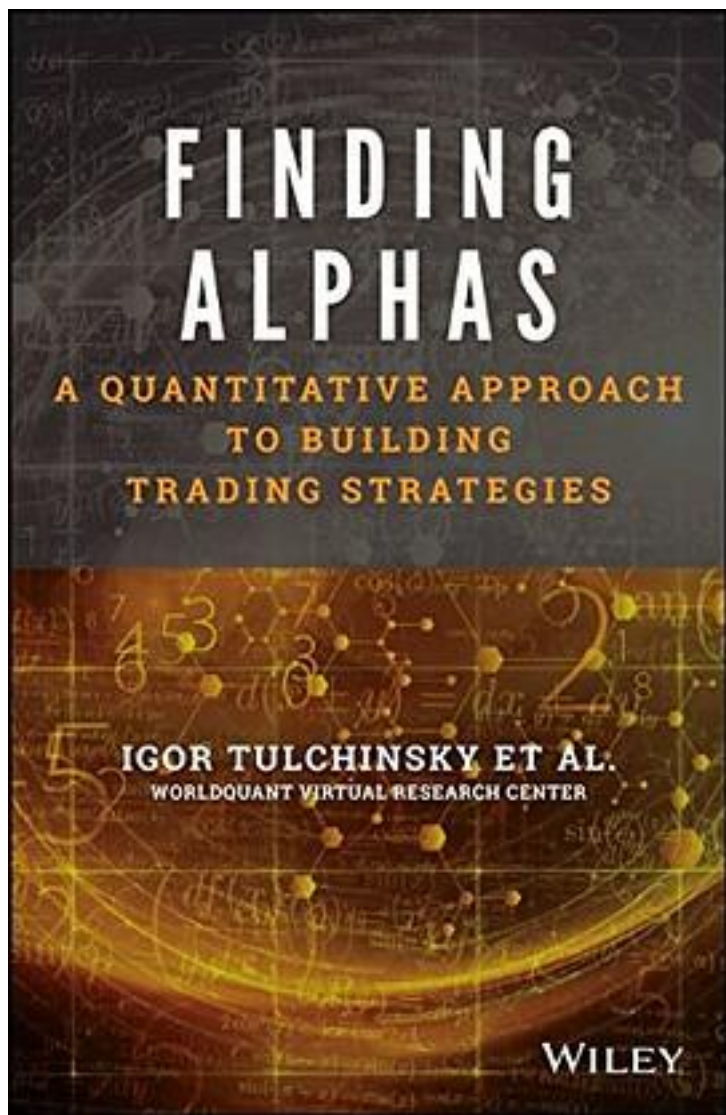


Finding Alphas



[Finding Alphas 下载链接1](#)

著者:Igor Tulchinsky

出版者:Wiley

出版时间:2015-10-26

装帧:Hardcover

isbn:9781119057864

作者介绍:

目录:

[Finding Alphas_下载链接1_](#)

标签

金融

量化交易

量化

quant

投机

交易

trading

Finance

评论

因为要做review，读的时候还做了笔记。看到low-pass filter的时候去重新看了下傅里叶变换。重来一遍的话我一定好好学习。本也可以做神龙大侠的罢。

可以大致对量化在干啥有个了解。

world

quant大佬写的书。期待从中找到现成的profitable策略的话看这本书大概会失望，不过从这本书中可以了解到量化挖因子的步骤和要注意的方方面面。

最近参加了世坤的比赛，对风险中性的Alpha套利有了新的认识，以前只单纯的认为Alpha仅仅是找超额收益。简而言之，做多看涨的，做空看跌的，同时保持头寸为零，这样只要存在Alpha（由于投资者自身『能力』而带来相对基准的超额收益，换句话说市场存在某些无效性），就能空手套白狼的印钱了。如果你对这样的策略怀有疑问，先抛开实际交易执行中的问题，但至少在我们的回测当中还是能够发现不少简洁有效的策略。这本书涉及范围还是蛮广的，但不够深。有几篇关于如何组合多个alpha，设计alpha组合的要点，风险鲁棒性的讨论还是蛮有价值的。特别是一个alpha在广为人知（进一步广为利用）的时候，不仅市场容量下降导致收益低，同时带来了很大风险。研究多因子的可以看看这本书。

这本书隔了半年的时间，看了两遍，收获很多，算是quant的入门书吧，Tulchinsky写的paper很有哲学深度~

书是由一篇篇不同作者的小短文构成，书的四分之一是worldquant的广告，唯一一篇比较有内容的是一个篇关于alpha的refine的文章，因为有例子，其他章节都是入门科普读物

[Finding Alphas 下载链接1](#)

书评

[Finding Alphas 下载链接1](#)