**AQF考试参考书单**

一、AQF考试内容

[AQF证书](https://www.gfedu.cn/aqf/)知识体系分为四大模块，分别为：**量化投资策略理论(20%)、Python语言的编程基础(30%)、Python量化交易策略实现与回测(40%)、量化实盘交易(10%)。**

二、基础书籍

1. Hull著**《Options Future and Other Derivatives》**。这本书被称为Bible，缺点是其内容主要面向MBA而不是Quantitative专家。

2. **《Baxter and Rennie》**，主要介绍一些手法和诀窍，但主要面向原理而不是实际操作。

3. Wilmott著**《Derivatives》**。对PDE介绍的非常不错，但其他方面一般。

4. **《The Concepts and Practice of Mathematical Finance》**。这本书的目标在于覆盖一个quant应该知道的知识领域. 其中包括强列推荐你在应聘工作之前看的一些编程项目。

5. **《C++ Design Patterns and Derivatives Pricing》**。这本书是为了告诉大家如何使用C++来做Quant的工作。

6. Williams著**《Probability with Martingales》**。一本很容易让人了解Account of discrete time martingale theory的书。

7. Rogers and Williams著**《Particularly Volume 1》。**

三、实战书籍

1. **《量化投资基础》**。主要涵盖了量化投资领域的必备知识，包括：基本面分析、技术分析、数量分析、固定收益、资产组合管理、权益、另类投资等内容。

2. **《Python语言编程基础》**。包含了Python环境搭建、基础语法、变量类型、基本函数、基本语句、第三方库、金融财务实例等内容。旨在为金融财经人提供最需要的编程方法。

3. **《基于Python的经典量化投资策略》**。包含了最富盛名，最基本的量化交易思想和交易策略。例如：海龟交易模型、Logistics模型、配对交易模型、波动扩张模型、Alpha模型、机器学习(随机森林模型、主成分分析)、深度学习(人工神经网络)等内容。

4. **《量化交易系统设计》**。旨在学习量化交易系统的具体知识，包括过滤器，进入信号，退出信号，仓位管理等详细内容，并指导学员设计涵盖个人交易哲学的量化交易系统。

5. **《量化实盘交易》**。旨在为解决实际量化交易策略搭建过程中的一些问题提供最优解决方案。

6. **《Python for Data Analysis》**

7. **《Python for Finance》**

8. **《Mastering Python for Finance》**

9. **《Machine Learning in Action》**