

<<程式交易-觀念、方法、技術>>

图书基本信息

书名：<<程式交易-觀念、方法、技術與解決方案>>

13位ISBN编号：9789866333101

10位ISBN编号：9866333108

出版时间：2009

出版时间：寰宇

作者：姜林杰祐

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>

<<程式交易-觀念、方法、技術>>

內容概要

透過本書，讀者可以習得：

1. 了解程式交易是什麼？
(第一章)
2. 為何程式交易可以解決投資決策不理性的問題？
(第二章)
3. 學習程式交易的資訊技術，從試算表、建構在試算表之上的程式語言（VBA），到專業程式語言（VB 6.0~7.0與C++）。
(第三章)
4. 程式交易可能的應用領域，以及如何尋找建構程式交易策略的材料。
(第四章)
5. 在試算表環境透過表格計算與試算表上程式語言，建構一可以回溯測試選取期間與標的物、多重指標與買賣方式，甚至可以找出最佳操作策略參數的資訊系統。
(第五章)
6. 在一般程式開發環境（VB），建構一可連結關聯式資料庫、自由增添技術指標、完整分析操作策略績效的回溯測試系統。
(第六章)
7. 如何以本書提供包含原始碼的程式結構為基礎，客製化自己的分析標的、操作策略，與績效指標。
(第六章)
8. 如何使用TradeStation軟體作程式交易。
(第七章)
9. 如何編碼EasyLanguage語法。
(第七章)
10. 如何建構即時化的操盤（盯盤）環境，讓經過驗證有效的投資策略真實獲利。
(第八章)
11. 探討與程式交易相關的主題，包括「如何作程式交易策略的有效性測試」、「策略參數的最佳化」、「交易過程如何管理資金」、「以資料採礦技術歸納程式交易操作策略」、「程式交易可能產生的風險」、「程式交易與金融創新的關係」，以及「程式交易相關研究」等主題。
(第九章)
12. 程式交易論壇（www.programtrading.tw）介紹。
(第十章)
13. 全功能程式交易解決方案。
(附錄五)

對於財金領域的研究者而言，即使對於「程式交易」主題沒有興趣，也可以透過本書「建立在大量資料中，有效率的實證分析的能力」。

在本書附錄中，提出程式交易競賽遊戲設計，對於程式交易課程設計之建議，作者在程式交易論壇中發表與回應的文章，以及高應大「金融資訊技術研發暨金融商品創新中心」的構想與研發成果。

<<程式交易-觀念、方法、技術>>

作者簡介

學歷

交通大學工業工程與管理學士

交通大學控制工程碩士

交通大學資訊管理博士

經歷

高雄應用科技大學金融系系主任暨金融資訊研究所所長

交通大學資訊與財金系兼任

交通大學工業工程研究所兼任

台灣大學財務金融系兼任

清華大學計量財金系兼任

專長

金融資訊系統開發、財務工程、系統模擬、程式交易、人工智慧等研究

<<程式交易-觀念、方法、技術>>

書籍目錄

- 第一章 程式交易概論
 - 第一節 交易方式的演變
 - 第二節 交易策略剖析
 - 第三節 程式交易之定義、趨勢與結構
 - 第四節 程式交易與人為交易的比較
 - 第五節 程式交易的應用範圍
 - 第六節 程式交易的計畫與執行
 - 第七節 程式交易可能面臨的風險與對策
 - 第八節 建構不斷成長的程式交易模型
 - 第九節 公開的程式交易模型與其宣稱績效
 - 第十節 本書的目標與架構
- 第二章 程式交易存在基礎—投資決策的非理性
 - 第一節 投資心理研究之源頭—展望理論
 - 第二節 投資心理學概論
 - 第三節 以程式交易克服投資心理偏誤
 - 第四節 以程式交易克服投資過程生理限制
 - 第五節 程式交易的理由—突破交易過程中的生理與心理障礙
- 第三章 程式交易技術基礎—程式設計
 - 第一節 Excel的基本與進階使用
 - 第二節 使用Excel VBA作資訊系統開發
 - 第三節 由Excel VBA學習VB 6.0
 - 第四節 Web Service、MS .NET與VB 6.0系統的升級
 - 第五節 C語言與Borland C++ Builder的系統開發
 - 第六節 在VBA系統中連結使用關聯式資料庫
 - 第七節 以Excel讀入即時資料
 - 第八節 程式交易系統開發環境的選擇
- 第四章 程式交易模型來源—基本面與技術面投資分析
 - 第一節 程式交易的應用領域與投資程序
 - 第二節 技術面分析
 - 第三節 基本面分析
 - 第四節 如何轉出分析用的資料庫—以時報資訊資料庫為例
- 第五章 基礎回溯測試系統開發—由Excel到VBA
 - 第一節 在試算表中建立回溯測試環境
 - 第二節 以Excel VBA進行回溯測試分析
 - 第三節 藉由讀寫外部檔案設計獨立於工作表之回溯測試系統
 - 第四節 可分析多組股票並選取任意期間的回測模型
 - 第五節 包含多重買賣規則的交易策略模型
 - 第六節 考慮交易成本與分批買進策略的回測系統
 - 第七節 尋找交易策略中的最佳參數組合
 - 第八節 回測系統的延伸課題
- 第六章 進階回溯測試系統開發—由VBA、VB 6.0到VS .NET
 - 第一節 重新建構在VBA上的回測系統
 - 第二節 將VBA的回測系統轉移至VB 6.0
 - 第三節 將VB 6.0的回測系統升級至VB 7.0(VB .Net)
 - 第四節 讓回測系統可以讀取關聯式資料庫

<<程式交易-觀念、方法、技術>>

- 第五節 全功能回測系統開發
- 第六節 投資標的過濾器的設計
- 第七章 TradeStation軟體使用介紹
 - 第一節 TradeStation軟體之操作原理
 - 第二節 TradeStation軟體之設計、執行與分析
 - 第三節 EasyLanguage重要功能、指令及語法解析
 - 第四節 TradeStation使用上的限制
- 第八章即時交易系統建構
 - 第一節 交易執行流程與下單系統
 - 第二節 不同類型即時交易系統設計
 - 第三節 不同下單型態與包含智慧單功能的下單系統
- 第九章 程式交易的相關探討主題
 - 第一節 程式交易策略的有效性測試
 - 第二節 程式交易策略參數的最佳化分析
 - 第三節 程式交易過程如何管理資金
 - 第四節 以資料採礦技術發展程式交易策略
 - 第五節 程式交易面臨的風險
 - 第六節 程式交易、財務工程與金融創新
 - 第七節 關於程式交易的研究
- 第十章 程式交易論壇
- 第十一章 結語
 - 第一節 程式交易解決方案的選擇
 - 第二節 程式交易產業中的位置
 - 第三節 程式交易發展策略建議
 - 第四節 市場有效率嗎?
- 附錄一 程式交易競賽辦法分享
- 附錄二 以本書為基礎的課程設計
- 附錄三 作者在程式交易論壇中發表的文章節錄
- 附錄六 作者在程式交易論壇中回應的文章節錄
- 附錄五 高應大「金融資訊技術研發中心」在程式交易領域之研發成果

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>