

吴未迟 | 简历

联系方式 清华大学伟清楼 114 室 | wuweichi@mail.tsinghua.edu.cn |
个人总结 清华大学工业工程系统统计学研究中心副教授
研究方向 非平稳时间序列；网络与大数据；非参方法；变点问题；多尺度问题的统计推断

工作经历

2020.12 - 今 准聘副教授 - 清华大学工业工程系统统计学研究中心
2018.12 - 2020.12 助理教授 - 清华大学工业工程系统统计学研究中心
2017.10 - 2018.12 博士后研究员 - 德国鲁尔波鸿大学数学系
2015.07 - 2017.07 博士后研究员 - 英国伦敦大学学院统计科学系与大数据所

教育经历

2010.09 - 2015.11 加拿大多伦多大学统计学博士，加拿大多伦多
2008.08 - 2010.02 美国哥伦比亚大学统计学硕士，美国纽约
2004.09 - 2008.07 北京大学物理学学士，中国北京

发表论文 (* 代表通讯作者)

1. Dette, H., & **Wu, W.*** (2020+), Prediction in locally stationary time series, **accepted by** *Journal of Business & Economic Statistics*.
2. Dette, H., Dhar, S.S. & **Wu, W.*** (2020+), Identifying shifts between two regression curves, **accepted by** *Annals of the Institute of Statistical Mathematics*.
3. Dette, H.*, **Wu, W.** (2019). Detecting Relevant Changes in the Mean of a Non-stationary Process. *The Annals of Statistics*, 47(6), 3578-3608. (alphabetical order)
4. **Wu, W.***, & Zhou, Z. (2018). Gradient-based Structural Change Detection for Nonstationary Time Series M-estimation. *The Annals of Statistics*, 46(3), 1197-1224.
5. **Wu, W.***, & Zhou, Z. (2018). Simultaneous Quantile Inference for Non-stationary Long-memory Time Series. *Bernoulli*, 24(4A), 2991-3012.
6. Dette, H., **Wu, W.**, & Zhou, Z. (2018). Change Point Analysis of Correlation in Non-stationary Time Series. *Statistica Sinica*, 29(2), 611-644.
7. **Wu, W.***, & Zhou, Z. (2017). Nonparametric Inference for Time-varying Coefficient Quantile Regression. *Journal of Business & Economic Statistics*, 35(1), 98-109.

在审论文

1. **Wu, W.** & Zhou, Z. *, MACE: Multiscale Abrupt Change Estimation Under Complex Temporal Dynamics, **submitted**.
2. **Wu, W.***, Olhede, S. & Wolfe, P. Tractably Modelling Dependence in Networks Beyond Exchangeability, **submitted**.
3. Dhar, S.S. and **Wu, W.***, Shift identification in time varying regression quantiles **submitted**.
4. **Wu, W.** and Zhou, Z. *, Adaptive Estimation for Non-stationary Factor Models And A Test for Static Factor Loadings, **submitted**.

在研项目

- 2020.01 - 2022.12 国家自然科学基金青年基金 (基金编号 No.11901337), 主持, 28.9 万元
项目名称: 局部平稳时间序列的统计推断和预测
- 2020.01 - 2024.12 北京市自然科学基金重点研究专题 (基金编号 z19J00005), 参与
项目名称: 人工智能的统计理论与算法基础

受邀学术报告

- 2020 第 14 届计算与金融计量经济学国际会议, 英国伦敦, 远程, **分会主持人**
2020 年清华大学统计与数据科学青年学者论坛, **会议组委会成员**
2020 年统计与数据科学青年学者论坛, 中国人民大学统计与大数据学院
- 2019 第 13 届计算与金融计量经济学国际会议, 英国伦敦
国际数理统计学会中国分会概率与统计会议, 中国大连
- 2018 第 12 届计算与金融计量经济学国际会议, 意大利比萨
德国上沃尔法赫数学研究所统计网络学术研讨会, 德国上沃尔法赫
- 2017 复旦数据科学论坛, 中国上海
国际数理统计学会中国分会概率与统计会议, 中国广西
- 2016 第 11 届计算与金融计量经济学国际会议, 西班牙塞维利亚

课程讲授

- | | | |
|-------------------|------------|-------|
| 2021.02 - 2021.06 | 金融统计 | 本科生课程 |
| 2020.09 - 2021.01 | 高等数理统计统计 I | 研究生课程 |
| 2020.01 - 2020.06 | 网络数据统计分析 | 研究生课程 |
| 2019.09 - 2020.01 | 面板数据分析 | 研究生课程 |

期刊服务

Mathematical Reviews

评论员

期刊审稿

Journal of the Royal Statistical Society, Series B

Journal of the American Statistical Association

Biometrika

Bernoulli

Electronic Journal of Statistics

Biometrics

Econometrics and Statistics

Statistics & Probability Letters

Science China Mathematics

Journal of Business & Economic Statistics