

算法交易与套利交易



[算法交易与套利交易_下载链接1](#)

著者:赵胜民

出版者:厦门大学出版社

出版时间:2010-9

装帧:

isbn:9787561536254

《算法交易与套利交易》主要介绍算法交易和一些套利交易的策略，以便于读者对相关方面的内容进行阅读和学习。在《算法交易与套利交易》的第一部分，我们回顾了投资

学一些相关的基本内容。其中，前两章介绍了证券投资的收益和风险等特征，以及马可维茨的最优资产配置模型。第3章则介绍了股票投资分析当中常用的资本资产定价模型（CAPM）、套利定价模型（APT），以及因素模型。然后，第4、5章分别讲到了金融证券估值模型、基本面分析和技术分析。

作者介绍:

目录: 前言

第一章 投资的收益与风险

- 1. 1 概述
- 1. 2 收益
 - 1. 2. 1 算术平均值
 - 1. 2. 2 几何平均值
 - 1. 2. 3 算术平均值与几何平均值的比较
 - 1. 2. 4 通货膨胀调整收益
 - 1. 2. 5 期望收益
 - 1. 2. 6 资产组合的收益率
- 1. 3 风险
 - 1. 3. 1 风险的来源
 - 1. 3. 2 风险的衡量
 - 1. 3. 3 风险溢价

第二章 资产配置与均值方差模型

- 2. 1 一些主要的资产类别
- 2. 2 投资组合的一般特性
 - 2. 2. 1 投资组合的期望收益率
 - 2. 2. 2 投资组合的方差
- 2. 3 现代投资组合理论
 - 2. 3. 1 不存在无风险资产的情形
 - 2. 3. 2 存在无风险资产的情形
 - 2. 3. 3 选择一个风险资产的最优投资组合
- 2. 4 输入数据时的考虑
 - 2. 4. 1 优化问题中经通货膨胀调整的输入数据
 - 2. 4. 2 输入数据估计值的不确定性
- 2. 5 对现代投资组合模型的评价

第三章 CAPM和套利定价理论

- 3. 1 CAPM的推导
- 3. 2 对CAPM的经验检验
- 3. 3 修正的资本资产定价模型
- 3. 4 单指数模型
 - 3. 4. 1 单指数模型概述
 - 3. 4. 2 单指数模型的特点
 - 3. 4. 3 贝塔估计
 - 3. 4. 4 市场模型
- 3. 5 多指数模型
 - 3. 5. 1 一般多指数模型
 - 3. 5. 2 行业指数模型
- 3. 6 APT的推导
- 3. 7 多指数模型和套利定价模型的应用
 - 3. 7. 1 消极管理
 - 3. 7. 2 积极管理

第四章 金融计算基础及对债券的估值

- 4. 1 金融计算基础

4. 1. 1 终值的计算
4. 1. 2 现值的计算
4. 1. 3 贴现率的确定
4. 2 债券价值分析
4. 2. 1 收入资本化法与债券价值分析
4. 2. 2 收益率曲线
4. 2. 3 利率的期限结构理论
4. 3 债券属性与价值分析
4. 3. 1 到期时间
.....
第五章 股票基础分析
第六章 算法交易简介
第七章 算法交易系统的结构
第八章 交易成本分析
第九章 算法交易策略介绍
第十章 交易后分析和算法的选择
第十一章 配对交易
第十二章 可转换债券套利
第十三章 风险套利
第十四章 股指期货套利
第十五章 套利失败的教训——长期资本管理公司的教训
参考文献
· · · · · (收起)

[算法交易与套利交易_下载链接1](#)

标签

套利

金融

算法交易

投资

交易

quant

股票

算法

评论

非常山寨！

拼凑的书，一直到现在，才明白，大学里学不到东西不是学生的错，看看这些教材，都是什么东西，东拼西凑不是问题，问题是凑起来没有粘合，西红柿和鸡蛋加点水放在一起就呈上来不算是西红柿鸡蛋汤。很多概念都是错的，偏离实际的。不过还是很高兴看到这样题目的一本书。

感觉略山寨啊...像是四处拼凑的书...

临时抱佛脚花了俩小时翻完，看到想吐，合上书一看，本科教材。#好气喔还是要围笑

缺少干货

[算法交易与套利交易 下载链接1](#)

书评

[算法交易与套利交易 下载链接1](#)