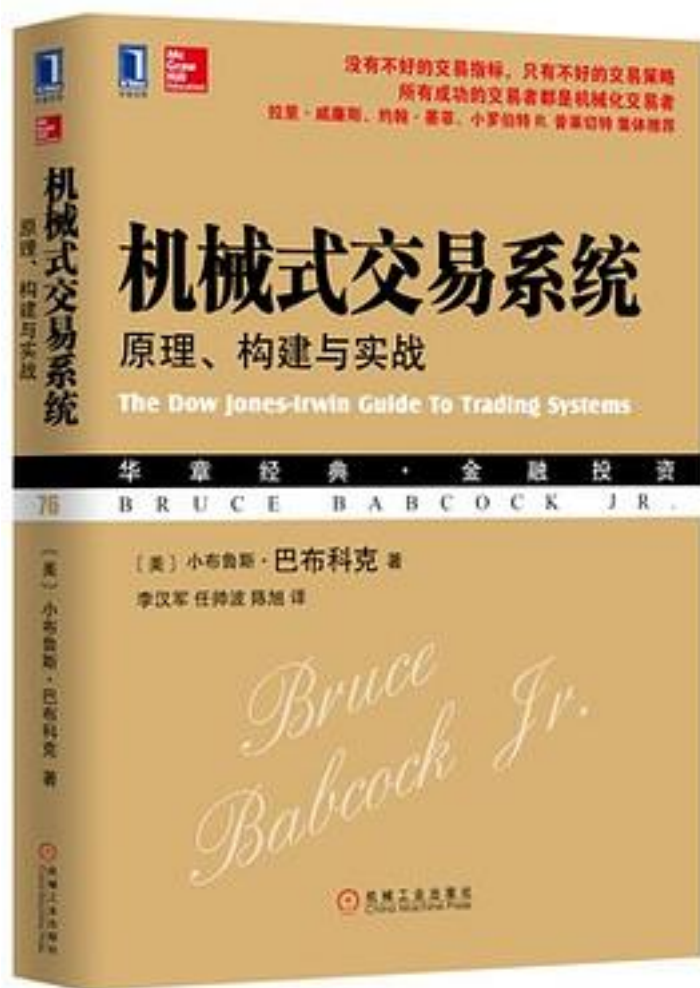


机械式交易系统：原理、构建与实战



[机械式交易系统：原理、构建与实战_下载链接1](#)

著者:[美]小布鲁斯·巴布科克 (Bruce Babcock, Jr.)

出版者:机械工业出版社

出版时间:

装帧:平装

isbn:9787111555698

本书用简单的语言解释了复杂的、通常令交易者困惑不解的最为综合和权威的理论——

创造性和机械交易系统。无论读者是否具有商品期货交易经验，都将从中受益匪浅。本书讲解了：

- 为什么投机性的交易无法持续。
- 为什么交易亏损的比率如此之高。
- 为什么一定要遵循完全机械的方法。
- 如何一步步地创建你自己的交易系统。
- 如何评估昂贵的商品交易系统。

本书可读性极强，将告诉你如何用系统的方法去分辨什么才是有效的系统。巴布科克花了5年时间，在10个市场上对各种交易系统进行了测试，在书中还为读者提供了他自己创建的简单、高效的长期系统。

作者介绍:

小布鲁斯·巴布科克是《商品交易者消费报告》的出版者，这是一份双月出版的简报，主要关注顶级商品顾问服务和长期特殊时间投资顾问简报《大型走势》的业绩。从1975年起巴布科克就一直是位活跃的商品交易者。

巴布科克已经出版了4本商品交易类书籍，与人合著《交易策略》与《高业绩期货交易》，并在《期货》杂志发表多篇文章。他还是金融消息网和国际许多商品讲座的常客。

巴布科克设计过数个交易系统，其中包括16个不同的可优化的交易系统程序、3个独一无二的交易工具以及一个为利用连续合约而设计的数据管理程序。

目录: 目录

推荐序

前言

致谢

第1章 简述商品交易中的难题 1

你从未真正买进或卖出任何商品 2

你是在押注价格的变动 3

杠杆效应 6

交易的成本 10

趋势 13

交易时间框架 18

预测市场 18

成功的商品交易的3项基本原则 22

第2章 人们从事商品交易失败的原因 23

缺乏了解 27

资金不足 30

不切实际的预期 31

缺乏耐心 32

缺乏纪律 33

厌恶高风险 34

第3章 机械式交易方法 37

第4章 机械式交易系统的创建 48

曲线匹配系统 49

非曲线匹配系统 53
系统优化 57
第5章 商品交易方法的测试 59
数据的时间周期 60
数据类型 62
测试的时间段 65
分段优化及测试 67
在不同市场测试 68
交易成本 68
测试日线数据时的特殊问题 69
评估测试结果 73
第6章 交易系统的优化 81
系统优化之圆桌会议 82
第7章 交易系统推销简史 107
第8章 流行交易方法的绩效——参考框架 129
测试的市场 129
测试时段和数据类型 132
绩效标准与方法论 132
4套流行的交易系统 134
2%转向交易系统 140
巴布科克长线交易系统 142
第9章 进场方法 147
趋势指标 148
摆动指标 153
进场触发指标 165
价格形态 171
进场概念的组合 177
第10章 设置止损的方法 181
价格（波幅）止损 184
时间止损 189
资金管理止损 192
盘中止损或收盘止损 195
转向止损 195
第11章 出场的方法 199
盈亏平衡止损点 200
跟随止损 202
固定及变动盈利目标 207
摆动盈利目标 213
第12章 交易系统和市场 217
系统规格 217
价格走势对系统绩效的影响 220
不同市场投资组合的交易 242
用丹尼斯期货评级技术同时所有市场操作 249
将交易系统用在股市 251
市场识别测验的答案 252
第13章 创建属于自己的交易系统 253
第14章 追随你的交易系统 261
贪婪与恐惧 261
持续亏损的阴影 263
低估亏损的冲击 263
交易系统在何时失败 266
交易者只想寻求刺激 268
了解运气的成分 269
第15章 资金管理 271

适当的账户规模 272
市场和交易系统的分散化 273
风险管理 275
交易多份合约 279
第16章 交易管理 280
调整交易的合约数量 280
结果 283
净值曲线的管理 292
第17章 摘要与结论 305
附录A 长期周线图（1978～1988年） 315
附录B 面包及黄油标普当日平仓交易系统 341
附录C 巴布科克长线系统的模拟交易 349
· · · · · (收起)

[机械式交易系统：原理、构建与实战 下载链接1](#)

标签

交易

机械式交易系统

量化交易

金融

投资理财

金融理论

华章经典·金融投资

trader

评论

建造者的局限（厌恶高风险）、入场、止损、出场、资金管理、执行终端的偏离。重要的环节都有覆盖。是一本帮助梳理的书。

还不错

这本书书名没翻译好，只要把 "机械式交易系统" 替换成 "量化交易"，即可大火

2018年泛读

对于构建交易系统来说，是一本值得借鉴学习的一本书。

[机械式交易系统：原理、构建与实战 下载链接1](#)

书评

[机械式交易系统：原理、构建与实战 下载链接1](#)