

首页

- > 新闻
- > 讲座
- > 活动
- > 观点

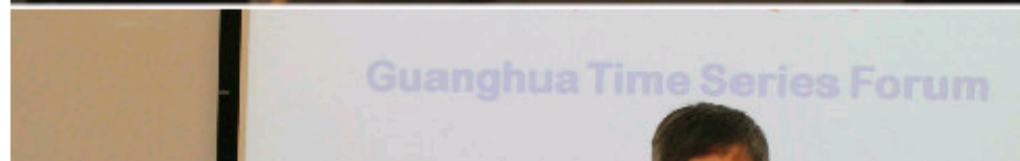
新闻

首届光华时间序列论坛成功举办

发布时间：2014-08-28

2014年8月18日至22日，首届光华时间序列论坛在北京大学光华管理学院成功举行。本届论坛由英国伦敦经济与政治科学学院的姚琦伟教授、北京大学光华管理学院商务统计与经济计量的组织者。论坛采用专家授课和与会者报告及讨论相结合的形式，来自美国匹兹堡大学的David C. Chen教授应邀讲授状态空间时间序列领域最新的方法与算法，30余位来自国内外多所大学的学者参加了论坛。

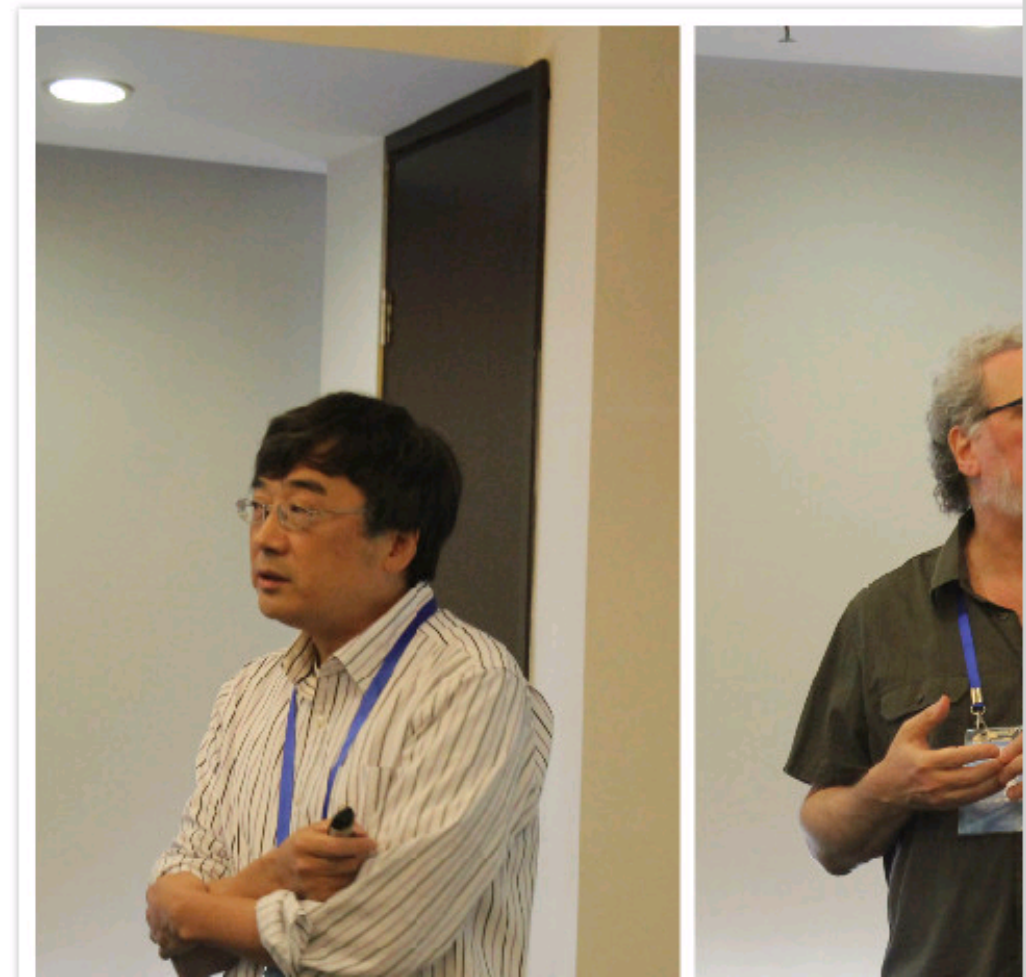
8月18日上午的开幕式由光华商务统计与经济计量系主任王汉生教授主持，英国伦敦经济学院的姚琦伟教授对论坛组织方的辛勤付出以及参会者的积极参与表达了感谢，同时还对论坛的未来发展提出希冀，祝愿与会嘉宾和学者能借助论坛平台交流最新的研究成果，迸发出思维和灵感的火花。

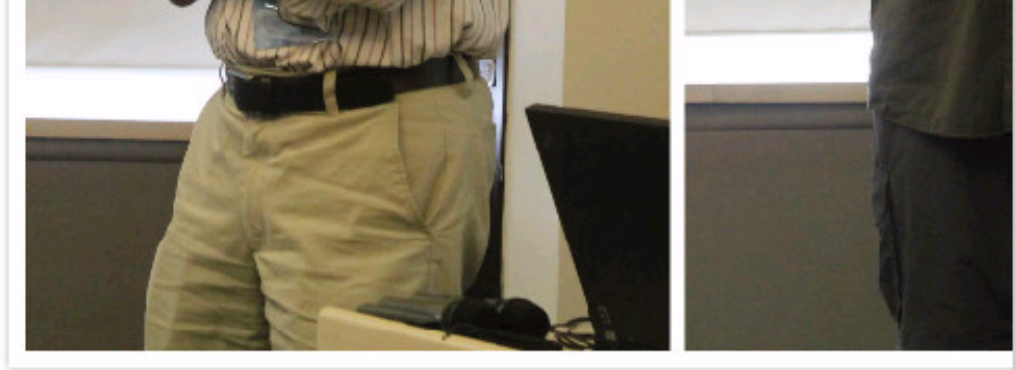




上图：王汉生教授 下图：姚琦伟教授

为期5天的论坛分为两个模块进行。8月18日-22日每天上午由来自美国匹兹堡大学的David Stoffer教授分别为与会者讲授状态空间时间序列领域的最新方法与算法。David Stoffer教授介绍了模型的贝叶斯估计方法（MCMC for SSM）。陈嵘教授在介绍状态空间模型的同时，为经典的应用实例，展示了状态空间模型在金融、经济、定位、测控和生物医学等多个领域的应用。陈嵘教授介绍了经典的蒙特卡罗算法（MC）以及序列蒙特卡罗算法（SMC）。注重实际操作的陈嵘教授为大家讲解了在SMC算法与MCMC算法的结合下如何解决各个领域的问题。



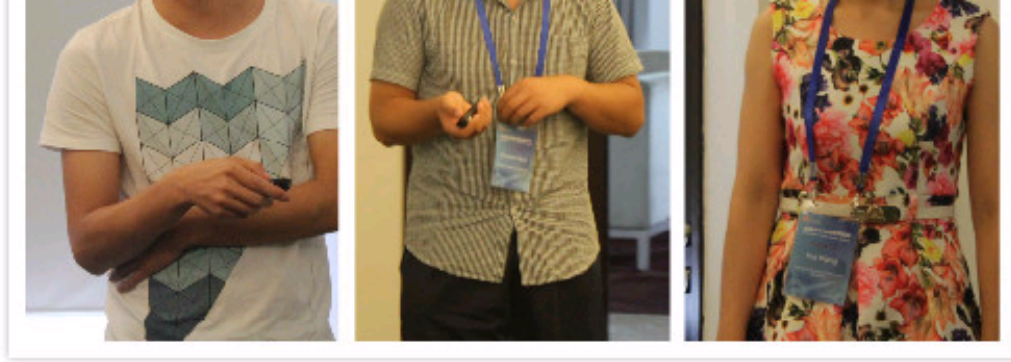


左图：陈嵘教授 右图：David Stoffer教授

8月18日-21日每天下午由参会者作报告，展示自己最新的研究成果。来自复旦大学的金峰展示了他的状态分位数模型；西南财经大学的龚金国教授与大家分享了用状态空间模型方法预测四川省的电力负荷；为大家展示了他对GARCH(1,1)模型渐进性质的研究；复旦大学的黄达博士为大家带来了基于马尔可夫链蒙特卡罗的最新研究成果；光华管理学院商务统计与经济计量系的博士生郭斌和中科院数学与系统科学研究院的博士生黄丹阳为大家分享了他们在高维数据方面的最新成果；中央财经大学的王辉教授向与会者展示了她在非平稳时间序列方面的最新研究；美国罗格斯大学的博士生刘侠璐提出了用因子转换模型研究高维时间序列数据。

此外，在8月21日下午，由光华管理学院商务统计与经济计量系在读博士生郭斌、黄丹阳展示了他们根据陈嵘教授讲授内容，用R实现状态空间模型拟合与估计问题。他们丰富的图表结合生动的讲解，同时他们高昂的学习热情和高效的学习效率也对与会者留下了深刻的印象。





与会学者报告现场

为期五天的论坛很快落下帷幕，与会学者对时间序列领域包括状态空间模型等多方面的前沿，纷纷表示受益匪浅。我们相信，本届论坛的成功举办，对促进状态空间时间序列模型在经济和金融领域的应用，将产生积极的影响。