

《算法交易：制胜策略与原理》

图书基本信息

书名：《算法交易：制胜策略与原理》

13位ISBN编号：9787111556925

作者：[美] 欧内斯特·陈 (Ernest P. Chan)

页数：232

译者：高闻西,黄蕊

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

《算法交易：制胜策略与原理》

内容概要

本书是一本引人入胜、信息量大、覆盖各类交易策略的图书。无论个人投资者，还是机构投资者，都可以借鉴和使用其中的策略。本书中的策略大致可分为均值回归系统和动量系统两大类。书中不仅介绍了如何使用每种类别的交易策略，更解释了各种策略之所以有效的原因。本书始终以简单、线性的交易策略为重心，因为复杂的交易策略容易受到过度拟合及数据窥探的侵害。数学和软件是算法交易的两条腿。本书用到了一定程度的数学知识，使其对各种金融概念的讨论更加清晰准确。另外，书中还加入了很多使用MATLAB代码编程的说明性示例，这些示例可以在本书的网站上下载。总体而言，本书涉及的主要内容包括：

选择正确的自动执行平台及回测平台，以减少或消除算法交易策略中易犯的错误；

交易均值回归的投资组合的简单技能（线性、布林带、卡尔曼滤波）以及在测试和策略中使用什么数据形式（实际价格、对数价格、或是比例）更好；

交易股票、ETF、外汇及进行期货跨期套利、跨市套利等所用的均值回归策略；

股票及期货的动量的四大推动力，以及可以提取时间序列及横截面动量的策略；

基于高频交易、委托单动向、杠杆ETF、新闻事件和情绪的新型动量策略；

基于凯利公式的风险及资金管理，加入了作者个人风险管理的经验。

《算法交易：制胜策略与原理》

作者简介

欧内斯特·陈是资本管理有限责任公司中的一位具有QTS资质（Qualification Test Specification—质量检定规范）的从业人员。自1997年以来，他就职于各种投资银行（如摩根士丹利、瑞士信贷和Maple）和对冲基金公司（如Mapleridge基金、Millennium Partners基金和MANE基金）。他在康奈尔大学获得物理学博士学位，在加入金融行业之前，他是IBM之人类语言技术组的成员。同时，他是指数型（EXP）资本管理有限责任公司的创始人和主要负责人，该投资公司的总部位于芝加哥。另外，欧内斯特还撰写了与量化交易有关的书籍，比如《量化交易》。

书籍目录

前言

第1章 回测及自动化的执行系统

- 1.1 回测的重要性 / 2
- 1.2 回测过程中普遍存在的误区 / 4
- 1.3 统计学在回测程序上的应用：假设检验 / 19
- 1.4 交易策略于何时无须被回测 / 25
- 1.5 回测系统对相应收益率具有预测功能吗 / 27
- 1.6 对回测系统以及自动化运行平台的抉择 / 28

本章要点 / 41

第2章 均值回归模式的基本要义

- 2.1 均值回归与相应的平稳性 / 47
- 2.2 平稳测试之后的协整 / 56
- 2.3 均值回归策略的利弊分析 / 66

本章要点 / 68

第3章 均值回归策略的运行机制

- 3.1 应用价差、价差的取对数或相应比率所进行的配对交易 / 70
- 3.2 布林带线 / 77
- 3.3 相应的头寸增持功能可行吗 / 79
- 3.4 动态线性回归相关的卡尔曼过滤法则 / 82
- 3.5 卡尔曼过滤法则相关的做市商模型 / 89
- 3.6 数据误差的危险性 / 91

本章要点 / 92

第4章 股票与ETF基金的均值回归模式

- 4.1 股票配对交易的难点 / 96
- 4.2 ETF基金的配对交易（或三重ETF基金交易） / 98
- 4.3 日间均值回归交易策略：缺口买入模式 / 101
- 4.4 ETF基金与成分股之间的套利模式 / 105
- 4.5 跨行业的均值回归交易策略：线性多-空模式 / 111

本章要点 / 115

第5章 货币交易与期货交易相关的均值回归的交易策略

- 5.1 交叉货币对交易 / 117
- 5.2 货币交易中的展期利息问题 / 122
- 5.3 期货之跨期套利的交易 / 124
- 5.4 期货之跨市场（区域）套利 / 137

本章要点 / 141

第6章 日间动量型交易策略

- 6.1 时间序列型动量交易策略的检验模式 / 144
- 6.2 时间序列的交易策略 / 147
- 6.3 从期货与ETF基金之间的套利交易中攫取连续收益 / 152
- 6.4 横向型动量交易策略 / 156
- 6.5 动量交易策略的优势与劣势 / 163

本章要点 / 167

第7章 盘中动量型交易策略

- 7.1 “敞口”交易策略 / 169
- 7.2 信息驱动的动量交易策略 / 171
- 7.3 ETF基金的杠杆交易策略 / 177
- 7.4 高频交易策略 / 179

《算法交易：制胜策略与原理》

本章要点 / 184

第8章 风险管理

8.1 最优化的杠杆模式 / 186

8.2 投资组合相关的风险比例之固化模式（CPPI模式） / 198

8.3 止损机制的解析 / 200

8.4 风险指标 / 202

本章要点 / 205

结论

参考文献

作者简介

网站简介

《算法交易：制胜策略与原理》

精彩短评

- 1、适合理工科背景的人行做交易实战。
- 2、翻译应该多用点心

《算法交易：制胜策略与原理》

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