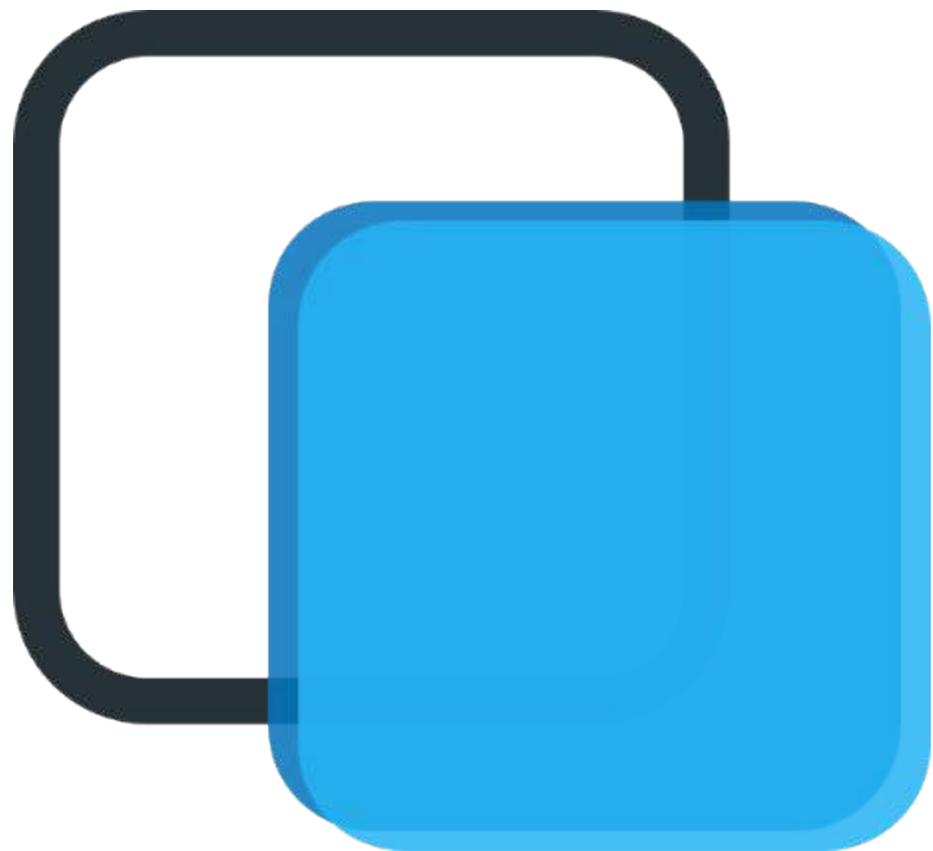


金融统计分析形成性考核册

XXXX
XXXX年XX月

目录

- 第1章 金融统计分析简介**
- 第2章 金融统计分析的主要方法（续）**
- 第3章 金融统计分析应用**
- 第4章 金融统计分析软件工具**



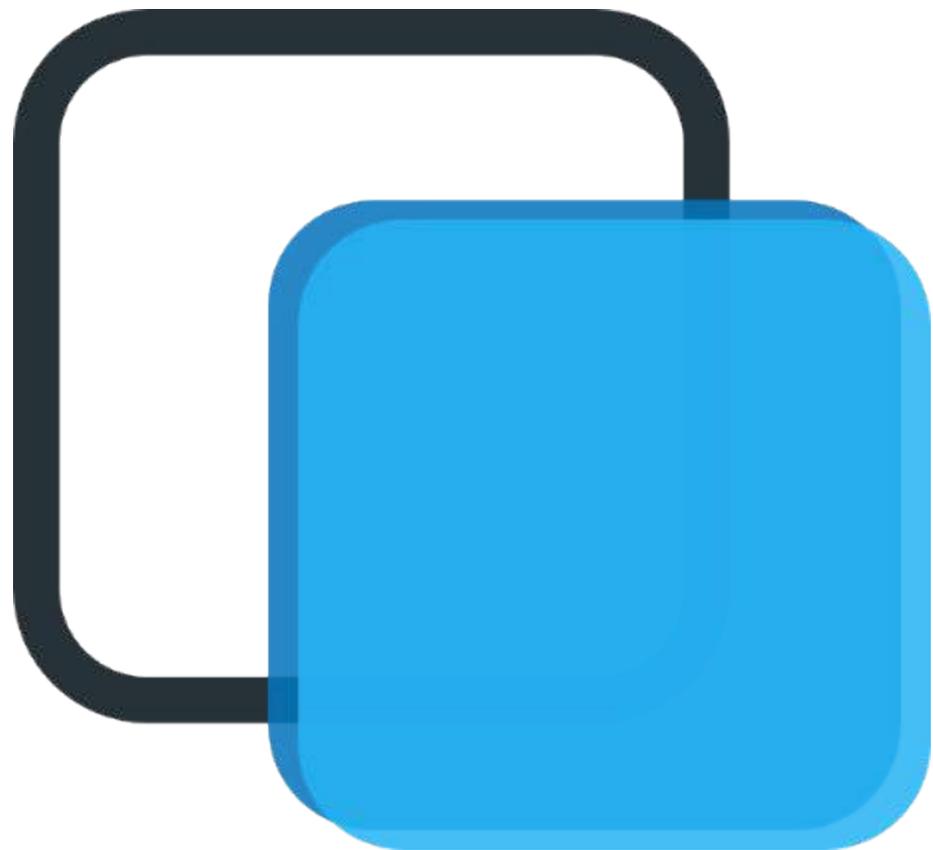


01

金融统计分析简介

金融统计分析的定义和重要性

金融统计分析是指运用统计学原理和技术对金融市场和金融工具进行的量化分析。它对于理解金融市场的运行机制、评估金融产品的风险与收益、制定投资策略等具有重要意义。



金融统计分析的应用领域

资产定价

通过统计分析确定金融资产的理论价格

投资组合优化

通过统计方法优化资产配置

风险管理

评估和管理金融产品的风险

市场微观结构分析

研究市场中交易和价格形成的统计规律

金融统计分析的主要方法

描述性统计分析

对金融数据进行概括和描述

风险和收益分析

评估金融产品的潜在风险和预期收益

推断性统计分析

基于样本数据对总体进行推断

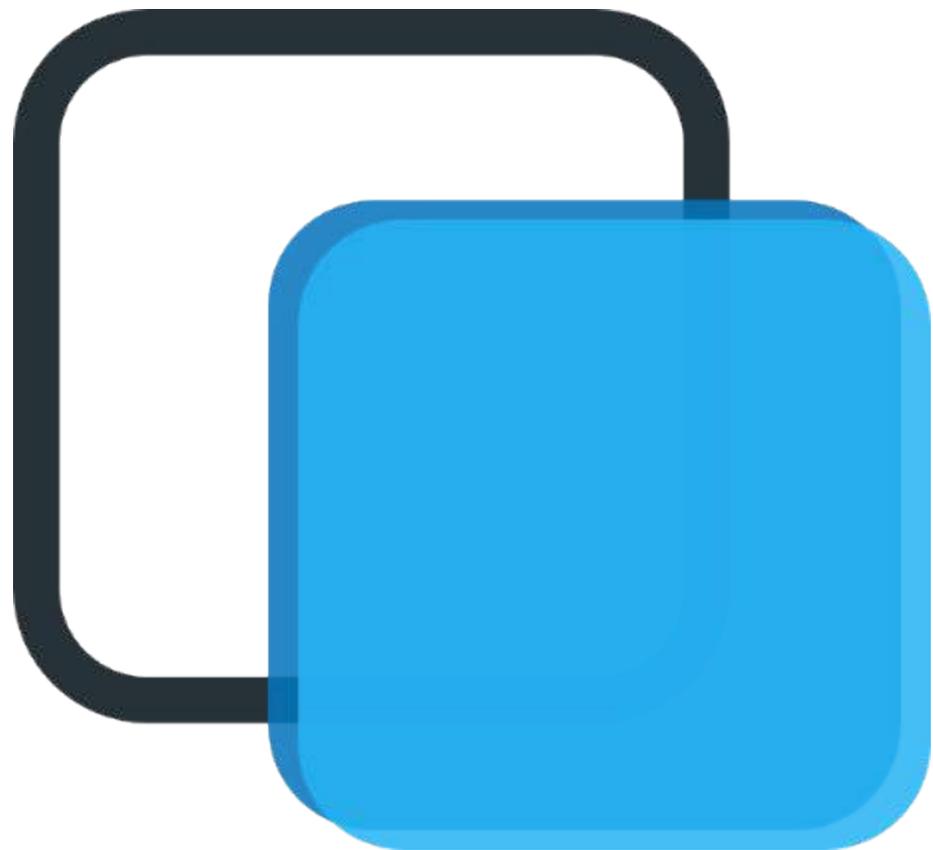


02

**金融统计分析的主要方法
(续)**

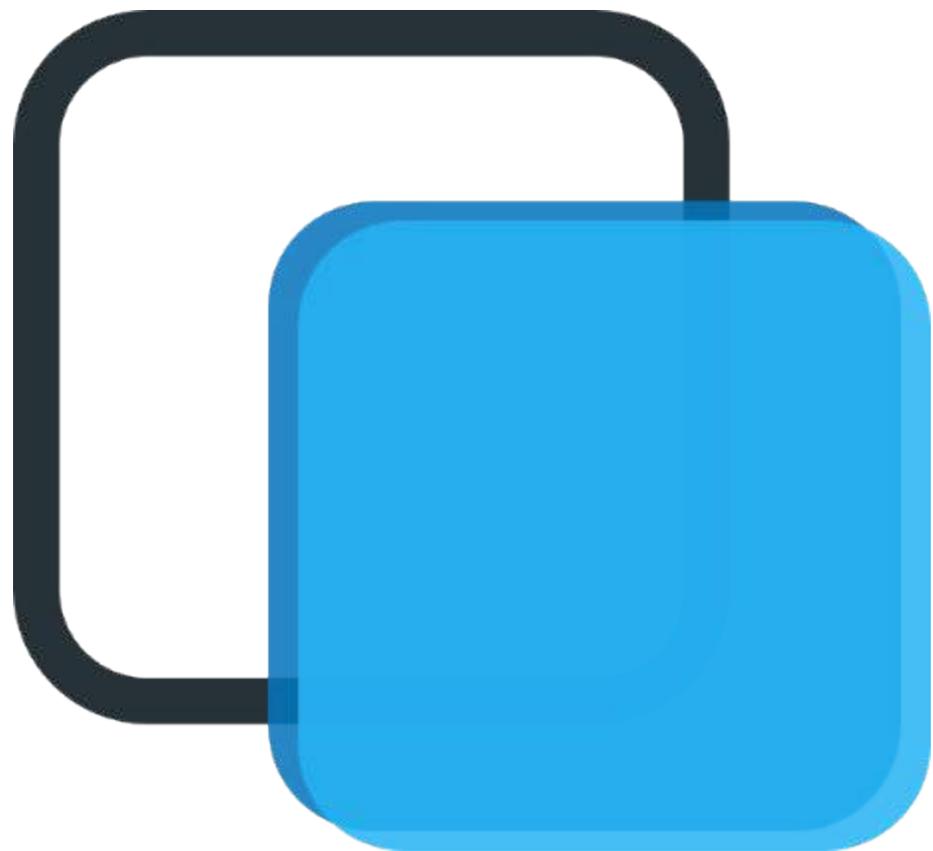
描述性统计分析

描述性统计分析关注于对数据的基本总结和展示，包括计算均值、中位数、标准差、相关系数等统计量，以便于对数据有一个直观的理解。



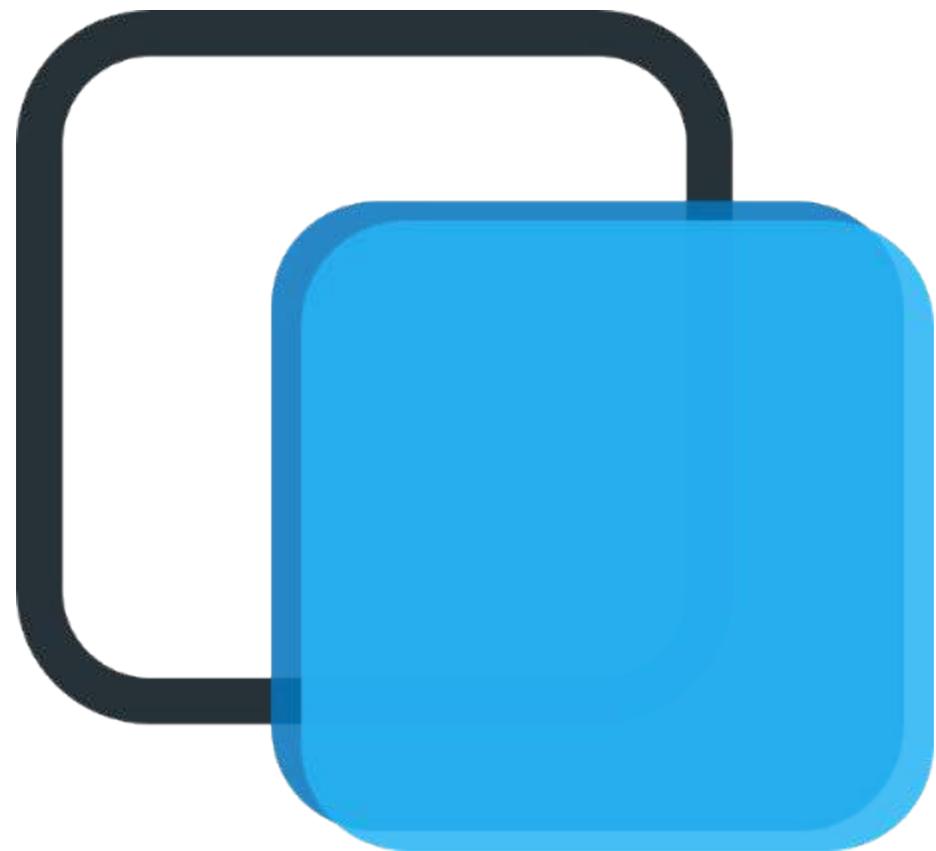
推断性统计分析

推断性统计分析通过样本来对总体特征进行估计，并进行假设检验，从而对金融市场和金融工具的性质和规律进行推断。



风险和收益分析

风险和收益分析是评估金融产品潜在风险和预期收益的过程。它包括对收益率分布、波动性、相关性等风险指标的统计分析。



金融统计分析的实际应用

01 股票市场分析

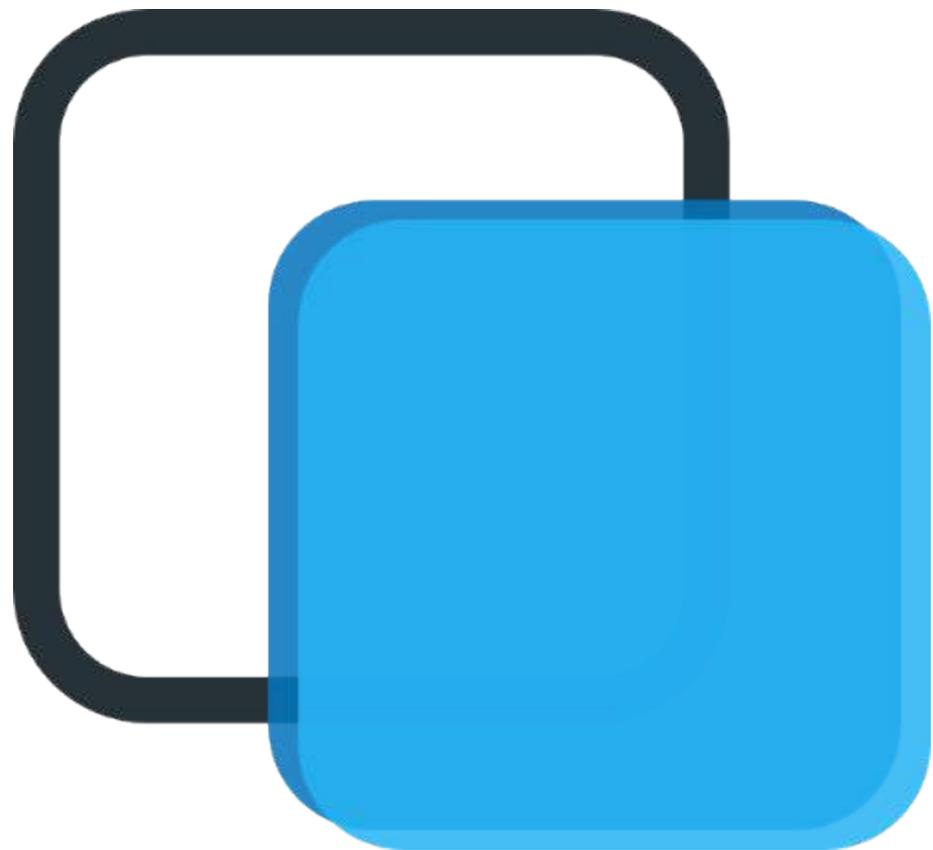
利用统计模型预测股票价格走势

02 信贷风险评估

通过统计方法评估贷款违约风险

03 期权定价

使用布莱克-舍尔斯模型计算期权价格



以上内容仅为本文档的试下载部分，为可阅读页数的一半内容。如要下载或阅读全文，请访问：
<https://d.book118.com/398107034067006107>