

中国人民大学招收在职攻读工程硕士专业学位硕士生课程介绍九：金融时间序列分析在职硕士考试 PDF转换可能丢失图片或格式，建议阅读原文

https://www.100test.com/kao_ti2020/568/2021_2022__E4_B8_AD_E5_9B_BD_E4_BA_BA_E6_c75_568128.htm 课程简介：该课程主要讲授金融时间序列数据的处理和分析方法。主要内容是在讲授单变量和多变量时间序列的基本理论、模型和方法基础上以专题形式讲授金融数据的统计分布特征，市场有效性与可预测性的检验及其实践含义，金融数据的趋势与周期分析，协整性、共同趋势与统计套利技术，金融市场的因果关系分析及其应用，非线性时间序列模型及风险预测等最新的金融时间序列方法及应用。主讲人简介：龙永红 博士/教授，博士生导师 现就职中国人民大学信息学院数学系，任中国人民大学信息学院副院长。任全国经济数学与管理数学学会副理事长、中国运筹学会数学规划分会理事及北京数学会理事等。2006年-2007年在法国图卢兹一大IDEI做访问学者。主要研究方向为：数理经济与数理金融、实验经济学、拍卖的数学理论、实证金融与风险管理等。在国内外学术期刊上发表随机过程、信息经济学、金融理论与实证、实验经济学、拍卖理论等领域的学术论文20余篇，出版教材和著作10余部。在国内率先开展经济学的实验研究，自主开发了相关的实验系统。主持和参加国家和教育部科研项目9项。1994年获得“宝钢教育奖”。2006年被北京市授予“优秀教师”称号。更多在职硕士联考信息请访问：百考试题在职硕士联考网（收藏本站）百考试题在职硕士联考论坛 100Test 下载频道开通，各类考试题目直接下载。详细请访问 www.100test.com