

<<系统多元决策与风险控制>>

图书基本信息

书名：<<系统多元决策与风险控制>>

13位ISBN编号：9787307047150

10位ISBN编号：7307047152

出版时间：2006-2

出版时间：武汉大学出版社

作者：刘伟

页数：413

版权说明：本站所提供下载的PDF图书仅提供预览和简介，请支持正版图书。

更多资源请访问：<http://www.tushu007.com>

<<系统多元决策与风险控制>>

内容概要

本书以定量分析为主要工具，针对社会、经济活动中的若干问题，将定量分析的基本方法与决策论的核心内容相结合，构成有一定特色的内容体系。

全书首先阐述了统计学的主要内容和方法，如描述统计、推断统计和非参数统计，介绍了相关分析、回归分析和多元分析技术，它们构成了本书中定量分析的基本内容。

本书对社会、经济发展中的若干风险问题开展讨论，并提出了一些新的方法和思想。

书中介绍了决策分析的基本内容和主要模型，结合实际案例，说明了实际应用中出现的主要问题和处理过程。

书中的案例主要以中国的实际问题为主。

为了便于论述和理解，书中省略了一些理论证明，但对某些易混淆的问题给出了较详尽的阐述。

本书可以作为高等院校经济学、管理学的本科生高年级和研究生的教材与教学参考书，也可供具有一定专业知识的管理人员和研究人员阅读和参考。

<<系统多元决策与风险控制>>

书籍目录

第一章 数据资料的描述分析 第一节 数据资料的整理 第二节 数据资料的位置特征 第三节 数据资料的差异特征
第二章 假设检验 第一节 假设检验的基本概念 第二节 总体均值的假设检验 第三节 总体比例的假设检验 第四节 总体方差的假设检验
第三章 非参数统计 第一节 χ^2 的平方检验 第二节 正负符号检验 第三节 带等级的正负符号检验 第四节 多个总体的检验 第五节 其他非参数统计方法
第四章 相关与回归分析 第一节 引言 第二节 相关分析 第三节 一元线性回归 第四节 多元线性回归
第五章 回归分析的扩展 第一节 非线性问题的线性化 第二节 异方差分析 第三节 序列自相关分析 第四节 多重共线性分析 第五节 随机解释变量 第六节 计量经济模型的建模步骤 第七节 虚变量回归分析
第六章 多元分析技术 第一节 聚类分析 第二节 判别分析 第三节 主成分分析 第四节 因子分析 第五节 典型相关分析
第七章 风险的基本理论 第一节 风险的概念 第二节 风险的类别 第三节 风险的产生及性质
第八章 社会经济的协调发展 第一节 人类社会的三种发展观 第二节 可持续发展理论的形成过程 第三节 可持续发展对资源开发的要求 第四节 资源的定义以及我国资源的现状
第九章 我国经济发展中的若干风险 第一节 证券市场风险的度量 第二节 VaR模型 第三节 企业经营风险预警指标体系设计及模型 第四节 上市公司绩效评价指数的多元分析 第五节 商业信用风险的量化分析
第十章 社会发展中的若干风险分析 第一节 多目标风险决策的协调 第二节 城市失业监测预警系统 第三节 社会发展指标体系 第四节 不可比信息的均衡调整 第五节 从扩大就业走向全面小康社会
第十一章 风险决策 第一节 基本概念 第二节 不确定型决策技术 第三节 风险型决策技术 第四节 效用理论在决策中的应用 第五节 主观概率在决策中的应用 第六节 序列决策 第七节 灵敏度分析
第十二章 随机时间序列线性模型预测方法 第一节 概述 第二节 平稳随机时间序列 第三节 平稳随机时间序列模型识别 第四节 随机时间序列模型的参数估计与检验 第五节 随机时间序列模型的预测方法 第六节 案例
第十三章 系统评价 第一节 系统评价概述 第二节 系统评价方法 第三节 系统评价的应用实例
第十四章 系统风险的控制分析 第一节 基本概念 第二节 经济系统的状态空间表示与求解 第三节 经济系统控制的应用 第四节 联立系统的动态控制分析参考文献

<<系统多元决策与风险控制>>

版权说明

本站所提供下载的PDF图书仅提供预览和简介，请支持正版图书。

更多资源请访问:<http://www.tushu007.com>