

# 《量化股票投资:技术与策略》

## 图书基本信息

书名：《量化股票投资:技术与策略》

13位ISBN编号：9787561545304

出版时间：2015-1-1

作者：（美国）弗兰克·J.法博兹（Frank J.Fabozzi），（美国）塞尔吉奥·M.福卡尔迪（Sergio M.Focardi），（美国）彼特·N.科姆（Petter N.Kolm）

页数：374

译者：赵胜民

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)

# 《数量化股票投资:技术与策略》

## 内容概要

数量化股票投资组合管理是投资管理的一个基本组成部分。投资管理的基本原理早在20世纪50年代哈里·马可维茨的开创性工作中就被提出了。由于他的这一工作，马可维茨在1990年被授予诺贝尔经济学奖。马可维茨这一思想的内涵被证明是极其丰富的。由它发展出了一个全新的研究领域，随着成本低廉、功能强大的计算机的普及，它在金融学的多个领域中都得到了重要的应用。

## 书籍目录

### 第一章导论

数理金融礼赞

数量化股票管理的应用研究

为什么实施数量化过程？

进入壁垒

数量化股票投资的展望

### 第二章金融计量经济学：线性回归

历史记载

协方差和相关系数

回归、线性回归和投影

多变量回归

分位数回归

回归诊断

回归的稳健性估计

分类回归树

总结

### 第三章金融计量经济学：时间序列

随机过程

时间序列

稳定的向量自回归过程

单整变量和协整变量

稳定的向量自回归（VAR）模型的估计

滞后期的估计

残差的自相关性以及分布性质

平稳的自回归分布滞后模型

非平稳的VAR模型估计

利用典型相关方法估计

利用主成分分析法估计

利用伴随矩阵特征值估计

金融学中的非线性模型

因果关系

总结

### 第四章金融建模中常见的错误

理论与工程

工程学与理论科学

工程学与金融产品设计

投资组合管理的学习方法、理论方法以及混合方法

样本偏差

平均值的偏差

从大型数据集中进行抽样的错误

模型的时间聚集性以及数据频率选择中的错误

模型风险及其规避方法

总结

### 第五章因素模型及其估计

因素的概念

静态因素模型

因素分析与主成分分析

- 为什么使用收益的因素模型
- 收益的近似因素模型
- 动态因素模型
- 总结
- 第六章基于因素的交易策略工：因素的构建和分析
  - 基于因素的交易
  - 构建基于因素的交易策略
  - 交易策略的风险
  - 因素的理想特性
  - 因素的来源
  - 基于公司特征的因素构建
  - 数据处理
  - 因素数据的分析
  - 总结
- 第七章基于因素的交易策略：横截面模型及交易策略
  - 因素溢价评估的横截面方法
  - 投资组合分类法
  - 因素模型
  - 因素表现的评估
  - 基于因素的交易策略的模型构建方法
  - 回溯测试
  - 因素交易策略的回溯测试
  - 总结
- 第八章投资组合最优化：基本理论与实践
  - 均值—方差分析：概述
  - 均值—方差最优化的经典框架
  - 包含无风险资产的均值—方差最优化
  - 均值—方差最优化中使用的输入的估计：期望收益和风险
  - 总结
- 第九章投资组合最优化：Bayes技术和Black—Litterman模型
  - 在均值—方差优化中遇到的实际问题
  - 收缩估计
  - Black—Litterman模型
  - Black—Litterman模型的推导
  - 总结
- 第十章鲁棒投资组合优化
  - 鲁棒均值—方差优化模型
  - 收益协方差矩阵估计中的不确定性
  - 鲁棒均值—方差投资组合最优化在实践中的应用
  - 关于鲁棒投资组合最优化模型的一些实践的评论
  - 总结
- 第十一章交易成本与交易执行
  - 交易成本的分类
  - 流动性与交易成本
  - 市场冲击的度量与实证发现
  - 市场冲击的预测与建模
  - 考虑交易成本的资产配置模型
  - 投资组合综合管理：在期望收益和投资组合风险之外
  - 总结

第十二章 投资管理与算法交易

市场冲击与指令记录簿

最优执行

冲击模型

流行的算法交易策略

接下来是什么？

关于高频军备竞赛

总结

索引

# 《数量化股票投资:技术与策略》

## 精彩短评

- 1、对多因子模型有一个比较正统的介绍，可以起到入门作用
- 2、法博齐的风格就是太学术了，一直在唠叨各种参数估计，重点的因素回测篇幅却草草带过，关于Blacklitterman的推导倒是比较详细

# 《数量化股票投资:技术与策略》

## 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)