
Portfolio Construction and Analytics 读书笔记

目录	1
Contents	1
Contents	1
1 资产管理的介绍	2
2 随机变量、概率分布和重要的统计概念	2
3 常见的分布函数介绍	2
4 统计学模型	2
5 模型模拟	2
6 模型优化	2
7 非确定优化	2
8 资产多样化	2
9 因子模型	2
10 投资组合构建的基准和跟踪误差的使用	2
11 量化权益投资组合管理的近期发展	2
12 基于因子的权益投资组合构建和业绩评估	2
13 固定收益投资组合管理基础	2
14 基于因子的固定收益投资组合的构建和评估	2
15 构建债务驱动的投资组合	2
16 金融衍生品基础	2

- 1 资产管理的介绍
- 2 随机变量、概率分布和重要的统计概念
- 3 常见的分布函数介绍
- 4 统计学模型
- 5 模型模拟
- 6 模型优化
- 7 非确定优化
- 8 资产多样化
- 9 因子模型
- 10 投资组合构建的基准和跟踪误差的使用
- 11 量化权益投资组合管理的近期发展
- 12 基于因子的权益投资组合构建和业绩评估
- 13 固定收益投资组合管理基础
- 14 基于因子的固定收益投资组合的构建和评估
- 15 构建债务驱动的投资组合
- 16 金融衍生品基础

本章内容比较基本，笔者已经学习过一遍，故没有做这一章的笔记。