

证券组合定量管理



[证券组合定量管理_下载链接1](#)

著者:路德维希·B·钦塞瑞尼

出版者:中国财政经济出版社

出版时间:2011-6

装帧:

isbn:9787509526798

《证券组合定量管理:构建与管理证券组合的积极策略》内容简介：证券市场的深刻理解和专业的定量管理技术相结合，从基本原理到技术规范，涵盖各种证券组合定量策略与管理方法。这是一本必备理论指南，阐释了对证券市场的深刻理解，讲述构建和管理一个高收益证券组合的全过程。这是一本实用性很强的工作手册，既可以服务于跟踪指数的被动投资者，又可以服务于实施积极投资策略的投资者。这是一本雄心勃勃的书，全面涵盖了证券组合定量管理的方法论，提供了众多相关实例。

作者介绍:

路德维希 B. 钦塞瑞尼

(Ludwig B. Chincarini)

博士，CFA，Pomona学院金融学教授，同时是机构投资者的金融顾问。他之前还曾经担任：乔治城大学助理金融教授、Rydex全球投资顾问的研究总监、Foliofn（一家在一篮子交易方面具有领先优势的券商）研究总监、国际清算银行研究员。他在麻省理工学院获得经济学博士学位。

金大焕

(Daehwan Kim)

博士，First Private投资管理公司高级组合经理。曾经担任保加利亚美国大学的经济学教授。曾作为一名经济学家受聘于Foliofn。金博士同时是一位金融期刊作者。他在哈佛大学获得经济学博士学位。

目录: 序

前言

符号与缩写

第一部分 证券组合定量管理QEPM概览

第二部分 证券组合的构造和维护

第三部分 α 魔力

第四部分 绩效分析

第五部分 实际应用

术语表

• • • • • ([收起](#))

[证券组合定量管理 下载链接1](#)

标签

量化投资

金融

量化

投资

定量投资分析

金融学

数据分析

评论

相比主动投资管理组合那本书，更接地气。

组合定量的管理的百科全书，可惜我看不太懂，里面数学公式巨多。

太雷了！和《量化股票组合管理》是一本书，换了译者换了出版社.....书是好书！

一本好书

[证券组合定量管理_下载链接1](#)

书评

主要讲factor model的，比较实际，比较接地气的一本书。个人认为这本书和active

portfolio management, 是quantitative
portfolio方面讲的不错的两本书。其他很多书都不太好。

[证券组合定量管理 下载链接1](#)