

# 《量化投资与对冲基金入门（量化投资）》

## 图书基本信息

书名：《量化投资与对冲基金入门（量化投资与对冲基金基础入门必读图书）》

13位ISBN编号：9787121222922

出版时间：2014-4-1

页数：241

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)

# 《量化投资与对冲基金入门（量化投资）》

## 内容概要

《量化投资与对冲基金入门》介绍了量化投资与对冲基金的基础知识，包括量化投资的概念、主要策略类型：相对价值策略、宏观因素策略、高频交易与算法交易等，对冲基金的原理、组织形式、法律障碍、运作模式，以及十大对冲基金案例等。通过这些基础知识的介绍，力图让读者对量化投资与对冲基金这种新的资产配置工具有一个通俗性的了解。

《量化投资与对冲基金入门》读者对象为对量化投资与对冲基金感兴趣的入门级人士，包括机构投资者、资产管理公司总监以上人员、市场营销人员、渠道经理等。

# 《量化投资与对冲基金入门（量化投资）》

## 作者简介

丁鹏，博士，中国量化投资学会理事长

著述的《量化投资——策略与技术》是国内第一本有关量化投资策略方面的专著，已经成为国内宽客的必读教材，同时还是《量化投资与对冲基金》副主编，《第一财经 解码财商》解码人。

2001年毕业于上海交通大学计算机系，获得工学博士学位并留校任教，是国际知名的人工智能专家，IEEE（国际电子电气工程师协会）会员，AFA（美国金融学会）会员，国际金融工程师协会会员。

2008年加入东方证券金融衍生品总部，从事量化投资研究与交易，开发的D-Alpha交易系统在实战中获得了持续稳健的盈利。

2012年加入方正富邦基金，从事量化对冲产品的设计与投资管理。

2014年3月加盟东航金控，从事对冲基金资产管理。

## 书籍目录

### 第1章 量化投资介绍

- 1.1 量化投资基本概念
- 1.2 量化投资与有效市场假说
- 1.3 量化投资的优势
- 1.4 量化投资与传统投资
- 1.5 量化投资的价值
- 1.6 量化投资的内容
- 1.7 量化投资的历史
- 1.8 量化投资的理论基础
- 1.9 量化投资的趋势

### 第2章 对冲基金介绍

- 2.1 对冲基金定义
- 2.2 对冲基金的特征
- 2.3 业绩持续性
- 2.4 对冲基金运作
- 2.5 规模及收益
- 2.6 世界前十大对冲基金
- 2.7 对冲基金投资者
- 2.8 对冲基金简史

### 第3章 对冲基金主要分类

- 3.1 美国证监会的分类
- 3.2 对冲基金主要策略
- 3.3 股票对冲策略
- 3.4 事件驱动策略
- 3.5 宏观因素策略
- 3.6 相对价值策略
- 3.7 区域投资策略

### 第4章 全球十大对冲基金策略

- 4.1 十大对冲基金
- 4.2 桥水基金
- 4.3 摩根大通资产管理
- 4.4 齐夫资本
- 4.5 贝莱德
- 4.6 鲍波斯特集团
- 4.7 保尔森公司
- 4.8 安祖高顿公司
- 4.9 文艺复兴科技
- 4.10 埃利奥特
- 4.11 法拉龙资本

### 第5章 相对价值策略

- 5.1 阿尔法策略类型
- 5.2 多因子
- 5.3 风格轮动
- 5.4 行业轮动
- 5.5 资金流
- 5.6 动量反转
- 5.7 一致预期

5.8筹码选股

第6章宏观因素策略

6.1宏观因素策略类型

6.2趋势择时策略

6.3市场情绪择时

6.4时变夏普率

6.5Hurst指数择时

6.6SVM分类择时

第7章高频交易

7.1高频交易概念

7.2流动性回扣交易

7.3猎物算法交易

7.4自动做市商策略

7.5高频交易的新发展

7.6交易速度

7.7短期预测交易

第8章期指套利与商品套利

8.1期指套利概念

8.2期指套利策略

8.3现货指数复制

8.4结算日套利

8.5跨期套利原理

8.6冲击成本

8.7保证金管理

8.8商品套利概念

8.9常见套利组合

8.10非常状态处理

第9章算法交易

9.1算法交易概念

9.2被动型算法交易类型

9.3标准VWAP算法

第10章量化投资理论

10.1主要基础理论

10.2人工智能

10.3数据挖掘

10.4小波分析

10.5支持向量机

10.6分形理论

10.7随机过程

第11章主要IT系统

11.1量化投资IT架构

11.2IT系统的作用

11.3MATLAB语言

11.4R语言

11.5大智慧DTS系统

11.6天软量化平台

11.7国泰安宽平台

11.8名策多因子分析系统

11.9开拓者分析系统

11.10恒生策略交易系统（ITP）

11.11MC分析系统

11.12MT5外汇交易系统

第12章对冲基金组织架构

12.1主要架构

12.2财务杠杆

12.3外部监管

12.4内部控制

12.5对冲基金的新发展

第13章国内对冲基金发展

13.1中国基金对冲时代

13.2对冲基金投资应用

13.3国内对冲基金面临的挑战

附录A策略组合模型

附录B访谈录

后记

参考文献

# 《量化投资与对冲基金入门（量化投资）》

## 精彩短评

- 1、其实挺好的，很适合我这种level的，没读完，因为后面实在我没水平，以我的见识暂时写不出感悟好可惜啊。这本书我不会再读，它只是阐述没让我搞懂.即使有些观点还是蛮有意思.
- 2、跳读。对对冲行业的简介
- 3、丁鹏是个逗比 见完人再看书全是违和感 =。 =
- 4、前半部分内容是比较框架性的，反而是后半部分的附录AB参考价值比较大
- 5、不能大段大段的抄啊，尤其平台介绍什么的。还有投资策略一章有材料堆砌感觉。
- 6、确实是入门的书，每个概念就1、2百字介绍，大概翻翻差不多还了
- 7、第2页，作者对我国市场有效性的阶段划分也太随意了吧。还说我国从2010年之后就进入了半强有效市场阶段，这玩笑开得也太大了。今年年初还有朋友推荐黑色系，因为煤炭已经跌到成本了没有办法再跌了，果不其然动力煤期货从年初到现在已经翻倍（请注意期货还是有杠杆的）。2016年基本面分析还相当有效的情况下，作者认为我国2010年进入了半强有效市场阶段了。
- 第4页，写到可口可乐是价值投资。你还想我吐槽啥？我还能吐槽啥？这都是最基础的，一个对金融有兴趣的高中生，但凡读过一两本金融书籍，都知道巴菲特当年买可口可乐是因为该公司的成长性。作者居然认为是价值投资。大哥，不是巴菲特的投资都是价值投资。不过要肯定作者的写作能力，词藻华丽，对得起作者的博士头衔。再一看作者的履历，原来是XXX学会理事长。官养文人。
- 8、不读了，这种书，我还是看原文的好，不相信国人的治学态度啊
- 9、入门概念简介。
- 10、真心不推荐花钱买这个书。这个书完全不适合外行作为入门读物。从阅读角度看，行文不流畅。名词经常先使用，两页之后再出现解释。毫无逻辑科研。作者自己也说了是以大学讲义作为基础。然后也并没有科学的严谨性，譬如所有图都没有图例，分不清线是哪对哪；引用完全没有标注。整书而言，跟读维基百科没有区别。
- 11、对于一些概念化东西的成像还是有点帮助的
- 12、so naive

# 《量化投资与对冲基金入门（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](http://www.tushu000.com)