

《期货市场计算机分析指南》

图书基本信息

书名：《期货市场计算机分析指南》

13位ISBN编号：9787560975870

10位ISBN编号：7560975879

出版时间：2012-4

出版社：华中科技大学出版社

作者：查尔斯·勒博 (Charles Lebeau), 大卫·W·卢卡斯 (David W. Lucas)

页数：262

译者：何苗

版权说明：本站所提供下载的PDF图书仅提供预览和简介以及在线试读，请支持正版图书。

更多资源请访问：www.tushu000.com

《期货市场计算机分析指南》

内容概要

《期货市场计算机分析指南》分为：系统的建立、技术研究、系统测试、日交易四章，内容包括：问题1：鉴定可交易的市场；问题2：鉴别走势；问题3：市场择时；问题4：建立止损等。大多数的软件手册只能使顾客在屏幕上看到正确的技术研究，然后，顶多给出一两段文字，说明指标的一般目的和应用。

《期货市场计算机分析指南》

作者简介

查尔斯·勒博，作者是一位驰骋于期货行业24年多的德高望重的老将。作为《技术交易商简报》一个面向机构及专业期货交易商的教育性月刊的编辑和发行人，勒博以他的交易技巧和技术分析的专业知识而闻名遐迩。他曾任E.F哈顿公司的区域期货主管。他组织、规划及推广过无数次的与商品相关的投资产品活动。他是期货市场上一家理财公司岛景金融集团（Island View Financial Group, Inc）的创立者和总裁。

勒博写过许多关于技术分析和建立可盈利的交易系统的方法的文章。他是南加州大学的一名客座讲师，经常在那里教授大学的基础性和技术性分析课。他出席过在美国、香港、新加坡、伦敦及苏黎士举行的重大的行业会议，会上他也是一名独具特色的发言人。

大卫.W.卢卡斯，作者在计算机期货交易方面是一位知名的权威人士。他写过许多关于设计和测试期货交易策略的文章。卢卡斯具有渊博的计算机知识，担任深受赞誉的《技术交易商简报》的技术编辑。作为一名期货专家，卢卡斯有着多年的交易经验，他是岛景金融集团的副总裁，负责管理的基金交易。同时，他也为专业的交易顾问提供咨询，帮助他们开发、测试及监控期货交易模型。

书籍目录

导论
使用个人电脑
建立您自己的系统
交易并不易
找到合适的工具
交易前测试
分享日交易的点子
我们并非无所不知
真正的目的是赚钱
本书不是入门读物
读者须知
第一章 系统的建立
导论
为什么建立系统？
付款为收益
界定问题，然后解决问题
问题1：鉴定可交易的市场
流动性是关键
避免新市场
必须监控流动性
问题2：鉴别走势
发现走势所用的工具
简单化
问题3：市场择时
做好准备，瞄准目标开火
选择指标
耐心是会获得回报的
问题4：建立止损
止损过近及过远
理想的止损
止损方法要保持一致
问题5：退市择时
来自外太空的信息
简单的回顾
流行的退市策略
折中的退市策略
随机入市可获得的利润
问题6：再入市择时
“万无一失的”再入市策略
摆动指标派上了用场
为何不持仓？
协调退市与再入市
问题7：监控系统
底线
.....
第二章 技术研究
第三章 系统测试

第四章 日交易

章节摘录

版权页：插图：导论 各种类型的指标 任何成功的交易系统必须具有一些客观、可重复使用的入市和退市方法。这些方法可以分为几种类型。有经典的爱德华—玛吉图表分析，优点是简单而全面，缺点是主观性太强。还有非常复杂、基于数学的方法，如自动反转整体移动平均线（ARIMA）或傅立叶频谱分析。我们看不出复杂的数学择时模型优于其他的类型的分析。数量惊人的交易商臆想市场存在某种潜在的结构，一旦让他们发现了，那就是通向成功的康庄大道。这些交易商赞同一些很普遍的方法，如艾略特波浪线、江恩分析、甚至是占星术。一小群直言不讳的交易商 / 狂热分子是这些策略的忠实护卫者。他们主要是靠信念交易，给不出什么证据和逻辑支持他们的信仰。他们长时间努力工作，却默默地蒙受损失。然而他们始终认为失败只是源于个没有找到他们认为的隐藏在市场中的真理确切半径的能力。偶尔的收益给了他们坚持的动力，而损失却让他们忏悔自己工作不够努力，或花的钱不够多，因而没能揭开被精心守卫着的控制市场的秘密。他们真是不幸，花上大笔钱，参加研讨会，咨询目前的专家（作为人类慷慨的朋友，他愿意仅收几百美元就分享秘密），也只了解了部分的秘密。我们认为如果真有什么潜在的结构控制着市场，那也显然还没被发现。但最重要的是，我们相信无论谁发现了富裕的最终秘密，以任何价格都不愿与我们分享的。最后，在我们列举的指标类型中，我们来讲讲本章要讲到的指标。这些电脑生成的技术研究是比较简单的指标，通常来源于价格。它们不是富裕的秘密，只是普通的方法，可能永远不会揭露什么市场的终极真理。这些比较有名的指标，是用来给我们提供通俗易懂的有助于入市退市的信号的。关于这些指标的作品已有很多。但我们觉得这方面的文献偏学术性，实际运用和指导太少。我们对学术分析没有争议，事实上，我们感激它所教给我们的知识。但是，我们认为大多数的交易商没有认识到每种指标许多不太明显但很实际的用处及局限性。他们也没有掌握可以把这些技巧融入系统的许多方法。学会使用各种指标 交易新手经常告诉我们他们不知道电脑屏幕上那众多的波纹线代表什么，即使交易老手也觉得这些波纹线有些令人生畏。我们会根据自己的以及多年来其他交易商与我们分享的经验给你们提供一些见解和建议，尽力填补这方面的信息沟。你们可以看到各种分析中都有一些共同的线。每种线条在精心设计的交易系统中都有某种作用。一些技术指标在趋势性的市场非常有效，另一些则最适用于非走势性的市场。尽管所有这些指标都建立在价格基础上，它们的计算方法却不同。对我们而言，没有最好的或最差的甚至最喜欢的技术研究。我们要告诉您的是我们所认为的恰当高效地使用每种指标的方法，我们的讲解会尽可能的具体。选择多种多样，没有对错之分，所以最终的评价取决于您选择哪一种指标，如何选择，当然前提是有您想使用的指标。我们选择的技术研究与期货市场相关性最大，而不是证券市场。证券市场研究只是针对证券的。除了交易量和未平仓合约数是直接研究的，其余的研究完全是从价格计算出来的。这些研究在极易获得的商业技术分析软件上都可找到。

《期货市场计算机分析指南》

媒体关注与评论

“《期货市场计算机分析指南》一书以作者多年的经验提供了一页又一页的可靠的交易建议。你会愿意将这本包含广博的知识的指南放在电脑前，作为最有用的技术研究的便利参考书的。”——里克斯·威尔莫尔（Rex Wilmore），未来资源来源总裁

“对借助电脑来做技术分析的交易商而言，《期货市场计算机分析指南》是一本真正地传授方法的书。书中充满了有益的指导和策略。强力推荐！”——霍沃德·阿灵顿（Howard Arrington），Ensign软件的所有者

“很荣幸被邀请为这本精心力作写序言。《期货市场计算机分析指南》为现代技术分析做出了宝贵贡献。”——提姆·斯拉特（Tim Slater），Computrac软件集团总裁

“建立和测试系统这两个详细的部分是迄今为止我所读过的关于这两个重要话题中最出色的。《期货市场计算机分析指南》向交易商展示了如何获得他们所需的优势以获得最大的利润。”——拉尔夫·温斯（Ralph Vince），《投资组合管理公式》（Portfolio Management Formulas）和《资金管理数学》（The Mathematics of Money Management）的作者

“日本技术师说‘要了解市场，就去问市场。’这部优秀作品清晰地向你展示了揭示和理解市场发出的信息的最佳方法。”——史蒂夫·尼森（Steve Nison），《日本蜡烛图绘制技巧》（Japanese Candlestick Charting Techniques）的作者

《期货市场计算机分析指南》

编辑推荐

《期货市场计算机分析指南》试图消除这一障碍，详细解释一些最普遍，最有用的计算机生成的技术指标。最重要的是，我们将对正确运用这些指标进行期货交易给出实际性的建议。

《期货市场计算机分析指南》

名人推荐

“《期货市场计算机分析指南》一书以作者多年的经验提供了一页又一页的可靠的交易建议。你会愿意将这本包含广博的知识的指南放在电脑前，作为最有用的技术研究的便利参考书的。”——里克斯·威尔莫尔（Rex Wilmore），术来资源来源总裁“对借助电脑来做技术分析的交易商而言，《期货市场计算机分析指南》是一本真正地传授方法的书。书中充满了有益的指导和策略。强力推荐！”——霍沃德·阿灵顿（Howard Arrington），Ensign软件的所有者“很荣幸被邀请为这本精心力作写序言。《期货市场计算机分析指南》为现代技术分析做出了宝贵贡献。”——提姆·斯拉特（Tim Slater），Computrac软件集团总裁“建立和测试系统这两个详细的部分是迄今为止我所读过的关于这两个重要话题中最出色的。《期货市场计算机分析指南》向交易商展示了如何获得他们所需的优势以获得最大的利润。”——拉尔夫·温斯（Ralph Vince），《投资组合管理公式》（Portfolio Management Formulas）和《资金管理数学》（The Mathematics of Money Management）的作者“日本技术师说‘要了解市场，就去问市场。’这部优秀作品清晰地向你展示了揭示和理解市场发出的信息的最佳方法。”——史蒂夫·尼森（Steve Nison），《日本蜡烛图绘制技巧》（Japanese Candlestick Charting Techniques）的作者

《期货市场计算机分析指南》

精彩短评

- 1、在看，比较清楚
- 2、译者何苗是国泰君安的那个量化分析师吗？
- 3、这本书其实是一本好书，被不少交易训练引用过。作者的语言本身也比较偏理工科。翻译很一般，甚至不能准确表达里面的意思，让人看了也不明白。
- 4、260几页的一本破烂居然原价55，打了折卖27，你们认为占便宜了吗？只不过列了几个指标而已。
- 5、看了之后对指标有了更深的理解，不过具体操作时还是要把内容好好消化一下的，关键是思路
- 6、有干货
- 7、就是讲指标。很详细。挺好的。
- 8、原本以为是一本有关计算机量化交易的书籍，读完后才发现是美国80年代出的讲解如何运用各种技术指标的，类似以前乾隆的红皮书系列。但毕竟有了作者几十年的经验在里面，给个四星吧！
- 9、内容还可以，可一些翻译实在拗口，不知译者是否做过交易...
- 10、第一部分介绍了交易系统需要考虑的几个方面，相当于指导了第二部分介绍了一些技术指标，但有些不适合中国市场，可能理解起来也有些难点第三部分关于测试还在阅读中。
- 11、对于随机，任何拟合都是无意义的。
- 12、不是自己想要的书。可能是自己没有读懂。
- 13、《通向财富自由之路》推荐的一本技术分析的书，启发最大的是关于adx指标的入市方法，技术分析爱好者可以参考。
- 14、计算机分析
- 15、这本书实实在在是本好书，当然要有基础才能看懂，
- 16、只统计分析，不迷信规律，赚钱导向
- 17、proposed a feasible methodology to create a profitable trading system via the technical indicators analysis. Also give a viable way to test essential part within the trading system and the evaluation method. Good book!
- 18、在统计分析方面不如《超越技术分析》但还是值得买回来看看
- 19、书的质量不错，亚马逊的送货速度还是可以的，总体服务不错，不愧这个亚马逊这个世界品牌。
- 20、其实含金量很高，指标介绍全面，但是翻译的真是让我崩溃，是直接复制黏贴到翻译软件里的么？
- 21、较喜欢，比作者的上一本书简明，但知易行难!
- 22、向老炮致个敬！书有些老了，但思路依旧闪光！
- 23、里面的内容看起来比较枯燥。感觉不太实用
- 24、学习量化交易入门可看~
- 25、关注各类指标，可以作为初步实践的教材。
- 26、对指标有了比较详细的讲解，比国内很多指标大全好太多了，很多指标大全都是介绍指标的公式，这个有比较详细的说明各个指标的优缺点，另外书是针对期货的，所以成交量的指标没有。对指标的看法有新的观点。
- 27、一本有用的期货投资实用书籍，没有无用的概念介绍，就是价格贵了点哈。
- 28、不过需要些基础。翻译有待提高
- 29、外国人就是务实，没有什么花里胡哨的东西，就是很平实地叙述。读懂，则受益匪浅。
- 30、该书一定要有一定基础的来看
- 31、解惑DMI~
- 32、详细介绍了各种指标的用法
- 33、纯粹技术派，容易给人以误导看起来很高深，但感觉好像有点让人失望不过是刚出的书，还是看一看，有一两句话有用的，就够了
- 34、就是书运送过程中有点损坏喽，将就着看了

- 1、原本只是想浏览粗看，没想到这会是我今年读的最认真的一本书。建议从第二章技术研究读起，读完后再读第一章。读书备忘录如下： DMI 趋向指标，其中的ADX是本书的精华所在。ADX上升一直持仓，直到ADX开始下降平掉部分仓位再视情况接下来是否全部平仓。注意，当ADX没有升到正负DI之上时不平仓。ADX不会让你吃到大趋势的整段利润，但提醒你持仓一段日子已经足够获利丰厚了。ADX上升时，趋势行情。下降时趋势不明，做多做空都可。可高抛低吸。DMI交叉信号较慢，不作入市择机信号，但可作为入市验证信号。 布林线 大趋势行情时价格沿着上下轨运动，在价格超过上下轨时，可部分平仓取利（大胆可少量反手）等回轨道再回补，使利润最大化。中等力度趋势行情价格回碰中轨为加仓入市良机。如趋势时间已经很长，再碰中轨小心反转。 CCI 顺势指标穿越0点入市建立小型仓位，回抽0点止损。赚钱后逐步加仓。正负100以上加码，正负200以上再回落时全部平仓。CCI和ADR结合判断趋势。ROC指标和CCI原理用法相同 MTM动量指标走势用法基本和CCI,相同有时候比CCI反应稍快,作为入市可能比CCI更及时,可参考互补。 RSI 相对强弱指数反应没KDJ快，但信号更可靠一些。注意底部背离型号。做空/多25/75推迟入市，等一下市场出现微小的回抽，得到更好的介入价格。再入市技巧：等回到50左右择机再入。取利技巧：空/多25/75之下/上，等RSI回10个点，取利。 KDJ 随机指标 类似RSI,在大行情高位钝化，此时不宜使用。30~70区间使用良好，先小仓位建仓。经典偏离信号：三顶（底）因KDJ灵敏，一波大行情马上要结束的顶或底部，KDJ最先发出短线反向信号，虽然大行情中KDJ早已钝化，但此时值得重视。 MACD和移动平均线MA：期货中作用不大，结合起来判断大势过滤掉不良交叉信号。 抛物线：辅助作用，和ADX一致，趋势基本不会错。判断大波动中庄家要阻击的止损位，提现挂单等待逆向操作。 ATR 波动性 没用处，建议抛弃。 %R 威廉指标 原理缺乏说服力，即使在股市中也基本没用，建议删除。 点数图 大多数软件不支持 持仓量：移仓时5~8天后可能产生新的行情。 测试表明：500美元跟踪止损是最佳退市方法，也是最佳止损方法。第四章是日内交易，作者给日内交易爱好者给出了不少武功秘笈，但作者同时提出日内交易能稳定持续交易者不到千分之一，这些武功其实都是杀敌一千自损八百！慎用！另外说一下，这书翻译的真好
- 2、可能是看多了量化的书，对这本就没有太多好感了。不过对每个技术指标的一些说明还是不错的，尤其是说明了适用性和最佳实践。总结起来，判趋势用ADX，入市用均线，止盈止损看SAR，RSI、KD用背离。其他系统测试的一些说明对新手来说也不错。

章节试读

1、《期货市场计算机分析指南》的笔记-第198页

上个世纪80年代的分析技术已经是我辈望尘莫及的了，国内技术分析阶段还是比较初级的啊
这一段分析测试结果体现了一个测试工程师的技巧和经验
这一段要反复精度

2、《期货市场计算机分析指南》的笔记-认真读完了，这次必须给五星

原本只是浏览粗看，没想到这会是我今年读的最认真的一本书。建议从第二章技术研究读起，读完后读第一章。

读书备忘录如下：

DMI 趋向指标，其中的ADX是本书的精华所在。

ADX上升一直持仓，直到ADX开始下降平掉部分仓位再视情况接下来是否全部平仓。注意，当ADX没有升到正负DI之上时不平仓。

ADX不会让你吃到大趋势的整段利润，但提醒你持仓一段日子已经足够获利丰厚了。

ADX上升时，趋势行情。下降时趋势不明，做多做空都可。可高抛低吸。

DMI交叉信号较慢，不作入市择机信号，但可作为入市验证信号。

布林线

大趋势行情时价格沿着上下轨运动，在价格超过上下轨时，可部分平仓获利（大胆可少量反手）等回轨道再回补，使利润最大化。

中等力度趋势行情价格回碰中轨为加仓入市良机。如趋势时间已经很长，再碰中轨小心反转。

CCI 顺势指标

穿越0点入市建立小型仓位，回抽0点止损。赚钱后逐步加仓。

正负100以上加码，正负200以上再回落时全部平仓。

CCI和ADR结合判断趋势。ROC指标和CCI原理用法相同

MTM动量指标

走势用法基本和CCI,相同有时候比CCI反应稍快,作为入市可能比CCI更及时，可参考互补。

RSI 相对强弱指数

反应没KDJ快，但信号更可靠一些。

注意底部背离型号。

做空/多25/75推迟入市，等一下市场出现微小的回抽，得到更好的介入价格。

再入市技巧：等回到50左右择机再入。

取利技巧：空/多25/75之下/上，等RSI回10个点，取利。

KDJ 随机指标

类似RSI,在大行情高位钝化，此时不宜使用。

30~70区间使用良好，先小仓位建仓。

经典背离信号：三顶（底）

因KDJ灵敏，一波大行情马上要结束的顶或底部，KDJ最先发出短线反向信号，虽然大行情中KDJ早已钝化，但此时值得重视。

MACD和移动平均线MA：期货中作用不大，结合起来判断大势过滤掉不良交叉信号。

抛物线：辅助作用，和ADX一致，趋势基本不会错。

判断大波动中庄家要阻击的止损位，提现挂单等待逆向操作。

ATR 波动性 没用处，建议抛弃。

%R 威廉指标 原理缺乏说服力，即使在股市中也基本没用，建议删除。

点数图 大多数软件不支持

《期货市场计算机分析指南》

持仓量：移仓时5~8天后可能产生新的行情。

测试表明：500美元跟踪止损是最佳退市方法，也是最佳止损方法。

第四章是日内交易，作者给日内交易爱好者给出了不少武功秘笈，但作者同时提出日内交易能稳定持续交易者不到千分之一，这些武功其实都是杀敌一千自损八百！慎用！

3、《期货市场计算机分析指南》的笔记-第69页

80年代，一个流行和昂贵的系统进入了市场。

这段是不是说得丹尼斯的海龟啊？

《期货市场计算机分析指南》

版权说明

本站所提供下载的PDF图书仅提供预览和简介，请支持正版图书。

更多资源请访问:www.tushu000.com