

我校青年教师谢天论文被Review of Economics and Statistics接受

发布时间: 2016-12-13 浏览次数: 3047

日前, 厦门大学王亚南经济研究院(WISE)与经济学院金融系青年教师谢天作为通讯作者, 与加拿大皇后大学副教授Steven F. Lehrer合作撰写的论文“Box Office Buzz: Does Social Media Data Steal the Show from Model Uncertainty When Forecasting for Hollywood?”被国际公认的经济学与统计学顶尖期刊Review of Economics and Statistics正式接受。

该文使用从海量的推特文本中(Twitter Universe)萃取出的数据, 计算出电影的情绪指数, 以了解这些意见是否影响该电影的票房和DVD的销售额。该文比较了当下比较流行的11种计量方法, 包括各种机械学习、传统咨询、收缩估计、以及文中新提出的两种模型平均法(Model Averaging)。通过对比发现, 受大数据高维度变量空间的影响, 模型不确定性(Model Uncertainty)非常明显。该文因此建议, 在实施以大数据为基础的预测估计时, 应尽量采用可以缓解模型不确定性的计量方法以提高预测精度。

Review of Economics and Statistics是我校认定的经济学A类期刊, 也是教育部认可的12本经济学A类期刊, 2015年期刊影响因子达到2.979。该期刊由哈佛肯尼迪学院主办, 拥有100年的办刊历史, 主要刊发实证经济学中最重要的文章。

此外, 谢天独立完成的另一篇论文“Heteroscedasticity-robust Model Screening: A Useful Toolkit for Model Averaging in Big Data Analytics”也于近日被国际重要学术期刊Economics Letters正式接受, 即将发表。

谢天在加拿大求学多年, 曾先后获西安大略大学(现更名为韦仕敦大学)经济学荣誉学士学位、加拿大皇后大学经济学硕士与博士学位, 2016年受邀加盟厦门大学经济学科, 受聘为王亚南经济研究院(WISE)与经济学院金融系助理教授, 研究兴趣为金融计量、大数据、经济模型组合与预测等。

(经济学院 崔庆炜)