

《量化投资》

图书基本信息

书名：《量化投资》

13位ISBN编号：9787301267916

作者：欧阳红兵

页数：374

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

本书主要特点一是面向投资实务，因此书中提供了大量案例，有些交易策略则是前沿研究成果的直接应用。另一个特点就是它是产学研结合的产物，作者分别来自华中科技大学和中泰国际控股有限公司，本书的架构既体现了诸数量化投资的当前进展，也充分考虑了证券交易的实际需要，大量的案例则在中泰国际的交易平台上进行过仿真测试，特别是书中交易的资金管理和风控的思想主要来自中泰国际的研究团队。

《量化投资》

作者简介

华中科技大学经济学院金融系副教授，香港城市大学金融学博士，主要研究方向为金融经济学，金融计量学，金融市场与监管，主持和参与国家自然科学基金和国家社会科学基金3项，出版专著《金融市场的流动性：理论及应用》，发表论文20余篇

书籍目录

第一章 绪论

- 一、电子和数量化交易的发展
- 二、数量化交易策略体系
- 三、交易系统及策略的开发

第二章 投资组合管理

- 第一节 投资组合理论
- 第二节 投资组合理论的应用
- 第三节 投资组合理论的扩展
- 第四节 资本资产定价模型和套利定价理论

第三章 量化选股策略

- 第一节 基本选股策略
- 第二节 基于聚类分析的选股策略
- 第三节 绝对动量选股策略

第四章 技术分析及择时策略

- 第一节 技术分析
- 第二节 高级技术分析
- 第三节 其他择时策略

第五章 统计套利

- 第一节 统计套利基本原理
- 第二节 基于协整分析的配对交易
- 第三节 基于共同趋势分析的配对交易
- 第四节 统计套利中的时间序列预测
- 第五节 基于协整的动态随机配对交易模型

第六章 高频交易

- 第一节 概述
- 第二节 做市商策略
- 第三节 信息模型
- 第四节 事件交易
- 第五节 基于马尔科夫链的高频价差套利策略

第七章 算法交易

- 第一节 概述
- 第二节 冲击驱动型算法
- 第三节 成本驱动型算法
- 第四节 机会导向算法

第八章 指令执行策略

- 第一节 价格形成与价格发现
- 第二节 执行策略及其影响因素
- 第三节 执行策略的实现方法
- 第四节 市场预测技术

第九章 资金管理

- 第一节 资金管理的概念及基本思路
- 第二节 资金管理基本方法
- 第三节 止损与资金管理

第十章 交易系统及研究实例

- 第一节 交易系统构建
- 第二节 研究实例

参考文献

后记

《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