

期货交易者资金管理策略



[期货交易者资金管理策略 下载链接1](#)

著者:(美)瑙泽.J.鲍尔绍拉

出版者:上海财经大学出版社

出版时间:2007-1

装帧:

isbn:9787810988575

期货交易者资金管理策略，ISBN：9787810988575，作者：（美）瑙泽·J.鲍尔绍拉；肖成、荣军 译

作者介绍:

目录:

[期货交易者资金管理策略_下载链接1](#)

标签

资金管理

期货

交易

投资

金融

投机

交易系统

股票

评论

这本才是比较像话的资金管理教材，也稍嫌浅，不过普通投资者也并不需要过分复杂的资金控制。【我个人认为固定资产比例的风险暴露仍然是最佳方法，martingale都太危险了……】

实在是太晦涩的教科书了！

翻译错误非常多，看起来很不顺畅，如第二章模拟过程原理处，资金比例的使用如果是处于亏损的概率下，亏损一美元，处于盈利的概率下，盈利W美元。以及"直到出现以下任何一种情况后，破产风险就可被看作是可以忽略的。”严重错误，原文“Trading continues in a given round until",并没有后面一句“风险是可以被忽略的”-原书：<https://epdf.tips/money-management-strategies-for-futures-traders.html>
对于个人投资者来说，只是定性地了解了交易的资金管理问题，不具有直接的实操性。在某些细节的理解上有难度，先实践再重看。

: F830.9/2122-2

资金管理入门读物

简单的资金管理描述+凯利+Ralph Vince改良

康康的书，可能了一大半没有读完，不知道什么时候才能再回重庆，留着几年了……哈哈

资金管理入门的好书

说了些别处说过的。实际上泛善可陈。

理论型的，破产风险印象深。

只有第2、3、7、8章有点用，关于控制风险和如何进行资金管理的方面阐述不够详实、深入，有点点到即止的感觉。另外翻译很烂，都有点想去看英文原版了。看看电子书就好了，不建议购买纸质书。

破产概率表、kelly formula的后半部分推导以及另一种不知道叫啥的方法有用

珍惜生命，远离财大版翻译图书

用未知的数据去预测未知的破产风险本身就是风险很大的事情，虽然利用了改良的凯利公式但是仍然克服不了这个缺陷。确实是一本非常晦涩的教科书

详解凯利公式 翻译的一坨屎

说的不少，但不深入。详细的测试也少。最有价值的是f，还是从Ralph vince那里抄的。

非常给力，要求有一定基础。

破产公式，对凯利公式的改善，以及头尾两章说的都不错，其他组合投资的没怎么看，公式略有点多，但是还是有收获，可以作为了解资金管理的系统书籍，工具书。

恶补代数。

回报率也要考虑时间的价值啊！
商品相关性是否有效的统计学检验，理论完全不懂(= =)
变更率止损点，读了两边，还是没懂～ 我学过统计学吗？？？！

让人觉得特别靠谱(*^m^)

[期货交易者资金管理策略_下载链接1](#)

书评

书中的凯利判据 引进了回报率之后 便完美了，有效解释了头寸问题。破产风险分析也非常值得一看。如果是技术分析是矛那么资金管理便是盾，在期货市场上，盾比矛更重要。有矛保证了存活的力量，有盾才可以在市场长远地上生存下去。从进化论的角度看，资金管理就是每个人...

P19第二章关于破产风险的模拟列表,在实际操作中至少有三点不符合,一是交易连续亏损不呈正态分布;二是系统本身的盈亏比和胜率不呈稳定性;三是跳空.所以这种模拟给定的分仓建议在实盘中是无意义的. P50第四章关于分散投资的谬误,文中说两种商品完全负相关,分散投资发挥作用的...

如果是普通投资者的话 这个书应该是很不适合的
全文大量应用了统计学、财务管理的知识及各种模型，一定程度上已经限制了读者群作为专业做风控的读者，还是有必要认真学习下
虽然他的很多数据是赏格世纪80年代的
但是全书从不同专业不同方式做了集中，应该说在国内是比较全面的

这本书是着重描述风险控制及各类投资风险形成机理的
读这本书给我的感觉是在读高等数学加思维过山车
很累，但加深了我对风险报偿比例的重视程度
简单来说，每一笔投资都是由【成功率】【风险度】【报偿率】组成的，而一旦买进开仓，又被【潜在风险】和【潜在利润】左右，我们投...

[期货交易者资金管理策略_下载链接1](#)