量化投资导论

IFI316 Introduction of Quantitative Investing

2 36

64494446 E-mail shinancao@uibe.edu.cn

6

20% 30% 50%

70% 30%

20

IT

1.

2.

[1] Rury S. Tsay( )
[2] Quantitative Strategies for Achieving ALPHA Richard Tortoriello 2008 11
[3] Quantitative Equity Portfolio Management: Modern Techniques and Applications Edward E. Qian, Ronald H. Hua, Eric H. Sorensen( ) 2007 5
[4] Quantitative Trading ,Ernest P.Chan( ), 2014 1
[5] Quantitative Trading with R: Understanding Mathematical and Computational Tools from a Quant ' s Perspective H.Georgakopoulos( ),2015 1

1.
2.

3.

第四章 金融数据处理

1.
2.
   1
   2
   3
3.

2

第五章 时间序列分析模型与运用

1. -ARCH
   1 ARCH
   2 ARCH
   3 ARCH
2. -SV
   1 SV
   2 SV
   3 SV
2. -
   1
   2
   3

4

第六章 资产波动率建模与应用

1.
   1
   2
2.
3.
4.
   3
   4 --
   5

2

第七章　微观市场结构

1.
   1
   2
2.
   1
   2
   3
3.
4.
   1
   2
   3
   4

2

1.
2.

第八章　投资组合选取和管理方法

1.
2. efficient frontier
3.sharpe
4.
5.
6. smart beta
7.Expected shortfall VAR

2

expected shortfall A

第九章 债券的量化模型

1.
2.
3.
4.
5.

4

1. 2. 3.

第十章 多因子模型与 alpha

1. CAMP

2.APT

3.Fama-Frech

3.Barra

4. A

5.

2

A

第十一章　高频交易

1.
2.
3.
4.
5.

2

1.

第十二章　事件套利与黑天鹅

1.
2.
3.
    1
    2
    3
3.
    1
    2
    3

2

1.
2.

第十四章　量化策略回测与评估

1.
2.
3.
4.　　look forward
5.
6.
7. in sample　out of sample
8.

2

2016　3