自由选择-笔记

2020年10月29日

23:40

价格制度

例子：

* 石油价格上涨，增加了链锯的使用成本，使情况对手锯有利
* 石油价格上涨，烧柴油和烧汽油卡车的抉择

贝叶斯思维-笔记

2020年11月10日

10:33

书名：贝叶斯思维：统计建模的Python学习法

作者：Allen B. Downey

出版社：人民邮电出版社

全概率公式

C:\6D99D065\45ABB7D2-5C04-4B7A-B4A1-F5612005822B.files\image001.png

所有 贝 叶 斯 统计 的 方法 都 基于 贝 叶 斯 定理， 如果 有条件 概率 的 学习 基础， 意识到 这一点 很 自然。

Python金融大数据分析-笔记

2019年2月13日

14:32

## 引入

import pandas as pd

from pandas import Series, DataFrame

## 读取文本格式的数据

### 函数

|  |  |
| --- | --- |
| read\_csv | 从文件、URL、文件型对象中加载带分隔符的数据。默认分隔符为逗号 |
| read\_table | 从文件、URL、文件型对象中加载带分隔符的数据。默认分隔符为制表符（"\t"） |

## python2 与 python3差异

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| 变更 | python2用法 | python3用法 |
| pandas库滚动窗口 | rolling\_mean() | (window).mean() |
| DataReader | pandas.io.data.DataReader | pandas\_datereader |
| urlretrieve | from urllib import urlretrieve | from urllib.request import urlretrieve |

# 

# matplotlib

## 约定引入

import matplotlib.pyplot as plt

## Figure和Subplot

fig = plt.figure

ax1 = fig.add\_subplot(2,2,1)

ax2 = fig.add\_subplot(2,2,2)

ax3 = fig.add\_subplot(2,2,3)

# 'k--'是线型

from numpy.random import randn

plt.plot(randn(50).cumsum(), 'k--')

### 调整subplot周围的间距

plt.subplots\_adjust(left=None, bottom=None, right=None, top=None, wspace=None, hspace=None)

回归

pandas中取消了ols库，换用 import statsmodels.api as sm

pandas where和mask区别

where ：替换条件（condition）为Flase处的值

mask ：替换条件（condition）为True处的值

连续时间金融-笔记

2020年9月13日

16:34

## 符号定义

|  |  |
| --- | --- |
| Z | 1美元单期投资收益率随机变量 |
| U(W) | 冯·诺伊曼-摩根斯顿效用函数 |
| W | 投资者的期末财富值 |

## 名词

|  |  |
| --- | --- |
| 冯·诺伊曼-摩根斯顿效用函数 | von Neumann-Morgenstern utility function |

宽客人生-笔记

2019年2月19日

10:10

无论是物理问题还是期权理论，我每遇到一个需要解决的新问题，第一个主要的挑战就是要找到如何推进工作的直觉；第二个挑战就是把这种直觉转化为规范性的东西，变成任何人都可以照着去做的一套规则，这些规则已经不再需要最初的那些深刻的洞察力。——P49

证券分析-笔记

2020年8月7日

12:44

公司好但是证券的条款不好的，可以放弃，公司不好但是证券的条款很好的可以选择。

# 固定价值投资选择的原则

* 1. 安全性不以抵押权衡量
  2. 购买债券应以经济萧条时期的表现为准
  3. 以牺牲安全性换取收益得不偿失
  4. 必须适用有关安全性的明确标准

##### 不应因较早到期而放宽安全标准

我们建议不对长期债券和短期债券进行区分，因为这样可能导致我们在选择短期债券时放宽安全标准。

数量金融-笔记

2019年1月18日

17:14

## 重要章节

是否能通过增加合约使组合达到最优价值？ 60章

鞅方法推导BS方程 10、80章

BS方程数值解法 15、77、78章

求解偏微分方程的有限差分法、数值积分、蒙特卡罗模拟 第六部分

有关在险值的章节 19、42章

蒙特卡罗模拟 80章

效用学习-笔记

2020年9月18日

11:16

相关概念

效用

边际效用

期望效用函数理论

相关资料

[期望效用函数理论及其应用 - MBA智库文档](onenote:https://d.docs.live.net/d20e030886dac3aa/文档/健%20的笔记本/快速笔记.one#期望效用函数理论及其应用%20-%20MBA智库文档&section-id={605A8367-B519-4AAA-BD72-28C6EF148ADF}&page-id={3D9A4189-68DD-41A6-B0CD-448ADA6B8BB8}&end)

[效用论](https://doc.mbalib.com/view/1a0e3cd1e9764c299bcc15a7c229c2c9.html)