

# 《量化投资分析》

## 图书基本信息

书名：《量化投资分析》

13位ISBN编号：9787509635330

作者：陈工孟

页数：570

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](http://www.tushu000.com)

# 《量化投资分析》

## 内容概要

《量化投资分析》内容简介：量化投资区别于定性投资的鲜明特征就是模型，对于量化投资中模型与人的关系，大家也非常关心比较关心。我打个比方来说明这种关系，我们先看一看医生治病，中医与西医的诊疗方法不同，中医是望、闻、问、切，最后判断出的结果，很大程度上基于中医的经验，定性程度上大一些；西医就不同了，先要病人去拍片子、化验等，这些都要依托于医学仪器，最后得出结论，对症下药。医生治疗病人的疾病，投资者治疗市场的疾病，市场的疾病是什么？就是错误定价和估值，没病或病得比较轻，市场是有效或弱有效的；病得越严重，市场越无效

## 书籍目录

- 第一篇概述与理论篇
    - 揭开量化投资的神秘面纱
    - 第一章金融量化投资概述
      - 第一节量化投资前沿
      - 第二节量化投资与基本面投资
      - 第三节行为金融学
      - 第四节行为金融学与量化投资
    - 本章小结
    - 本章习题
  - 第二章金融信息处理技术
    - 第一节金融信息概述
    - 第二节新闻信息分析技术与应用
    - 第三节金融信息处理基础技术
  - 本章小结
  - 本章习题
- 第二篇模型与策略篇
    - 探索量化投资的内在规律
    - 第三章量化投资模型构建
      - 第一节收益预测模型
      - 第二节波动性度量模型
      - 第三节冲击成本模型
      - 第四节基于高频数据的市场微观模型
    - 本章小结
    - 本章习题
  - 第四章常见量化投资策略
    - 第一节量化投资策略构建
    - 第二节无风险套利策略
    - 第三节统计套利
    - 第四节股指平衡策略
    - 第五节期权套利策略
    - 第六节可转债套利策略
    - 第七节目定收益套利策略
    - 第八节全球宏观策略
    - 第九节事件驱动策略
    - 第十节收购并购策略
    - 第十一节多策略与基金煲
    - 第十二节高频交易
  - 本章小结
  - 本章习题
- 第三篇数据与工具篇
  - 展示量化投资的实现手段
  - 第五章常见量化投资数据源
    - 第一节基本面数据源
    - 第二节历史高频数据源
    - 第三节实时数据源
    - 第四节数据提取方法
    - 第五节数据提供商

本章小结

本章习题

第六章常见量化投资工具

第一节量化投资策略研究平台

第二节量化投资交易系统

第三节量化投资绩效分析工具

第四节量化投资风险控制方法

本章小结

本章习题

第四篇应用与实例篇

——分享量化投资的实战经验

第七章量化投资基金组建与运营

第一节量化投资基金组建

第二节量化投资基金运营

第三节量化投资基金团队

本章小结

本章习题

第八章量化投资策略开发实例

第一节期货投资策略实例

第二节股票投资策略实例

第三节跨市场策略实例

本章小结

本章习题

附录

附录1常用量化投资数据

附录2量化投资研究平台入门与使用

参考文献

# 《量化投资分析》

## 精彩短评

1、看起来像是培训资料，罗列了不少金融计量的模型。比丁鹏的那本量化强一点，起码有案例有代码。就是做个参考书翻翻吧。

# 《量化投资分析》

## 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](http://www.tushu000.com)