

华昱资本
同创价值

厦门怡惟服饰股份有限公司 投资价值分析报告

版本: 1.0



方莲
2014年5月

XX 公司 XX 项目 投资价值分析报告

版本: 1.0

方 莲

2014 年 5 月

HY CAPITAL INVESTMENT GP
华昱资本管理公司

保密承诺



本商业计划书内容涉及商业秘密, 仅对有投资意向的投资者公开。本公司要求投资公司及相关投资者收到本商业计划书时做出以下承诺:

1. 未经允许不能复印/复制或向第三方详细复述本商业计划书。
2. 未经允许不能自行使用或协助任何第三方使用借鉴本计划书的内容方法从事与本公司有竞争关系的相应领域的商业行为。
3. 未经允许不能自行使用或协助任何第三方使用借鉴本计划书的内容方法从事与本公司有竞争关系的相应领域的商业行为。

目录



摘 要	vi
1 时间序列分析	1

插图目录



表格目录



摘 要



目前 R 在数量金融领域大受欢迎,被广泛的使用在诸如资产定价、收益率曲线估计与预测、

第一章 时间序列分析



这一章主要介绍如何在 R 中处理时间序列。金融数据主要是时间序列数据,即在一个时间范围内按照固定时间间隔对所研究的变量进行观察并逐步记录而得到的数据集。这种通过有规律的观测得到的数据往往表现为在时间上的依赖性,即各个时点的数据具有时间依存性。这与传统统计的『独立不相关』的基本假设不同,我们往往在处理时间序列数据时需要将数据的依赖性加以研究,金融变量往往表现为内在变化规律的一致性,这往往成为时间序列分析的研究重点。

R 已经成为研究和分析金融时间序列数据的首要选择软件,目前已有的 packages 有

1. zoo
2. xts(extensive time series)
3. TRR
4. quantmod:主要用于从网上下载金融数据,并提供了一套完整的作图方法

quantmod

xts: extensible time series

