勤笃求真 数系天地

中国科学院大学数学科学学院/
中国科学院数学与系统科学研究院
数学前沿与交叉论坛

报告人： 洪永淼

时间： 2022年9月23日（周五）上午10:40-11:50

地点： 中科院数学院南楼204/腾讯会议401-896-631(线上)

题目： Econometric Analysis of Time-Varying Models via Interdisciplinary Approaches

摘要：

Characterization and inference for structural changes has been a longstanding problem in econometrics and statistics. In this talk, some recent developments in econometrics of time-varying models will be discussed, including (1) detection for structural changes of large factor models via discrete Fourier transform, (2) robust forecasting under structural changes via time-varying model averaging, and (3) regularized high-dimensional time-varying generalized method of moments (GMM) estimation via ridge fusion penalization. Applications to macroeconomic forecasts and asset pricing will be considered, and some directions for future research will be discussed.

报告人简介：

洪永淼，中国科学院数学与系统科学研究院、中国科学院预测科学研究中心特聘研究员，中国科学院大学经济与管理学院特聘教授、院长，发展中国家科学院（TWAS）院士，世界计量经济学会会士，国际应用计量经济学会（IAAE）会士，里米尼经济分析中心（RCEA）高级会士，教育部高等学校经济学类专业教学指导委员会副主任委员，《计量经济学报》联合主编。曾任美国康奈尔大学Ernest S. Liu经济学与国际研究讲席教授（2010-2020），清华大学经济管理学院特聘教授（2002-2005），中国留美经济学会会长（2009-2010）。2018年入选东方网、美国侨报“中国留学生的40年”代表人物。

研究领域为计量经济学、时间序列分析、金融计量学、统计学、中国经济，在Annals of Statistics、Biometrika、Econometrica、Journal of American Statistical Association、Journal of Political Economy、Journal of Royal Statistical Society B、Quarterly Journal of Economics、Review of Economic Studies、Review of Financial Studies、《经济研究》《管理世界》等经济学、金融学和统计学中英文主流期刊发表文章120余篇。出版《概率论与统计学》《高级计量经济学》、Probability and Statistics for Economists、Foundations of Modern Econometrics: A Unified Approach等中英文著作。2014-2021年连续8年入选Elsevier经济学中国高被引学者榜单。

论坛简介：

为了适应国家对数学发展的需求和数学自身研究的趋势，促进中国数学及交叉学科的发展，中国科学院大学数学科学学院组织数学前沿与交叉论坛，为数学家以及其它领域科学家交流合作搭建一个系统化与常规化平台。论坛定期邀请数学及相关学科专家，探讨数学内部各个分支以及数学与自然科学、工程技术与社会经济的交叉研究、合作交流与人才培养等方面的内容，通过多层面、多角度的研讨，深化科教融合，促进数学前沿及交叉研究和高层次人才培养。