

## <<量化投资的转折>>

### 图书基本信息

书名：<<量化投资的转折>>

13位ISBN编号：9787511910844

10位ISBN编号：751191084X

出版时间：2012-4

出版时间：中国时代经济出版社

作者：王铁琪

页数：233

字数：210000

版权说明：本站所提供下载的PDF图书仅提供预览和简介，请支持正版图书。

更多资源请访问：<http://www.tushu007.com>

## <<量化投资的转折>>

### 内容概要

《量化投资的转折：分析师的良知》尝试解决两个问题：一是从常见的定性分析转向定量分析的原因是什么；二是普通投资者如何能少走弯路实现定量分析。

通过实例分析打破国内A股市场具有误导性的投资宣传方式，将一个较为真实客观的投资世界展现给读者，为迷信研究所卖方分析师体系，以及对传统基本面分析与技术分析充满疑惑的投资者提供一些罕见却有理有据的建议。

此外，作者还从投资角度、技术分析、基本面分析等多方面入手，结合若干投资大师的投资模式，对量化投资进行了全方位、系统的分析论证，方便读者更感性地了解、认知这一相对可靠的投资分析方式。

## <<量化投资的转折>>

### 作者简介

王铁琪，男，1982年生人。  
2001年进入股市，随后对资本市场及投资分析方法产生了浓厚兴趣。  
2005年至2007年留英攻读硕士学位同时，通过了CFA（特许金融分析师）三个级别的考试。  
曾在研究所卖方体系做过策略分析师，现就职于宏源证券股份有限公司，主要兴趣方向为量化建模。

## <<量化投资的转折>>

### 书籍目录

- 第一章 投资角度理解这个市场
  - 第一节 一个理解市场的框架
  - 第二节 市场有效还是无效
  - 第三节 行为金融学与人的决策
  - 第四节 竞价机制、零和博弈与一致预期
  - 第五节 投资理论：坚实基础、空中楼阁与数量化
  - 第六节 投资标的、时机与仓位
- 第二章 技术分析手段
  - 第一节 技术分析的基础
  - 第二节 技术分析存在的问题与应对手段
  - 第三节 技术造假--价格层面上的金融骗术
  - 第四节 股市博弈论、筹码分布与神经网络
- 第三章 基本面分析手段
  - 第一节 向大师学什么
  - 第二节 关于“价值投资”的几个问题
  - 第三节 向巴菲特学习之前再等一下
  - 第四节 彼得·林奇身上的“闪光点”
  - 第五节 其他的角落
  - 第六节 如果真到了有钱的那一天.....
  - 第七节 基本面分析与技术分析相结合
- 第四章 如果你不想尝试自己动手打败市场
  - 第一节 基金能打败市场么？
  - 第二节 如何选基金
  - 第三节 基金配置的粗略规则
- 第五章 如果你想尝试打败市场（一）--数量化的开端
  - 第一节 基本情况
  - 第二节 使用数量化分析的原因
  - 第三节 数量化投资的注意事项--保密
  - 第四节 数量化投资的注意事项--佣金
  - 第五节 数量化投资的注意事项--杠杆
  - 第六节 数量化投资的注意事项--对抗已有观念
  - 第七节 数量化投资的注意事项--数据与模型
  - 第八节 数量化投资的注意事项--算法复杂度
  - 第九节 数量化投资的注意事项--黑天鹅
  - 第十节 数量化投资的注意事项--容错
  - 第十一节 数量化投资的注意事项--做空
  - 第十二节 数量化投资的注意事项--策略容量
  - 第十三节 数量化投资的注意事项--模拟与实际的不同
  - 第十四节 数量化投资的注意事项--算法依托的数据
  - 第十五节 数量化投资的注意事项--善用一切信息
- 第六章 如果你想尝试打败市场（二）--组合管理
  - 第一节 统领之前的概念
  - 第二节 浅谈阿尔法策略与择股
  - 第三节 浅谈择时--不联系beta的一个示例

## <<量化投资的转折>>

第四节 浅谈组合管理--联系beta的一个示例

第七章 如果你想尝试打败市场（三）--投资的其他问题

第一节 破产风险

第二节 策略设计因素--是否容易理解

第三节 交易系统三因素的再阐述

第四节 一个分析实例

第八章 他山之石

附件1算法示例

附件2交易所接口示例

附件3示例代码

## <<量化投资的转折>>

### 编辑推荐

如何更加合理判断股票是涨是跌？

基金真的在执行其所宣传的投资理念？

不见硝烟的金融战场，能够全身而退的人凤毛麟角，投资者该何去何从？

是信任所谓大师的指点迷津，还是坚持量化投资的稳健步伐？

透过金融市场的喧哗，直击乱象背后的真相，金融分析师王铁琪以最坦诚的方式给出最合理的答案！

<<量化投资的转折>>

版权说明

本站所提供下载的PDF图书仅提供预览和简介，请支持正版图书。

更多资源请访问:<http://www.tushu007.com>