

<<量化投资的文艺复兴之道>>

图书基本信息

书名：<<量化投资的文艺复兴之道>>

13位ISBN编号：9787511246080

10位ISBN编号：7511246087

出版时间：2013-5

出版时间：光明日报出版社

作者：路阳

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：<http://www.tushu007.com>

## <<量化投资的文艺复兴之道>>

### 内容概要

《量化投资的文艺复兴之道:基于群体行为分析的量化投资思想与方法》是一本知行合一、通俗易懂的书，作者多年研发不倒翁量化投资交易系统的思想与经验总结。国内系统阐述群体行为金融理论的著作，首部阐述群体行为金融理论指导下的量化投资思想于方法的著作。

## <<量化投资的文艺复兴之道>>

### 书籍目录

#### 第1章一个金工老兵的心路历程

##### 第一节一个草率的金融工程梦

##### 第二节数理金融？

##### 行为金融？

##### 还是数据挖掘？

##### 第三节做策略还是做量化

##### 第四节Run！

##### Run！

##### Run！

#### 第2章量化投资从炼金术走向文艺复兴

##### 第一节量化投资是一门科学吗？

##### 第二节宽客还是炼金术士

##### 第三节文艺复兴科技的秘密

##### 第四节再议宽客与炼金术士

##### 第五节量化投资的核心力量

##### 第六节国内量化投资的现状与问题

##### 第七节《金融模型研发者宣言》

#### 第3章量化投资第一步认识市场

##### 第一节正确认识市场的意义

##### 第二节市场的假说的批判

##### 第三节具有文艺复兴色彩的行为金融

##### 第四节投资大师的市场观

##### 第五节探求股市的价值真相

##### 第六节逐本溯源看市场的博弈本质

#### 第4章量化投资的关键—深刻理解市场

##### 第一节股市群体的一般行为特征分析

##### 第二节有望获得诺贝尔经济学奖的群体行为资产定价理论之定价模型

##### 第三节小盘股效应的群体行为定价理论解析

##### 第四节群体行为资产定价模型的应用

##### 第五节有望获得诺贝尔经济学奖的群体行为资产定价理论之群体行为周期

##### 第六节从赢家看专业投机原理

#### 第5章量化投资的方法论——群体行为资产组合管理理论

##### 第一节单一资产的管理——择时模型

##### 第二节多元资产的选择

##### 第三节投资组合的优化配置

##### 第四节投资组合的风险评估与管理

##### 第五节组合管理的业绩归因分析——Luyang业绩归因模型

#### 第6章量化投资的实践（上）——建模篇

##### 第一节建模的思想与方法论

##### 第二节数据探索和数据变换

##### 第三节量化投资建模常用数学方法介绍

##### 第四节模型的测试和优化

## <<量化投资的文艺复兴之道>>

### 第7章量化投资的实践（中）——系统篇

#### 第一节交易系统的组成与特征

#### 第二节量化投资交易系统的核心原理

#### 第三节量化投资交易系统设计最高指导原则

#### 第四节交易系统的开发流程

#### 第五节系统交易的执行和维护

#### 第六节系统的评估与评价

### 第8章量化投资的实践（下）——产品篇

#### 第一节量化投资绝对收益产品设计

#### 第二节三款创新型指数产品设计

#### 第三节产品设计的心得体会

### 第9章脚踏实地仰望星空

#### 第一节大资产管理时代诚信创造价值

#### 第二节特种宽客吉捷岛

#### 第三节投资哲学与生活哲学

#### 第四节仰望星空，如果咱真的有了钱

#### 附录本书封面设计说明

<<量化投资的文艺复兴之道>>

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:<http://www.tushu007.com>