金融统计

(课程号: 40160743)

李东

清华大学统计学研究中心





授课教师



李东 副教授



电 邮: malidong@tsinghua.edu.cn

电 话: 62780177

办公地点: 伟清楼203B

- 香港科技大学博士
- 香港科大、爱荷华大学博士后



清华大学"统计学研究中心"简介

建立具有清华特色的高水平教师队伍和学科体系

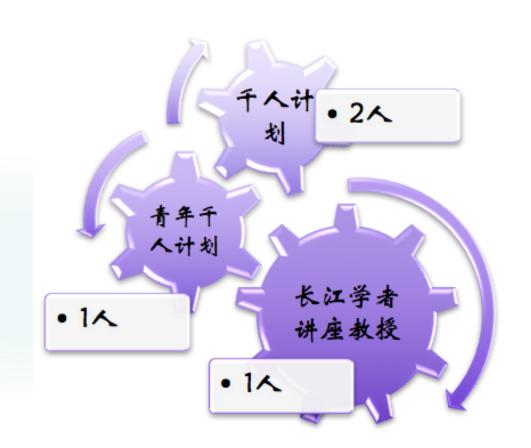
与校内各院系和社会各界展开全方位的深度合作

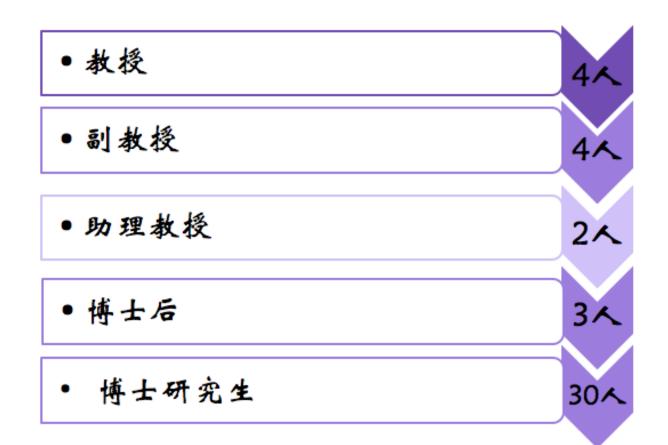
培养一大批优秀统计学和数据科学专业人才

建设国际一流的统计学科



清华大学"统计学研究中心"简介







课程信息

➤ 上课地点: 六教 6A215

▶ 上课时间:第6大节 19:20 - 21:45

> 课程助教: 杨萱铃



> 主要参考书

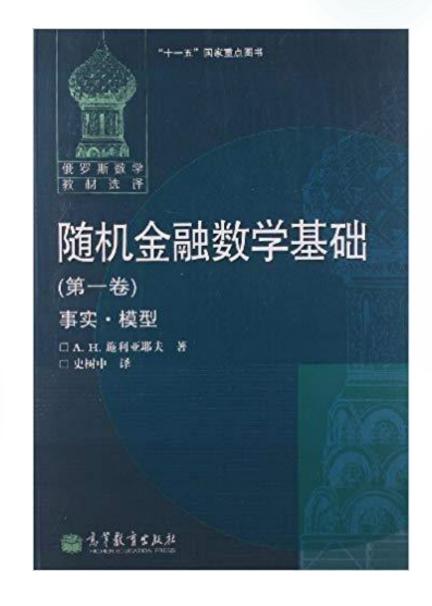
Mathematics Monograph Series 30

The Elements of Financial Econometrics

Jianqing Fan Qiwei Yao (范剑青 姚琦伟)

(计量金融精要)

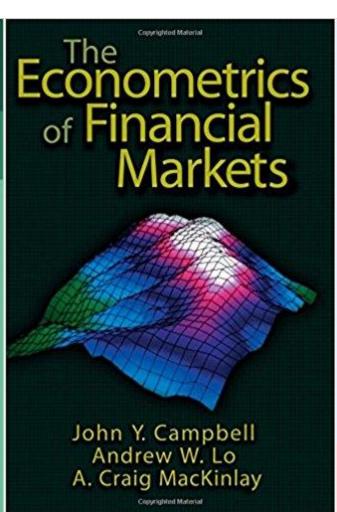


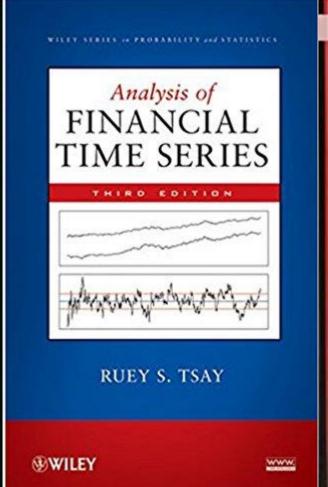


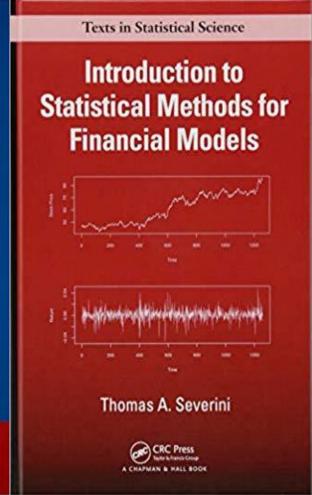


其它参考书

Springer Texts in Statistics Tze Leung Lai Haipeng Xing **Statistical Models** and Methods for **Financial Markets** Springer







考核标准

> 最终成绩构成

• 平时作业: 30%

• Project : 20%

• 期末考试: 50%

> 平时作业规则

- 通过"网络课堂"按时提交作业(pdf)
- 所有补交作业必须在一周之内完成,其成绩至多按实际 成绩的50%计分;一周之外的补交,成绩为零分.

> 作业抄袭处理规则

- 如抄袭者主动承认, 当次作业成绩零分并给予警告
- 如抄袭者被他人举报并确认抄袭行为,本课程成绩按不 及格核算,并交学校有关部门处理
- 如抄袭者和被抄袭者均不主动承认,两人课程成绩均按不及格核算,并交学校有关部门处理
- 已有警告记录的抄袭者,发现第二次可疑抄袭行为,交 学校有关部门处理,查实后本课程成绩按不及格核算

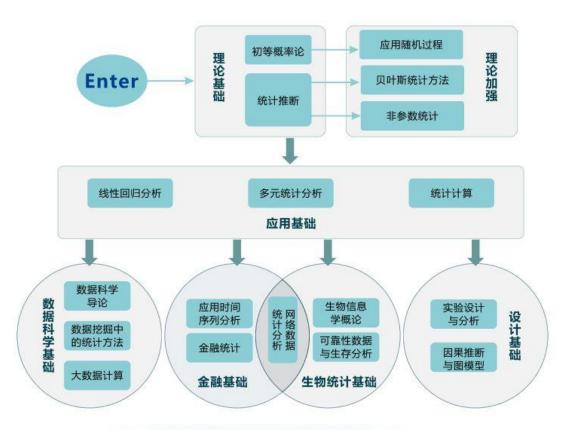


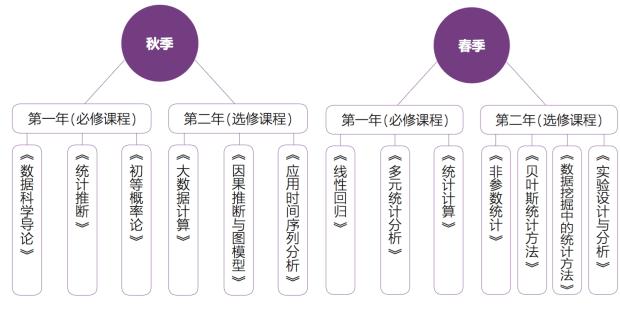
校内统计学资源



统计学研究中心"统计学辅修"项目

▶ 项目周期2年,每年录取优秀本科生90人左右





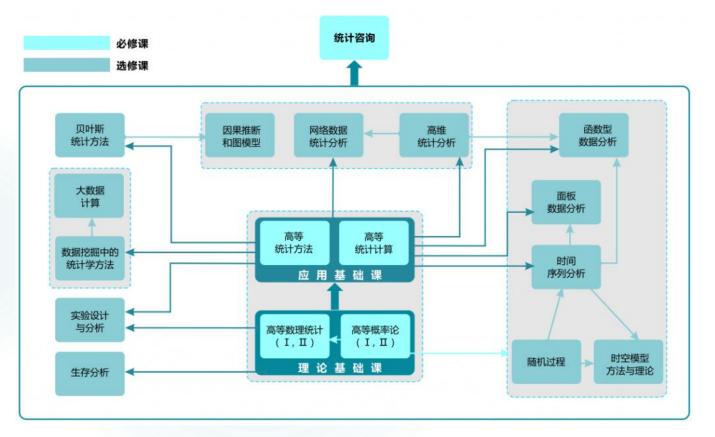
项目链接:

http://www.stat.tsinghua.edu.cn/programs/undergraduate-programs/



统计学研究中心"统计学博士"项目

▶ 项目周期3-5年,每年录取优秀博士生10人左右



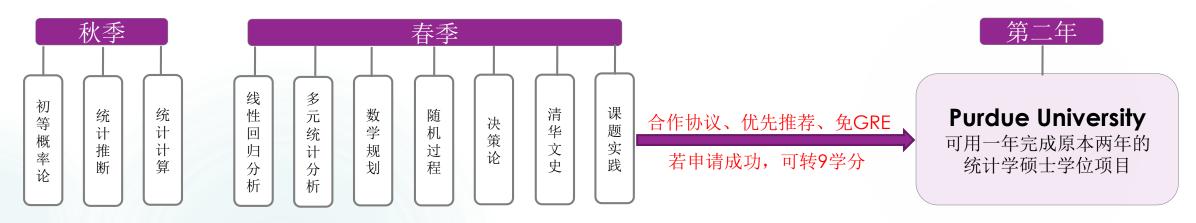
- 研究方向
 - > 数理统计
 - > 统计计算
 - > 生物与医学统计
 - > 计量经济与金融统计
 - > 大数据技术
 - > 工业统计等

项目链接: http://www.stat.tsinghua.edu.cn/programs/ph-d-program/



统计学研究中心"数据科学培训"项目

▶ "统计与数据科学研修班",项目周期1年,每年录取优秀在校或在职人士30人左右



项目链接: http://www.stat.tsinghua.edu.cn/admissions/training-programs/

- ► "数据科学与大数据技术集训班",项目周期1周,每年开办3次左右
 - A. 数据分析的统计 方法与原理
- B. 数据科学的原理 与技术
- C. 数据科学编程技术与平台
- D. 数据科学实战

项目链接: http://www.stat.tsinghua.edu.cn/admissions/summer-school-enroll/



统计咨询中心"统计和数据分析"咨询服务

- ▶ 面向清华师生提供专业化的咨询服务
- ▶ 发展宗旨: "数据引领,合作共赢"





工作流程



校内资源: 统计咨询中心

服务范围



实验设计与研究计划支持

- 确立实验目标
- 筛选主要因素
- 设计实验方法
- 功效分析
- 样本量计算
- 支持方案建议书



数据清理与准备

- 数据清理
- 处理缺失数据
- 发现并处理无效数据



统计建模与分析

- 模型选择与构建
- 变量选择
- 模型诊断
- 有效性验证



数据获取与验证

- 确定数据格式
- 统一数据标准
- 设计调查问卷
- 数据有效性验证



软件支持与帮助

- 多种统计软件支持
- 开发新程序
- 已有程序排错



分析方法与结果解释

- 方法论证
- 结果解释与分析
- 论文撰写支持
- 结果展示

咨询链接: http://www.stat.tsinghua.edu.cn/programs/ph-d-program/









统 计 学 研 究 中 心 CENTER FOR STATISTICAL SCIENCE







欢迎关注"水木数据派"

