

系统化地学习量化--推荐书单

1) 《打开量化投资的黑箱》

Inside the Black'Box:A Simple Guide to Quantitative and High-Frequency Trading

- 作者：里什•纳兰 (Rishi K.Narang)
- 出版社：机械工业出版社；第 2 版 (2016 年 5 月 1 日)
- **这本书的知识密度不大 ,主要从系统的角度介绍了一个完整的量化交易系统的架构，适合量化入门阅读**

2) 《主动投资组合管理:创造高收益并控制风险的量化投资方法》

Active Portfolio Management: A Quantitative Approach for Providing Superior Returns and Controlling Risk (2th Edition)

- 作者：理查德 C.格林诺德 (Richard C.Grinol , 雷诺德 N.卡恩 (Ronald N.Kahn), 李腾 (译者)
- 出版社：机械工业出版社；第 1 版 (2014 年 9 月 1 日)
- **这是量化投资的红宝书，里面大量的数学证明，一般用不到，但是可以从理论上理解证券组合回报的系统性来源，并且最重要的是知道同行们是怎么想的。难度较大，适合精度**

3) 《威科夫操盘法》

Wyckoff Trading Tools and Techniques

- 作者：[孟洪涛 \(Edward Meng\)](#)

- 出版社: 山西人民出版社; 第 1 版 (2016 年 10 月 1 日)
- **从行为金融学的角度解释了技术派投资的心法，有一点难度**

4) 《证券分析》

Security Analysis: Sixth Edition

- 作者: 本杰明·格雷厄姆 (Benjamin Graham), 戴维·多德 (David L. Dodd)
- 出版社: 中国人民大学出版社; 第 1 版 (2013 年 4 月 1 日)
- **不用说了，所有证券分析师的圣经，但要辩证地看，这里很多指标已经不能在 A 股里选出股票了**

后面 3 本就当科普读物吧

5) 《宽客》

The Quants

- 作者: 斯科特·帕特森 (Scott Patterson)
- 出版社: 万卷出版公司; 第 1 版 (2011 年 7 月 15 日)

6) 《算法交易:制胜策略与原理》

Algorithmic Trading: Winning Strategies and Their Rationale

- 作者: 欧内斯特·陈 (Ernest P.Chan)
- 出版社: 机械工业出版社; 第 1 版 (2017 年 1 月 1 日)

7) 《[高频交易](#)》

High-Frequency Trading: A Practical Guide to Algorithmic Strategies
and Trading Systems

- 作者：艾琳·奥尔德里奇(Irene Aldridge)
- 出版社：机械工业出版社; 第 1 版 (2011 年 5 月 1 日)