)4:625-632	201010
11	张志民	On a perturbed Sparre Andersen risk model with multi-layer dividend strategy	J. Compu Appli Math (SCI 期刊), 232(2009)2, 612-624	200910
12	张志民	When does surplus reach a given target before ruin in the Markov-modulated dicusion model?	J Korean Stat Soc (SCI 期刊), 39(2010)2:207-219	201004
13	张志民	On a discrete risk model with two-sided jumps	J. Compu Appli Math (SCI 期刊), 234(2010)3:835-844	201006
14	张志民	On a risk model with stochastic premiums income and dependence between income and loss	J. Compu Appli Math (SCI 期刊), 234(2010)1:44-57	201005
15	张志民	A generalized penalty function in the Sparre-Andersen risk model with two-sided jumps	Stat Prob Letters (SCI 期刊), 80(2010)7-8:597-607	201004
16	张春梅	The conditional ridge-type estimation in singular linear model with linear equality restrictions	Statistics A Journal of Theoretical and Applied Statistics (SCI 期刊), 41(2007)6:485-494.	200703
17	钟震	Ridge Estimation to the Restricted Linear Model	Commu. Stat. -Ther. Meth. (SCI 期刊), A36(2007)11:2099-2115.	200706
18	马铁丰	范数类 Kantorovich 不等式的新结果	应用概率统计 23(2007)3:247-253	200708
19	马铁丰	Bayes 估计的进一步研究及其 Pitman 最优性	应用数学学报, 29(2006)3:428-435	200605
20	宋丽娟	基于 APARCH-Laplace 模型的 VaR 和 CVaR 方法	统计与决策, 2008(14):16-19	200807

注: 只填写研究生署名第一, 或者导师署名第一且研究生署名第二的成果。

VII 学术交流

VII-1 调整后学位授权点 2006年1月至2010年12月举办的主要国际国内学术会议			
会议名称	举办时间	参加人员	
		总人数	国(境)外人员数
国际会议 The 2010 International Conference on Insurance and Actuarial Science (2010 保险与精算国际研讨会) (与加拿大滑铁卢大学、重庆市科委、中国精算师协会共同举办)	201006	60	15
国际会议 2010 International Workshop on Industrial Problems (2010 国际工业应用数学问题讨论会) (与复旦大学、剑桥大学、约克大学联合举办)	201012	50	10
VII-2 调整后学位授权点 2006年1月至2010年12月教师(或研究生)在国外讲学或在国际会议上做报告情况			
讲学或报告人员姓名	国外大学名称或国际会议名称	讲学或报告时间	讲学或报告名称
杨虎	12th International congress on Insurance: Mathematics & Economics	200707	Ruin problems in a discrete Markov risk model
杨虎	台湾淡江大学	200711	A New Method to Determine the Ridge Parameter
黎雅莲	International Conference on the Frontiers of Statistics: High dimensional Data Analysis	200708	The Generalized conditional root estimation in singular linear model
刘德强	Eighth International Conference on Matrix Theory and Its Applications	200807	Reverse order laws for weighted least-squares g-inverses and weighted minimum norm g-inverses of the product of two matrices
张志民	香港大学	201003	Research Fellow
VII-3 调整后学位授权点 2006年1月至2010年12月承担的国际交流合作项目			
国际交流合作项目名称	起止时间	合作对象	
Postdoctoral fellow Program; Natural sciences and engineering research council of Canada (朱长荣, 项目总经费折合人民币80万元)	200801-201104	Kunquan Lan, Department of Mathematics, Ryerson University, Toronto, Canada	

注: 此页不要另加附页。

VIII 工作条件

VIII-1 可用于调整后学位授权点研究生培养的教学或专业实验室情况（仪器设备限填 20 台/套）				
实验室名称	仪器设备名称 型号、规格	实验室 人员配备 (人)	仪器设备(台或套)	仪器设备值 (万元)
总 计	—	10	211	227.77
重庆大学数学实验教学 示范中心	1 INTEL 交换机 INTEL 410T 2 INTEL 交换机 INTEL 510T 3 交流稳压器(磁饱和式) 三相 SVC-20KVA 4 集线器联想 LH-2627 5 集线器联想 LH-2016 6 不间断电源 7 计算机启天 2800 8 投影机 HX-2080 9 彩色打印机 V40 10 交换机 1024R+ 11 工作站 PRECISION650/17" 12 服务器 1600SC/15" 13 低压大电流稳压器* 14 无线路由器 6 台 15 非线性图像编辑卡 16 采集卡 DV4000 17 多媒体教学平台 18 服务器 PT6510D* 19 杰视红外半球摄像头 JS-813 20 惠普计算机 90 台	2	68	167.77
研究生创新实验室	HP 电脑 90 台、打印机、交换机	1	100	30
统计研究所	HP 电脑 30 台、打印机 5 台、交换机、工作站	5	37	20
精算中心	投影、摄像设备、复印设备	2	6	10

VIII-2 调整后学位授权点图书资料情况									
馆藏总量 (万册)	5.95	中文藏书量 (万册)	4.3	外文藏书量 (万册)	1.65	中文期刊 (种)	58	外文期刊 (种)	52
数据库 (种)	25	中文电子图 书(万册)	0	外文电子图 书(万册)	0	中文电子 期刊(种)	0	外文电子 期刊(种)	0
订购主要专业期刊、重要图书的名称、册数、时间									
Graduate Texts in Mathematics 1 198001									
SIAM 系列杂志 1 198001									
Mathematical Reviews 1 197801									
Advances in Mathematics 1 198001									
American Mathematical Monthly 1 198501									
Pacific Journal of Mathematics 1 198001									
Journal of Functional Analysis 1 198001									
Journal of Mathematical Analysis & Application 1 198001									
Journal of Differential Equations 1 198301									
Communications in P.D.E 1 198601									
Journal of Computational and Applied Mathematics 1 198001									
Studies in Applied Mathematics 1 198501									
Annals of Mathematics 1 198101									
Communications in Pure and Applied mathematics 1 198101									
Bulletin of AMS 1 198001									
中国科学(A 辑) 1 198001									
数学学报 1 198001									
数学进展 1 198001									
数学年刊(中英文版) 1 198401									
应用数学学报(中文版) 1 198401									
计算数学 1 198401									
数学物理学报(中文版) 1 198801									
现代数学基础丛书 1 198501									
非线性科学丛书 1 199401									
数学研究与评论 1 198801									
应用数学与力学 1 198101									
中国数学文摘 1 199901									
数学的实践和认识 1 197201									
应用概率统计 1 199101									
订购主要数字资源的时间和名称(含电子图书、期刊、全文数据库、文摘索引数据库等)									
199101 WorldSciNet 数据库									
199101 Kluwer 全文数据库									
199101 Elsevier SDOS 全文数据库									
199101 Science Bundle 数据库									
199101 EI Village 网络数据库									
199101 IEL (IEEE/IEE) 数据库									
199101 Science online 数据库									
199101 ProQuest 学位论文库数据库									
199101 数学评论数据库									
199101 Web of Science 数据库									
199101 Statistical Universe									
199101 Academic Universe									
199101 ProQuest 学位论文库									
199101 World Magazine Bank 数据库									
199101 PQDD 博硕论文库									
199101 大学数学练习系统数据库									
199101 ISTP 网络数据库									
199101 ABI 全文数据库									
199101 CNKI 镜像站点(包括中国优秀硕博学位论文全文数据库, 万方数据库镜像站点等等)									

注: 此页不要另加附页。

学位授予单位学位评定委员会审核意见：

主席： (学位评定委员会章)

年 月 日

学位授予单位承诺：

上述材料真实可靠、准确无误、不涉及国家秘密并可公开，其一切后果和法律责任由我单位承担。

法人代表： (单位公章)

年 月 日