

<<計量交易>>

图书基本信息

书名：<<計量交易>>

13位ISBN编号：9789866320354

10位ISBN编号：9866320359

出版时间：2011-12-1

出版公司：寰宇出版股份有限公司

作者：Ernie Chan

页数：256

译者：藍子軒

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>

<<計量交易>>

內容概要

本書為策略開發、回測、風險管理、程式知識，以及開展與執行演算法交易事業時所需的即時系統，提供了一個循序漸進的最佳化的架構。

本書對於個人投資者如何建立穩固的架構，以便於演算法交易領域中獲得成功，提供了深具價值的洞見。

作者在建立交易系統方面廣泛的實戰經驗，對於想更上層樓的交易者來說，助益良多。

本書為兩種人而寫；想以計量交易的方式，開展自己事業的獨立交易者。

以及在金融或其他相關技術學系，希望成為計量交易者，或對資產配置管理有濃厚興趣的學生。

本書書寫的脈絡如下：1. 大膽假設：尋找合適的策略。

2. 小心求證：仔細的回測策略。

3. 用對方法：散戶 / 自營交易。

4. 自動執行：程式自動化交易。

5. 風險管控：運用凱利準則，獲得最小風險、最大獲利。

6. 其他事項：各種計量投資的相關議題。

作者依循以上的脈絡，配合上豐富的經驗來介紹計量投資的基礎，作者試圖藉由此書，引領初學者進入計量交易的領域之中。

本書不是計量交易百科全書，也不是計量交易術語大全。

本書真正的目的，是希望教導投資人如何獨立找出可獲利的交易策略、如何分辨出好策略的特性，以及如何優化與回測策略，證明它在過去的歷史中表現良好，以及未來還能繼續有好的表現。

本書也會提供投資人如何根據實際獲利調整策略的系統化方法，教投資人在家中建立一套自動執行系統。

還有一些關於風險管理的基礎知識。

<<計量交易>>

作者簡介

ERNEST P. CHAN 開發統計模型與進階電腦演算法專家，也是從大量的定量資料中尋找出模式與趨勢的專家。
他是E. P. Chan & Associates (www.epchan.com) 的創始者，這是一家交易策略與資金管理軟體開發顧問公司。
他也曾在許多避險基金擔任資深計量策略開發與交易者，交易部位少則數百萬，多則達數十億美金。他也參與管理 EXP 計量投資公司，並經營計量交易部落格 (epchan.blogspot.com) ，並整合多個金融新聞服務 (包括 www.tradingmarkets.com 和 Yahoo! Finance) 。
他曾發表關於計量避險基金的文章，被《紐約時報》和《CIO 雜誌》引用，也曾出現在 CNBC 的 Closing Bell 節目中。

藍子軒

<<計量交易>>

書籍目錄

前言謝詞第 1 章什麼是計量交易？

成為計量交易者的條件事業面考量啟程第 2 章何處尋找好策略？

找到適合你的策略合理的策略以及陷阱第 3 章回測常見的回測平臺尋找與運用歷史資料庫衡量策略的表現應該避免的常見回測陷阱交易成本調優策略第 4 章架構你的交易事業當散戶？

還是加入自營交易公司？

選交易經紀商？

還是選自營交易公司？

實際的基礎設備設施第 5 章建立與執行自動交易系統自動交易系統能做什麼？

交易成本最小化運用紙上交易測試你的系統為什麼實際的績效和預期差那麼多？

第 6 章資金與風險管理最佳資金配置與槓桿風險管理心理準備附錄：報酬呈現高斯分佈的前提下，凱利公式的簡單推導過程86第 7 章計量交易的一些特殊議題平均回歸策略與動能趨勢策略結構轉換穩態與共整合因素模型退場策略季節性交易策略高頻率交易策略高槓桿與高 BETA 值投資組合的比較第 8

章結論當一個獨立交易者，真的能成功嗎？

下一步附錄：MATLAB 快速縱覽

<<計量交易>>

章节摘录

第1章什麼是計量交易？

或許是受到好奇心的驅使，你才會拿起這本書來讀，不過這也就表示，『計量交易』對你來說或許並不陌生。

許多讀者在各大主流媒體上，多少聽過關於『計量交易』的種種江湖傳言，但其中卻不乏一些錯誤的觀念，有予以釐清的必要。

所謂的計量交易（也有人稱之為演算法交易），是利用電腦演算法，嚴格執行買賣決策的一種交易方式。

交易者通常會自行設計電腦演算法則，甚至有時連程式都是自己一行一行編寫出來的。他們通常會根據歷史資料，測試交易策略在過去的表現，以作為挑選策略的重要依據。

<<計量交易>>

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>