

《量化投资》

图书基本信息

书名：《量化投资》

13位ISBN编号：9787121247305

出版时间：2015-1-1

作者：李洋 (Faruto), 郑志勇 (Ariszheng)

页数：393

版权说明：本站所提供下载的PDF图书仅提供预览和简介以及在线试读，请支持正版图书。

更多资源请访问：www.tushu000.com

《量化投资》

内容概要

《量化投资：以MATLAB为工具》分为基础篇和高级篇两大部分。基础篇部分通过Q&A的方式介绍了MATLAB的主要功能、基本命令、数据处理等内容，使读者对MATLAB有基本的了解。高级篇部分分为14章，包括MATLAB处理优化问题和数据交互、绘制交易图形、构建行情软件和交易模型等内容，通过丰富实例和图形帮助读者理解和运用MATLAB作为量化投资的工具。《量化投资：以MATLAB为工具》的特色在于不仅仅满足理论学习的需要，更帮助读者边学边练，将理论和实践并重。

《量化投资：以MATLAB为工具》适合金融机构的研究人员和从业人员、进行量化投资的交易员、具有统计背景的科研工作者、高等院校相关专业的教师和学生以及对量化投资和MATLAB感兴趣的人士阅读。

《量化投资》

作者简介

李洋（Faruto），中国量化投资学会专家委员会成员，MATLAB技术论坛（www.matlabsky.com）联合创始人，北京师范大学应用数学硕士，先后就职于私募、期货公司、保险公司，从事量化投资相关工作。十年MATLAB编程经验，对机器学习、量化投资等相关领域有深入研究，已出版《MATLAB神经网络30个案例分析》和《MATLAB神经网络43个案例分析》等书籍。

郑志勇（Ariszheng），中国量化投资学会专家委员会成员，方正富邦基金产品总监，北京理工大学运筹学与控制论硕士，先后就职于中国银河证券、银华基金、方正富邦基金，从事金融产品研究与设计工作。十余年MATLAB编程经验，专注于产品设计、量化投资等相关领域的研究，尤其对结构化产品、分级基金产品有着深入的研究，已出版《运筹学与最优化MATLAB编程》和《金融数量分析：基于MATLAB编程》等书籍。

书籍目录

基础篇

第0章 N分钟学会MATLAB (60 < N < 180)

1

0.1 引言

1

0.2 基础知识

2

0.3 输入/输出

11

0.4 数据处理

13

0.5 数学运算

19

0.6 字符操作

26

0.7 日期时间

28

0.8 绘图相关

28

0.9 数学、金融、统计相关

35

0.10 其他

49

高级篇

第1章 基于MATLAB的优化问题

52

1.1 基于MATLAB的线性优化

52

1.2 基于MATLAB的非线性优化

58

1.3 优化工具箱参数设置

75

第2章 MATLAB与Excel的数据交互

84

2.1 数据交互函数

84

2.2 Excel-Link宏

90

2.3 交互实例

95

2.4 数据的平滑处理

97

2.5 数据的变换

108

第3章 MATLAB与数据库的数据交互

114

3.1 MATLAB实现

114	
3.2	系统数据源配置
123	
第4章	K线图及常用技术指标的MATLAB实现
127	
4.1	K线图的MATLAB实现
128	
4.2	常用技术指标的MATLAB实现
134	
第5章	基于MATLAB的行情软件
148	
5.1	基于MATLAB的行情软件使用介绍
150	
5.2	基于MATLAB的行情软件建立过程
154	
5.3	扩展阅读
165	
第6章	基于MATLAB的随机模拟
173	
6.1	概率分布
173	
6.2	随机数与蒙特卡罗模拟
180	
6.3	随机价格序列
187	
6.4	带约束的随机序列
191	
第7章	基于MATLAB的风险管理
195	
7.1	背景介绍
195	
7.2	MATLAB实现
198	
第8章	期权定价模型的MATLAB实现
217	
8.1	概述
217	
8.2	Black-Scholes定价模型及希腊字母研究
220	
8.3	二叉树定价模型研究
242	
8.4	BAW定价模型研究
254	
第9章	基于MATLAB的支持向量机（SVM）在量化投资中的应用
261	
9.1	背景介绍
261	
9.2	上证指数开盘指数预测
265	

9.3 上证指数开盘指数变化趋势和变化空间预测	272
9.4 基于C-SVM的期货交易策略	281
9.5 扩展阅读	297
第10章 MATLAB与其他金融平台终端的通信	301
10.1 DataHouse平台MATLAB接口介绍	301
10.2 Wind平台MATLAB接口介绍	318
第11章 基于MATLAB的交易品种选择分析	323
11.1 品种的流动性	324
11.2 品种的波动性	327
11.3 小结	330
第12章 基于MATLAB的交易品种相关性分析	331
12.1 背景介绍	331
12.2 MATLAB实现	334
12.3 扩展阅读	340
第13章 基于MATLAB的国内期货证券交易解决方案	344
13.1 国内期货柜台系统介绍	345
13.2 MATLAB对接CTP的各种方式	346
13.3 开发前准备	347
13.4 C#版对接原理	349
13.5 NET接口QuantBox版项目介绍	349
13.6 MATLAB对接期货接口介绍（QuantBox版项目）	351
13.7 MATLAB对接证券接口	364
第14章 构建基于MATLAB的回测系统	365
14.1 基于MATLAB的量化回测平台框架介绍	366
14.2 简单均线系统的MATLAB实现	

368

14.3 基于MATLAB的策略回测模板样例

373

14.4 其他基于MATLAB的回测平台展示

391

《量化投资》

精彩短评

- 1、被欺骗的感觉，完全是matlab 语法书加技术指标的matlab实现。
- 2、可以改名为技术指标的matlab实现。。。而且为什么能用数组的地方还要用循环！
- 3、本书相当多的内容，是从作者二“郑志勇”之前出版的书籍中引用的。通篇都是matlab函数的简单演示，意义甚微，内容松散，过时，配得上垃圾二字。
- 4、实用【2016.08】
- 5、其实不如直接上网找例子，对我来说看中文的金融材料似乎是更难，所以并没有翻几页。。。然后很多部分是在解释金融知识，并没有必要看它
- 6、在原理和实例方面都有点弱，可能书名和定位不太一致。比较多的篇幅讲matlab基础、和excel交互、和数据库交互、和其他金融平台终端通信等等，作为一般读者基本没有实操性，大段大段跳过。书配套的代码挺有价值的。
- 7、腊鸡
- 8、我擦，这书垃圾到要吐了居然还有7分！我就看了SVM部分，第一个例子全是各种bugs，简直是侮辱智商

《量化投资》

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:www.tushu000.com