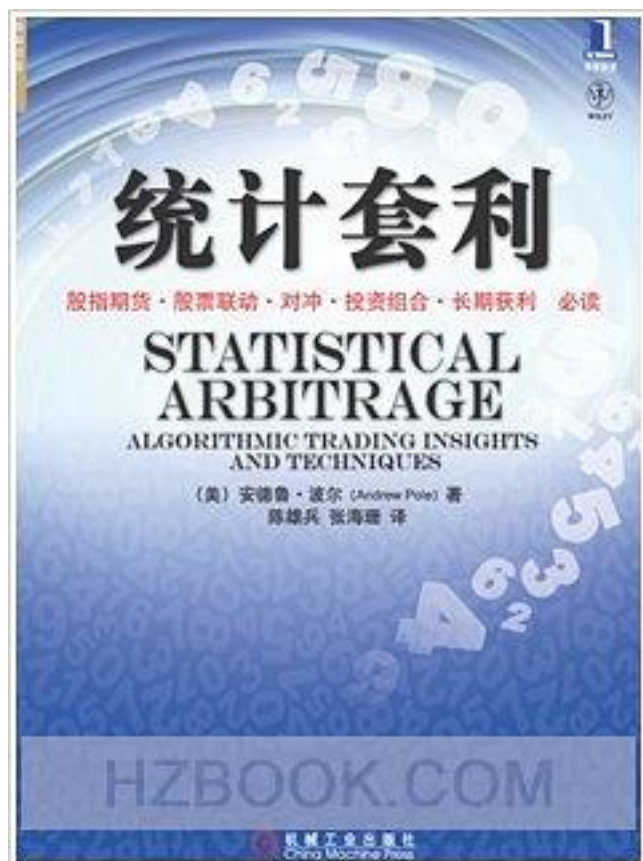


统计套利



[统计套利_下载链接1](#)

著者: (美) 安德鲁·波尔 (Andrew Pole)

出版者: 机械工业出版社

出版时间: 2011-1-1

装帧: 平装

isbn: 9787111325444

本书论述统计套利的历史，描述了从20世纪80年代开始，这项策略自摩根士丹利诞生的第一天，一直到考验重重的21世纪初期；本书也诠释了统计套利如何运作的方式，以及为什么管用的原因。作者根据自己的研究结果，以及八年来操作统计套利避险基金的经验，写成本书，对于统计套利二十余年的发展，进行了完整的回顾。

本书充满了许多创新的信息与专家的忠告；不论是想要对这个领域有整体看法的个人投资者，或者是希望对模型化、风险管理以及如何应用这项策略，想要得到更关键而深入见解的机构投资人来说，本书所包含的重要分析，极具吸引力。

作者介绍:

安德鲁·波尔Andrew Pole

TIG 顾问公司执行董事，主要研究方向为数量交易策略与风险管理。
本书既是他的研究成果，也包括他八年运作统计套利对冲基金积累的丰富经验。波尔还与人合著有《应用贝叶斯预测与时间序列分析》(Applied Bayesian Forecasting and Time Series Analysis)。

目录:"推荐序一

推荐序二

前言

第1章蒙特卡罗的谬误

11起源

12未来的方向

第2章统计套利

21导论

22噪声模型

23爆米花过程

24识别匹配交易

25投资组合结构和风险控制

26动态变化和校验

第3章结构模型

31导论

32正式的预测函数

33指数加权移动平均模型

34古典的时间序列模型

35哪一类回报?

36因子模型

37随机共振

38实践中的事情

39加倍交易：更深入的探讨

310因子分析入门

第4章反转定律

41导论

42模型和结论

43非齐次方差

44一阶序列相关性

45非常数分布

46结论的应用

47应用于美国债券期货

48总结

附录4A向前预测几天

第5章高斯不是反转之神

51导论

52双峰骆驼与单峰骆驼

53依然在敲响钟声

第6章价差波动率

61导论
62理论上的解释
第7章将反转机会量化
71导论
72平稳随机过程中的反转现象
73非平稳过程：不均匀的方差
74序列的相关性
附录7A在示例6中对数分布的一些细节
第8章诺贝尔的困惑
81导论
82事件风险
83一个新的风险因素的出现
84赎回压力
85《公平披露条例》
86在亏损期间的相关性
第9章多重困难
91导论
92十进制
93统计套利结束了
94竞争
95机构投资者
96波动率是关键因素
97关于时间维度的思考
98虚构情节中的真实示例
99恶劣的行为
910对2003年的剖析
911结构变化的真实情况
912总结
第10章黑匣子出现
101导论
102对交易成交量期望值和市场冲击力进行的模型化
103动态更新
104更多的黑匣子
105市场紧缩
第11章统计套利的复兴
111突变过程
112突变预测
113趋势变化的识别
114突变过程在理论上的解释
115风险管理的含义
116结束
附录11A理解Cuscore统计量
致谢
译者后记
参考文献"
· · · · · (收起)

[统计套利_下载链接1_](#)

标签

金融

投资

统计套利

统计

套利

数学

统计学

量化

评论

翻译请你自重。英文版还是值得一看

先降一星，看看修炼到什么时候可以降到只剩一星。

看了三分之一看不下去了，翻译得太垃圾，定下规矩，以后原版书只看原版绝逼不看翻译版！！！！

: F830/3129

这本书死在翻译上，读起来极其别扭.....

不要以為讀了這本書就可以幫助你跟隨黎老師和糕女神的腳步賺小錢錢的話倒還是不錯

希望很大，失望更大，写的什么玩意儿 啊！

算国内目前介绍统计套利比较全的了。有豆友说翻译不行，加之目前水平所限，只看了前面一点，等有机会再看原版的。

看得有点七凑八凑的感觉

入门。

no new insight.

适合计算机好的，要求对数据，模型有敏锐直觉

各種啟發性……這本書不在於對實際的指導意義，而在於其中所蘊含的啟發性……

读不懂...不知道是翻译问题还是只是问题.
第一章章叫蒙特卡洛的谬误,是说蒙特卡洛方法吗,....为什么文中根本没有提到啊....

翻译渣，幸亏有原版。主要还是理念吧，可实操的不多。

太难看懂了

郑伟安说过，统计套利这么机密的事情怎么有人可能出书来卖，多是晃人眼球又一没营养的畅销书罢了。

这翻译水平，报警了。。

太老了

辣鸡翻译

[统计套利_下载链接1](#)

书评

其实股票指数，股价波动只是结果的记录，正如图表，当出现在屏幕，入你眼内交易已经结束，否则你是观察不到的。
既然如此，过去的事情能怎么样预测未来，就凭一系列交易数据？
所以单凭统计理论研究市场只是摸黑赶夜路而已。
但数据分析的确可以提供一点先兆提示，助你夜航，...

翻译得很难懂，而且有些完全相反的错译，也不知道是专业水平问题还是……算了，不说了。
书本身的质量也不怎么样，数学没讲透，例子也不肯好好举。话说回来，就像《交易风险管理》里面说的，如果有人真的有“银弹”，那就算起了一丝“写出来出版”的念头，都该去找医生了。 ...

这本书的中文版和英文版都有不得不吐槽的地方。
首先是中文版。对照着英文版来看，中文版的翻译中真的有很多很多错误和不通顺的地方，而且都是些比较关键的地方。所以，基本上讲，如果你光看中文版，你可能永远不知道这本书都讲了些什么东西。我无法理解，如果连译者自己都读不...

我很少这么激动的。但是译者你们真的是用心翻译的吗？太差劲了。读不下去，狗屁不通！翻译完了你们自己难道都不读一遍的吗？句子都不通顺，还有一些专业名词显然你们都不知道是啥，反正写成汉语让读者自己想去吧。
不知道原著如果懂中文看了会不会被你们气死。 举一个例子：第3...

我很少这么激动的。但是译者你们真的是用心翻译的吗？太差劲了。读不下去，狗屁不通！翻译完了你们自己难道都不读一遍的吗？句子都不通顺，还有一些专业名词显然你们都不知道是啥，反正写成汉语让读者自己想去吧。
不知道原著如果懂中文看了会不会被你们气死。 举一个例子：第3...

[统计套利_下载链接1](#)