

WISE林明副教授两篇学术论文被国际顶级统计学期刊接受

[2010年3月13日]

日前，我校王亚南经济研究院（WISE）和“计量经济学”教育部重点实验室副教授林明的两篇学术论文被美国统计学会期刊《Journal of American Statistical Association》正式接受，并即将发表。该期刊是统计学国际四大顶尖期刊之一，主要刊登统计学与计量经济学理论与应用方面的学术论文，在统计学、计量经济学领域有广泛的影响。

林明副教授博士毕业于北京大学数学系，曾在美国伊利诺伊大学芝加哥分校和美国罗格斯大学担任博士后研究员，并于去年夏天全职加盟WISE。其主要研究领域为统计学与计量经济学理论，生物统计以及金融计量。

此次，林明副教授被正式接受的论文共两篇，一篇是与其博士后导师美国罗格斯大学陈嵘教授，以及芝加哥大学Peter Mykland教授合作的题为“On generating Monte Carlo samples of continuous diffusion bridges”的文章。该文提出了一种能高效率生成随机连续时间扩散过程样本的蒙特卡罗方法，通过这种方法能够对只有离散时间观测值的随机扩散过程的似然函数作出更准确的估计并进行其他统计推断。

另一篇是与美国罗格斯大学陈嵘教授以及伊利诺伊大学芝加哥分校金融学教授Re-jin Guo合作的题为“Self-Selectivity in firm's decision to withdraw IPO: Bayesian Inference for hazard models of bankruptcy with feedback”的文章。文章探讨了公司是否撤消首次公开发行股票（IPO）这样一个事件中的自选择性以及这个事件对公司以后表现的影响，并通过贝叶斯的方法验证了撤消IPO事件中存在自选择性。

（WISE现代统计学研究中心）

厦门大学党委宣传部编辑