

[English Version \(/English\\_Version.htm\)](#)

[联系我们 \(/xyjs/lxwm.htm\)](#)

[\(..//..//\)](#)



[Q 网站搜索](#)

[\(/system/\\_owners/jinrong/\\_webprj/finance-search.jsp?](#)

[urltype=tree.TreeTempUrl&wbtreeid=1150\)](#)

[\(..//..//\)](#)

University Affiliation Program  CFA Institute®



## 师资队伍

[师资队伍 \(../../szdw/teachers.htm\)](#)

[教师招聘 \(../../szdw/recruitment.htm\)](#)

师资队伍  
Faculty



贺方毅

**个人信息**

贺方毅, 系统工程学博士, 教授, 博导, fangyi\_he@swufe.edu.cn

办公室: 格致楼414

## 教育背景

2004.09—2008.01, 美国史蒂文斯理工学院系统工程与工程管理系、博士研究生

1999.09—2002.07, 中国科技大学统计与金融系、硕士研究生

1995.09—1999.07, 中国科技大学统计与金融系、本科生

## 工作经历

2012.06—至今, 西南财经大学金融学院金融工程系、教师

2009.10—2012.05, 四川大学经济学院金融工程系、教师

2008.02—2009.06, 法国巴黎银行纽约分部、定量分析员

2002.09—2004.06, 香港科技大学商学院金融系、助研

## 讲授课程

金融资产定价、金融经济学、金融工程

## 主要研究成果

[1].Shi, F., Shu, L., Yang, A. and He, F.(2020), "Improving minimum variance portfolios by alleviating over-dispersion of eigenvalues" ,*Journal of Financial and Quantitative Analysis*, forthcoming.

- [2].**He, F.**, Mao, T., Hu, T. and Shu, L. (2018), "A new type of change-detection scheme based on the window-limited weighted likelihood ratios" ,*Expert Systems with Applications*, Vol. 94, 149-163.
- [3].**He, F.**, Ahmad, B., Hayat, T., and Zhou, Y. (2016), "On regularity criteria for the 3D Hall-MHD equations in terms of the velocity" ,*Nonlinear Analysis: Real World Applications*, Vol. 32, 35-51.
- [4].**He, F.\***, Xie, H., and Wang, K. (2015), " Optimal setup adjustment and control of a process under ARMA disturbances" ,*IIE Transactions*, Vol.47, No. 3, 230-244.
- [5].Xie, H. and**He, F.\***(2015), "Optimal control for a linear system subject to a general ARIMA disturbance," *Mathematical Problems in Engineering*, Vol. 2015, Article ID 808903, 10 pages, 2015. doi:10.1155/2015/808903.
- [6].谢洪燕、肖明、**贺方毅**, "新汇改以来人民币汇率中篮子货币权重的测算及其与最优权重的比较" , 《世界经济研究》, 2015.3., 第26-37页。
- [7].**He, F.**, Jiang, W. and Shu, L. (2013), "Structural Change Identification and Mean Shift Detection for ARFIMA Processes" , Singapore Economic Review Conference 2013.

- [8].**He, F.**(2011), "An Optimal Control Algorithm Based on Kalman Filter for ARMA Disturbances," *ISI 2011 Proceedings of the 2011 IEEE International Conference on Intelligence and Security Informatics*, 345-348.
- [9].**He, F.**, Wang, K. and Jiang, W. (2009), "A General Harmonic Rule Controller for Run-to-Run Process Control," *IEEE Trans. Semiconduct. Manuf.*, Vol. 22, No.2, 232-244.
- [10].**He, F.**, Jiang, W. and Shu, L. (2008), "Improved Self-Starting Control Charts for Short Runs," *Quality Technology & Quantitative Management*, Vol. 5, No. 3, 289-308.
- [11].Qian, Z.,**He, F.**and Jiang, W. (2005), "Functional Mixed-effect Models for Curve Clustering",*INFORMS2005*, San Francisco.
- [12].Hu, T.,**He, F.**and Khaledi, B.-E. (2004), "Characterizations of Some Aging Notions by Means of the Dispersion-type or Dilation-type Variability Orders",*Chinese Journal of Applied Probability and Statistics*, Vol. 20, No. 1, 66-76. (应用概率统计, 英文版)

[13].Hu, T. and He, F.(2000), "A Note on Comparisons Of k-OUT-OF-n Systems With Respect To The Hazard And Reversed Hazard Rate Orders", *Probability in the Engineering and Informational Sciences*, Vol.14, 27-32.

### 承担的研究项目

西南财经大学“中央高校基本科研业务费专项资金”2019年度培育项目

(2019, 主持、已结题)：“基于收缩估计方法对中国期货市场最优套期保值比的实证研究”，项目批准号：JBK1902023。

国家自然科学基金面上项目（2018—2021，主持、在研）：“基于机器学习方法对时变的弱均值偏移变点的监测研究”，项目批准号：71772153。

西南财经大学“中央高校基本科研业务费专项资金”2017年度培育项目

(2017, 主持、已结题)：“从动态均衡的角度对港口危险货物运输和仓储的管理研究”，项目批准号：JBK170931。

西南财经大学2015年度中央高校基本科研业务费（2015，主研、已结

题）：“经济体联动和传导效应的研究及其贝叶斯网的构建”，项目批准号：JBK150144。

国家自然科学基金青年项目（2012—2014，主持、已结题）：“长记忆过程转变点的监测及有自相关扰动项的过程调整研究”，项目批准号：71102145。

西南财经大学引进人才科研启动资助项目（2013，主持、已结题）：“利用多元控制图对金融时间序列结构变化的监测研究”。

教育部留学回国人员科研启动基金项目（2012，主持、已结题）：“时间序列过程的监测与控制方法研究”。

美国国家自然科学基金项目（2006，主研、已结题）：“Data Quality Management Through Statistical Quality Control and Data Mining”。

### **奖励、荣誉**

2015年获西南财经大学金融学院优秀教师（教学）

2010年获四川大学经济学院优秀教师三等奖

2007年5月获得美国史蒂文斯理工学院杰出教学助理奖章

2004年9月至2008年1月获美国史蒂文斯理工学院助研（助教）全额奖学金

2001年获中国科技大学丘成桐奖学金（研究生奖项）

2000年获中国科技大学光华奖学金（研究生奖项）

**上一篇：申宇 (2585.htm)**

**下一篇：倪剑 (2579.htm)**

【关闭】



官方微信



书记院长信箱: [jinrong@swufe.edu.cn](mailto:jinrong@swufe.edu.cn)

学院联系邮箱: [sf@swufe.edu.cn](mailto:sf@swufe.edu.cn)

学院地址: 四川成都温江柳台大道555号格致楼3楼-5楼 邮编: 611130 (柳林校区) 四川成都光华村街55号 邮编: 610074 (光华校区)

联系电话: 028-87092269/2212 传真: 028-87092129