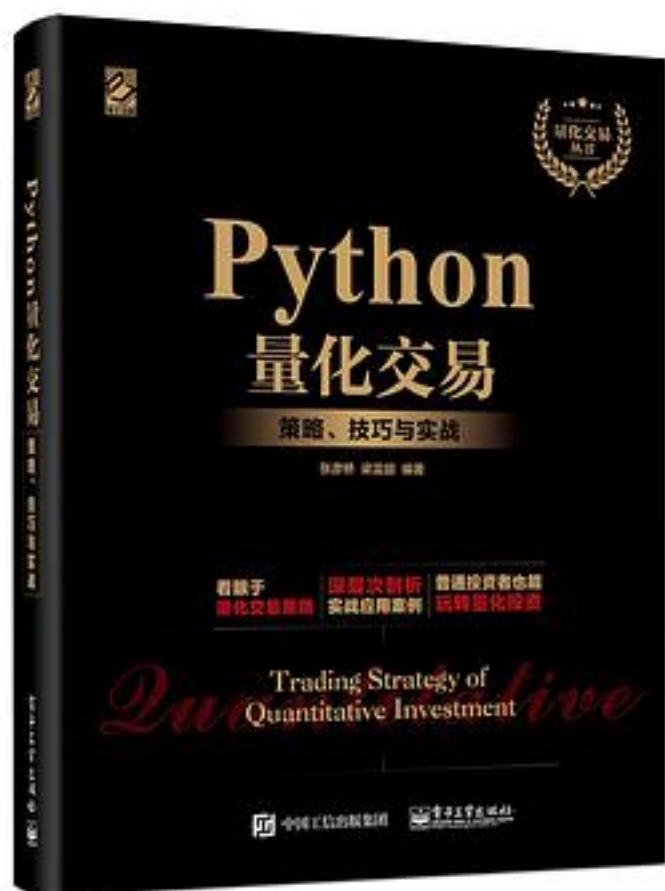


Python量化交易：策略、技巧与实战



[Python量化交易：策略、技巧与实战 下载链接1](#)

著者:张彦桥

出版者:电子工业出版社

出版时间:2019-9

装帧:平装

isbn:9787121370908

《Python量化交易：策略、技巧与实战》先讲解量化交易的基础知识，即量化交易的定义、特点、应用、故事、历史及注意事项；然后讲解量化交易平台，即JoinQuant聚宽量化交易平台的功能、账户的注册和登录、量化交易策略的创建、选股技巧、买卖条

件模型、风险控制技巧、其他参数设置技巧、回测、模拟交易、实盘交易；接着讲解量化交易开发语言Python，即讲解Python开发环境及编程基础、流程控制与特征数据类型、函数与面向对象；又讲解Python量化交易策略的常用库、常用函数与对象、获取数据函数运用技巧、基本面选股技巧、技术指标函数运用技巧、回测方法与技巧；接着讲解Python量化交易策略的机器算法运用技巧、因子分析运用技巧；最后讲解Python量化交易策略实战案例。

《Python量化交易：策略、技巧与实战》着眼于量化实战应用，同时探讨深层次的技术问题。本书附有大量的例子，通过这些例子介绍知识点。每个例子都是作者精心选择的，只要投资者反复练习，举一反三，就可以真正掌握量化交易技巧，从而学以致用。

《Python量化交易：策略、技巧与实战》适用于各类投资者，如股民、期民、职业操盘手和专业金融评论人士。

作者介绍:

目录: 第1章 量化交易概述 1

1.1 初识量化交易 2

1.1.1 什么是量化交易 2

1.1.2 量化交易与算法交易 2

1.1.3 量化交易与程序化交易 2

1.1.4 量化交易与技术分析 3

1.1.5 量化交易与人工交易 3

1.1.6 为什么要学习量化交易 4

1.2 量化交易的特点 5

1.3 量化交易的应用 6

1.3.1 投资品种选择 7

1.3.2 投资时机选择 7

1.3.3 算法交易 7

1.3.4 各种套利交易 9

1.3.5 资产配置 10

1.4 量化交易的故事 11

1.4.1 朱尔斯·雷格纳特的量化交易故事 11

1.4.2 爱德华·索普的量化交易故事 12

1.4.3 詹姆斯·西蒙斯的量化交易故事 13

1.5 量化交易的历史 14

1.5.1 国外量化交易的历史 14

1.5.2 国内量化交易的历史 15

1.6 量化交易的注意事项 15

第2章 量化交易平台 17

2.1 初识JoinQuant聚宽量化交易平台 18

2.2 量化交易平台的功能 18

2.2.1 高质量数据和强大的研究平台 18

2.2.2 顶级回测体验和顶尖模拟交易 19

2.3 账户的注册、登录及量化交易策略的创建 19

2.3.1 量化交易平台账户的注册 19

2.3.2 量化交易平台账户的登录 20

2.3.3 量化交易策略的创建 22

2.4 量化交易策略的选股技巧 24

2.4.1 量化选股的基本设置 24

2.4.2 选股指标 27

2.5 量化交易策略的买卖条件模型 31

- 2.5.1 轮动模型 32
- 2.5.2 择时模型 33
- 2.6 量化交易策略的风险控制技巧 35
 - 2.6.1 止盈、止损指标 35
 - 2.6.2 其他指标 36
- 2.7 量化交易策略的其他参数设置技巧 36
- 2.8 编写Python代码来创建量化交易策略 38
- 2.9 量化交易策略的回测 39
- 2.10 量化交易策略的模拟交易 41
 - 2.10.1 新建模拟交易并运行 41
 - 2.10.2 查看模拟交易 42
 - 2.10.3 绑定微信 45
- 2.11 量化交易策略的实盘交易 46
- 第3章 Python开发环境及编程基础 49
 - 3.1 初识Python 50
 - 3.1.1 Python的发展历程 50
 - 3.1.2 Python的特点 50
 - 3.2 Python开发环境及配置 51
 - 3.2.1 Python的下载和安装 51
 - 3.2.2 Python的环境变量配置 53
 - 3.3 Python程序的编写 57
 - 3.4 利用量化交易平台编写Python程序 61
 - 3.4.1 初识IPython Notebook研究平台 62
 - 3.4.2 利用IPython Notebook编写Python程序 66
 - 3.5 Python的基本数据类型 67
 - 3.5.1 数值类型 67
 - 3.5.2 字符串 69
 - 3.6 Python的变量与赋值 73
 - 3.6.1 变量命名规则 73
 - 3.6.2 变量的赋值 74
 - 3.7 Python的基本运算 74
 - 3.7.1 算术运算 75
 - 3.7.2 赋值运算 76
 - 3.7.3 位运算 77
 - 3.8 Python的代码格式 78
 - 3.8.1 代码缩进 78
 - 3.8.2 代码注释 79
 - 3.8.3 空行 80
 - 3.8.4 同一行显示多条语句 80
- 第4章 Python流程控制与特征数据类型 81
 - 4.1 Python的选择结构 82
 - 4.1.1 关系运算 82
 - 4.1.2 逻辑运算 83
 - 4.1.3 if语句 84
 - 4.1.4 嵌套if语句 86
 - 4.2 Python的循环结构 87
 - 4.2.1 while循环 87
 - 4.2.2 while循环使用else语句 88
 - 4.2.3 无限循环 89
 - 4.2.4 for循环 90
 - 4.2.5 在for循环中使用range()函数 90
 - 4.2.6 break语句 92
 - 4.2.7 continue语句 92
 - 4.2.8 pass语句 93

4.3 Python的特征数据类型	94
4.3.1 列表	94
4.3.2 元组	97
4.3.3 字典	99
4.3.4 集合	100
第5章 Python函数与面向对象	104
5.1 Python内置函数	105
5.1.1 数学函数	105
5.1.2 随机数函数	106
5.1.3 三角函数	108
5.1.4 字符串函数	110
5.2 用户自定义函数	113
5.2.1 自定义函数的定义	113
5.2.2 调用自定义函数	114
5.2.3 函数的参数传递	116
5.2.4 函数的参数类型	118
5.2.5 匿名函数	123
5.3 Python的面向对象	123
5.3.1 面向对象概念	124
5.3.2 类与实例	124
5.3.3 模块的引用	127
5.3.4 包	127
5.4 变量作用域及类型	130
5.4.1 变量作用域	130
5.4.2 全局变量和局部变量	131
5.4.3 global和nonlocal关键字	132
第6章 Python量化交易策略的常用库	135
6.1 Numpy库	136
6.1.1 ndarray数组基础	136
6.1.2 Numpy的矩阵对象	148
6.2 Pandas库	149
6.2.1 一维数组Series	149
6.2.2 二维数组DataFrame	150
6.2.3 三维数组Panel	160
第7章 Python量化交易策略的常用函数与对象	163
7.1 Python量化交易策略的一般结构	164
7.1.1 初始化函数	165
7.1.2 开盘前运行函数	166
7.1.3 开盘时运行函数	166
7.1.4 收盘后运行函数	167
7.2 Python量化交易策略的设置函数	167
7.2.1 设置基准函数	168
7.2.2 设置佣金/印花税函数	168
7.2.3 设置滑点函数	169
7.2.4 设置动态复权（真实价格）模式函数	170
7.2.5 设置成交量比例函数	170
7.2.6 设置是否开启盘口撮合模式函数	171
7.2.7 设置要操作的股票池函数	171
7.3 Python量化交易策略的定时函数	171
7.3.1 定时函数的定义及分类	172
7.3.2 定时函数各项参数的意义	172
7.3.3 定时函数的注意事项	173
7.3.4 定时函数的实例	174
7.4 Python量化交易策略的下单函数	174

- 7.4.1 按股数下单函数 174
- 7.4.2 目标股数下单函数 175
- 7.4.3 按价值下单函数 175
- 7.4.4 目标价值下单函数 176
- 7.4.5 撤单函数 176
- 7.4.6 获取未完成订单函数 177
- 7.4.7 获取订单信息函数 177
- 7.4.8 获取成交信息函数 178
- 7.5 Python量化交易策略的日志log 178
 - 7.5.1 设定log级别 178
 - 7.5.2 log.info 179
- 7.6 Python量化交易策略的常用对象 179
 - 7.6.1 Order对象 179
 - 7.6.2 全局对象g 180
 - 7.6.3 Trade对象 180
 - 7.6.4 tick对象 180
 - 7.6.5 Context对象 181
 - 7.6.6 Position对象 182
 - 7.6.7 SubPortfolio对象 183
 - 7.6.8 Portfolio对象 184
 - 7.6.9 SecurityUnitData对象 184
- 第8章 Python量化交易策略的获取数据函数运用技巧 186
 - 8.1 history()函数的运用技巧 187
 - 8.1.1 各项参数的意义 187
 - 8.1.2 history()函数的应用实例 188
 - 8.2 attribute_history()函数的运用技巧 191
 - 8.3 get_fundamentals()函数的运用技巧 192
 - 8.3.1 各项参数的意义 192
 - 8.3.2 get_fundamentals()函数的应用实例 193
 - 8.4 get_fundamentals_continuously()函数的运用技巧 198
 - 8.5 get_current_data()函数的运用技巧 199
 - 8.6 get_index_stocks()函数的运用技巧 200
 - 8.6.1 各项参数的意义 200
 - 8.6.2 get_index_stocks()函数的应用实例 201
 - 8.7 get_industry_stocks()函数的运用技巧 202
 - 8.8 get_concept_stocks()函数的运用技巧 203
 - 8.9 get_all_securities()函数的运用技巧 205
 - 8.9.1 各项参数的意义 205
 - 8.9.2 get_all_securities()函数的应用实例 206
 - 8.10 get_security_info()函数的运用技巧 207
 - 8.11 get_billboard_list()函数的运用技巧 208
 - 8.11.1 各项参数的意义 208
 - 8.11.2 get_billboard_list()函数的应用实例 209
 - 8.12 get_locked_shares()函数的运用技巧 210
- 第9章 Python量化交易策略的基本面选股技巧 211
 - 9.1 量化选股概述 212
 - 9.2 成长类因子选股技巧 212
 - 9.2.1 营业收入同比增长率选股技巧 212
 - 9.2.2 营业收入环比增长率选股技巧 214
 - 9.2.3 净利润同比增长率选股技巧 215
 - 9.2.4 净利润环比增长率选股技巧 216
 - 9.2.5 营业利润率选股技巧 217
 - 9.2.6 销售净利率选股技巧 217
 - 9.2.7 销售毛利率选股技巧 218

9.3 规模类因子选股技巧	220
9.3.1 总市值选股技巧	220
9.3.2 流通市值选股技巧	221
9.3.3 总股本选股技巧	222
9.3.4 流通股本选股技巧	222
9.4 价值类因子选股技巧	223
9.4.1 市净率选股技巧	223
9.4.2 市销率选股技巧	224
9.4.3 市现率选股技巧	225
9.4.4 动态市盈率选股技巧	226
9.4.5 静态市盈率选股技巧	227
9.5 质量类因子选股技巧	228
9.5.1 净资产收益率选股技巧	228
9.5.2 总资产净利率选股技巧	229
9.6 基本面多因子量化选股	230
第10章 Python量化交易策略的技术指标函数运用技巧	232
10.1 量化择时概述	233
10.2 趋向指标函数运用技巧	234
10.2.1 MACD指标函数	234
10.2.2 EMV指标函数	235
10.2.3 UOS指标函数	237
10.2.4 GDX指标函数	238
10.2.5 DMA指标函数	239
10.2.6 JS指标函数	240
10.2.7 MA指标函数	241
10.2.8 EXPMA指标函数	242
10.2.9 VMA指标函数	243
10.3 反趋向指标函数运用技巧	245
10.3.1 KD指标函数	245
10.3.2 MFI指标函数	246
10.3.3 RSI指标函数	247
10.3.4 OSC指标函数	248
10.3.5 WR指标函数	249
10.3.6 CCI指标函数	250
10.4 压力支撑指标函数运用技巧	251
10.4.1 BOLL指标函数	251
10.4.2 MIKE指标函数	253
10.4.3 XS指标函数	254
10.5 量价指标函数运用技巧	256
10.5.1 OBV指标函数	256
10.5.2 VOL指标函数	257
10.5.3 VR指标函数	258
10.5.4 MASS指标函数	259
第11章 Python量化交易策略的回测方法与技巧	261
11.1 量化交易策略回测的流程	262
11.2 利用Python编写MACD指标量化交易策略	262
11.2.1 量化交易策略的编辑页面	262
11.2.2 编写初始化函数	265
11.2.3 编写单位时间调用的函数	265
11.3 设置MACD指标量化交易策略的回测参数	266
11.4 MACD指标量化交易策略的回测详情	269
11.5 MACD指标量化交易策略的风险指标	272
11.5.1 Alpha（阿尔法）	272
11.5.2 Beta（贝塔）	273

- 11.5.3 Sharpe (夏普比率) 274
- 11.5.4 Sortino (索提诺比率) 275
- 11.5.5 Information Ratio (信息比率) 276
- 11.5.6 Volatility (策略波动率) 277
- 11.5.7 Benchmark Volatility (基准波动率) 278
- 11.5.8 Max Drawdown (最大回撤) 279
- 第12章 Python量化交易策略的机器算法运用技巧 280
- 12.1 随机森林在量化交易中的运用技巧 281
 - 12.1.1 随机森林的构建 281
 - 12.1.2 随机森林的优缺点 281
 - 12.1.3 随机森林在量化交易中的运用实例 282
- 12.2 支持向量机 (SVM) 在量化交易中的运用技巧 284
 - 12.2.1 什么是支持向量机 (SVM) 285
 - 12.2.2 支持向量机 (SVM) 的工作原理 285
 - 12.2.3 核函数 287
 - 12.2.4 支持向量机 (SVM) 的优点 288
 - 12.2.5 支持向量机 (SVM) 的缺点 288
 - 12.2.6 支持向量机 (SVM) 在量化交易中的运用实例 289
- 12.3 朴素贝叶斯在量化交易中的运用技巧 292
 - 12.3.1 什么是朴素贝叶斯 292
 - 12.3.2 朴素贝叶斯的算法思想 292
 - 12.3.3 朴素贝叶斯的算法步骤 292
 - 12.3.4 朴素贝叶斯的优缺点 293
 - 12.3.5 朴素贝叶斯在量化交易中的运用实例 293
- 12.4 神经网络在量化交易中的运用技巧 296
 - 12.4.1 什么是人工神经网络 296
 - 12.4.2 大脑中的神经元细胞和神经元细胞网络 297
 - 12.4.3 人工神经网络的基本特征 298
 - 12.4.4 人工神经网络的特点 299
 - 12.4.5 人工神经网络的算法 299
 - 12.4.6 人工神经网络在量化交易中的运用实例 301
- 第13章 Python量化交易策略的因子分析运用技巧 305
- 13.1 因子的类型及因子分析的作用 306
- 13.2 因子分析的Python代码 306
 - 13.2.1 因子分析中的三个变量 306
 - 13.2.2 因子分析中可以使用的因子 307
 - 13.2.3 calc的参数及返回值 308
- 13.3 因子的新建及常见分析 308
 - 13.3.1 因子的新建 308
 - 13.3.2 因子的收益分析 311
 - 13.3.3 因子的IC分析 314
 - 13.3.4 因子的换手分析 315
- 13.4 因子在研究和回测中的使用 317
- 13.5 基本面因子运用实例 319
- 第14章 Python量化交易策略实战案例 323
- 14.1 MA均线量化交易策略实战案例 324
 - 14.1.1 编写初始化函数 324
 - 14.1.2 编写单位时间调用的函数 326
 - 14.1.3 MA均线量化交易策略的回测 327
- 14.2 多均线量化交易策略实战案例 327
 - 14.2.1 编写初始化函数 328
 - 14.2.2 编写交易程序函数 328
 - 14.2.3 多均线量化交易策略的回测 330
- 14.3 MACD指标量化交易策略实战案例 330

14.3.1	编写初始化函数	331
14.3.2	编写单位时间调用的函数	331
14.3.3	MACD指标量化交易策略的回测	332
14.4	KD指标量化交易策略实战案例	333
14.4.1	编写初始化函数	333
14.4.2	编写开盘前运行函数	334
14.4.3	编写开盘时运行函数	334
14.4.4	编写收盘后运行函数	335
14.4.5	KD指标量化交易策略的回测	335
14.5	BOLL指标量化交易策略实战案例	336
14.5.1	编写初始化函数	336
14.5.2	编写开盘前运行函数	337
14.5.3	编写开盘时运行函数	337
14.5.4	编写收盘后运行函数	338
14.5.5	BOLL指标量化交易策略的回测	339
14.6	多股票持仓量化交易策略实战案例	339
14.6.1	编写初始化函数	340
14.6.2	编写单位时间调用的函数	340
14.6.3	多股票持仓量化交易策略的回测	341
14.7	医药股轮动量化交易策略实战案例	342
14.7.1	编写初始化函数	342
14.7.2	编写选股函数	342
14.7.3	编写交易函数	343
14.7.4	医药股轮动量化交易策略的回测	343
14.8	小市值股票量化交易策略实战案例	344
14.8.1	编写初始化函数	344
14.8.2	编写选股函数	345
14.8.3	编写过滤停牌股票函数	345
14.8.4	编写交易函数	346
14.8.5	小市值股票量化交易策略的回测	346
14.9	机器算法多因子量化交易策略实战案例	347
14.9.1	编写初始化函数	347
14.9.2	编写自定义的交易函数	348
14.9.3	机器算法多因子量化交易策略的回测	353
• • • • •	(收起)	

[Python量化交易：策略、技巧与实战_下载链接1](#)

标签

量化

python

聚宽

竹篮打水水

评论

99元的定价98元交智商税,任何一个学金工的硕士生都可以写出来,出版社来找我吧!!!!!!!!!!
!!!!!!

[Python量化交易：策略、技巧与实战_下载链接1](#)

书评

[Python量化交易：策略、技巧与实战_下载链接1](#)