



北京理工大学

数学与统计学院学术报告

Some topics on model averaging

报告人: 张新雨 (中国科学院数学与系统科学研究院)

时间: 2025.10.21 下午13:20--14:55

地点: 文萃楼F 302

摘要: Model averaging has been explored in depth from the theoretical perspective and has been used widely in empirical applications. In this talk, I will introduce model uncertainty, least squares model averaging and its asymptotic optimality, weight convergence, asymptotic distribution and finite sample property. Also, I will talk about its extension to high-dimensional case, averaging machine learning methods and transfer learning.

报告人简介: 张新雨，中国科学院数学与系统科学研究院研究员。长期从事统计和计量经济学理论与应用方面的研究工作，与合作者解决了模型平均研究中的多个难题，并将模型平均与迁移学习、随机森林等方法融合提出了具有创新性的新方法，同时将所提出的预测方法应用于实际问题为相关部门的决策提供了参考依据。先后主持国家自然科学基金委杰出青年基金及其延续项目等，曾获中国青年科技奖。