

数量化股票投资:技术与策略



[数量化股票投资:技术与策略_下载链接1](#)

著者: (美国) 弗兰克·J.法博兹 (Frank J.Fabozzi)

出版者:厦门大学出版社

出版时间:2015-1-1

装帧:平装

isbn:9787561545300

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。

作者介绍:

弗兰克·J. 法博兹，耶鲁大学管理学院金融实务方向的教授和卡尔斯鲁厄大学统计、计量与数理金融学院的合聘教授，耶鲁大学金融国际中心和美国普林斯顿大学运筹与金融工程系咨询委员会的成员。2007年获得了CFA协会授予的C.Stewart Sheppard奖。著有《金融学中的贝叶斯方法》（2008）、《金融计量学：从基础到高级的建模技术》(2007)等图书。

塞尔吉奥·M.福卡尔迪，尼斯高等商学院的金融学教授和总部设在巴黎的天祥集团咨询公司的创办合伙人，《投资组合管理》杂志编辑委员会的成员。

彼特·N. 科姆，纽约大学柯朗数学科学研究所金融数学硕士项目的副主任和副教授以及总部位于纽约的Heimdall集团金融咨询有限责任公司的创办合伙人。

赵胜民，南开大学金融学系金融工程学教研室主任、金融工程专业博士生导师。天津大学系统工程研究所系统工程专业博士毕业。曾就职于天津大学管理学院金融工程研究中心。研究领域为金融工程、线性控制系统、生存理论。讲授“微分方程”、“随机过程”、“金融经济学”、“金融工程”等课程。

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 I：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 II：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

工程学与金融产品的设计

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 II：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
鲁棒均值一方差优化模型
收益协方差矩阵估计中的不确定性
鲁棒均值一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
• • • • • (收起)

[数量化股票投资:技术与策略 下载链接1](#)

标签

量化

投资

金融工程

时间序列

金融科技

金融

quant

finance

评论

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的推导倒还是比较详细

正 给力

完完全全的教科书，有卵用哦

理论性的比较多，不怎么好看

我能说用处不大吗

对多因子模型有一个比较正统的介绍，可以起到入门作用

[数量化股票投资:技术与策略_下载链接1](#)

书评
