

《期货交易者资金管理策略》

图书基本信息

书名：《期货交易者资金管理策略》

13位ISBN编号：9787564221275

作者：瑞泽·J.鲍尔绍拉

页数：225

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

《期货交易者资金管理策略》

内容概要

瑙泽·J.鲍尔绍拉所著的《期货交易者资金管理策略/东航金融衍生译丛》以资金管理为主题，是针对谨慎投资者的入门读本。本书并不伪称能够培养读者在期货市场中获得暴利的技巧。相反，它向读者展示的是如何通过训练进行风险控制，从而避免在市场中遭受损失。哪怕只能帮助读者规避掉期货市场中众多风险中的一个，本书的目的也就达到了。

《期货交易者资金管理策略》

书籍目录

总序
译者序
序言
第一章 理解资金管理过程
资金管理过程的步骤
可用机会的排序
控制总体暴露风险
风险资本的分配
评估交易的最大许可损失
风险等式
确定交易合约的数量：平衡风险等式
风险等式不平衡时进行交易的后果
结语
第二章 破产的动态学
不予行动
不当行动
估算损失数量
破产风险
破产风险的建模
结语
第三章 估计风险与回报
对风险进行定义的重要性
对回报进行估计的重要性
使用常用形态估计风险与回报
头肩形
双重顶与双重底
碟形(圆形)顶和碟形(圆形)底
V形反转、钉形反转和岛形反转
等腰三角形和直角三角形
楔形
旗形
没有测量规则的回报预测
风险与回报的综合
结语
第四章 通过分散投资控制风险
估计期货交易的回报
估计单独商品的风险
估计同时交易的商品风险：商品相关性的概念
为什么分散投资是有效的
集中投资：分散投资的反面
检验商品相互关系的有效性
商品相关性是否显著的非统计学检验
对相关商品进行交易的矩阵
协同交易
价差交易
分散投资的局限
结语

第五章 商品的选择

互斥机会与独立机会

商品选择的过程

夏普比率

怀尔德商品选择指数

价格变动指数

经过调整的报酬率指数

结语

第六章 对未实现利润和未发生损失进行管理

为未发生损失制定截止水平

通过视图法制定止损点

波动率止损

时间止损

资金管理的货币价值止损

盈利交易未发生损失的模式分析

牛市和熊市中的陷阱

避免牛市和熊市中的陷阱

使用开盘价格行为信息设立保护性止损点

如何在限价锁定市场上生存

对未实现利润的管理

结语

第七章 管理资金：控制暴露风险

每笔交易进行等值货币投资的暴露风险

固定比例的暴露风险

通过改良的凯利方法得出最优固定比例

求得针对特定交易的最优暴露风险

鞅策略与反映策略

针对特定交易的暴露风险与综合的暴露风险

结语

第八章 管理资金：分配资本

在商品间进行风险资本分配

单一商品交易方案的分配

包含多种商品的交易方案的分配

等值风险资本分配

最优资本分配：引进现代最优证券投资理论

使用最优的 f 作为分配基础

风险资本与可用资本的关联

决定交易合约的数量

期权在处理带小数部分的合约数量时的作用

金字塔法

结语

第九章 机械交易系统的作用

机械交易系统的设计

机械交易系统的作用

固定参数机械系统

对于机械系统问题的可能解决方案

结语

第十章 回归基本

避免四星错误

《期货交易者资金管理策略》

损失引起的情绪后果

保持情绪平衡

总结

附录A

附录B

附录C

附录D

附录E

附录F

《期货交易者资金管理策略》

精彩短评

- 1、太教科书了，主要就是一个凯莉公式
- 2、深有体会

《期货交易者资金管理策略》

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