

# 课程大纲

课程编号： 02817080

课程名称： 统计学研究专题之一

周学时/总学时： 3/36

任课教师： 李辰旭

先修课程： 概率论，数理统计

授课对象： 统计学研究生

英文名称： **Topics in Statistical Research**

学 分： 2

开课学期： 2012 年秋

任课教师联系方式：

辅导、答疑时间：

## 一、 项目培养目标

学习目标 1 系统掌握从事学术研究所需要的专业知识及理论。

具体目标 1、系统掌握本学科基础知识及基本理论

具体目标 2、掌握本学科前沿知识和理论、具有足够的相关领域的知识

具体目标 3、熟练掌握本学科的研究方法

学习目标 2 具有从事创新性研究的能力；能够撰写并发表高质量的毕业论文和学术论文

具体目标 1、撰写高质量的毕业论文和学术论文

具体目标 2、具有高水平的分析能力和批判思维能力，能够创造性地解决问题

学习目标 3 具有宽阔的国际视野，能够与国际学者进行交流、合作的能力。

具体目标 1、具有优秀的口头交流和文字交流能力

具体目标 2、能够熟练地运用至少一门外语进行学术交流与沟通

学习目标 4 了解学术伦理，具有强烈的社会责任感、关注社会问题

具体目标 1、了解社会责任感的重要性

具体目标 2、了解学术生涯中的学术道德问题

具体目标 3、关注现实社会问题

## 二、课程概述

从方法角度出发本课程重点讨论随机模型的应用及其统计推断，从实际问题角度出发我们的注意力集中在金融计量与金融工程中的若干问题。

三、课程目标（包括学生所提高的技能要求），本课程目标如何服务于项目的培养目标

促进开展随机模型应用和统计推断，金融计量与金融工程的研究。

#### 四、内容提要及学时分配

内容包括：随机过程特别是连续时间模型的介绍（理论和数值方法），统计推断方法。我们以金融学中的问题为背景，构建随机模型，解决金融工程和金融计量中的各种问题。

#### 五、教学方式

讲座与讨论

#### 六、教学过程中 IT 工具等技术手段的应用

投影课件，程序演示

#### 七、教材

自编

#### 八、参考书目

自编

#### 九、教学辅助材料，如 CD、录影等

无

#### 十、课程学习要求及课堂纪律规范

希望同学积极参与讨论

#### 十一、学生成绩评定办法（需详细说明评估学生学习效果的方法）

平时 60%， 期末 40%