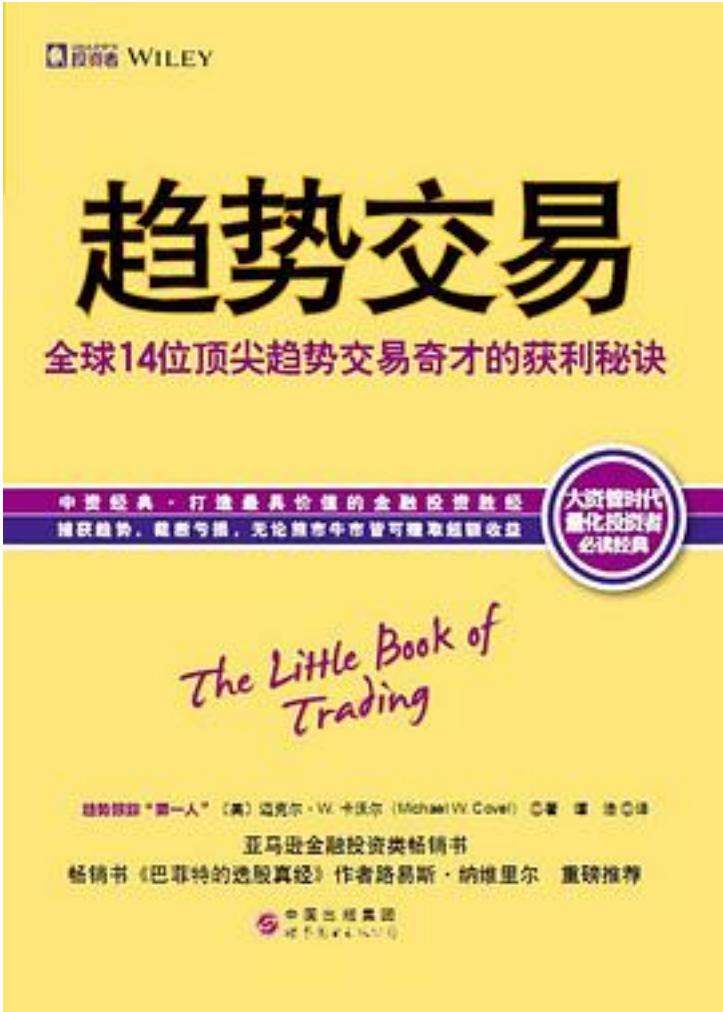


趋势交易



[趋势交易_下载链接1](#)

著者:[美]安德烈亚斯 F. 克列诺（Andreas F. Clenow）

出版者:机械工业出版社

出版时间:2017-6

装帧:平装

isbn:9787111568438

本书揭示了：

趋势交易者如何观测大量交易品种

趋势交易者如何识别有交易价值的趋势

zui适用于趋势交易的指标体系

zui简单而实用的两种趋势交易策略

趋势交易的风控方法

趋势交易的仓位控制与资金管理

总有这样一群专业的交易员能战胜市场，即便在2008年与2015年的极端市场情况下，仍然能获取持续稳定的收益。这些人大多是量化交易者，用高成本、艰深的算法与模型来交易。

其实有更简单的方法模拟他们的策略，趋势交易，就是一种好的方法。

很多书介绍了这种盈利方式，但是披露这种具体策略的，这本是不可多得一本。

作者介绍:

安德烈亚斯 F. 克列诺，特许市场技术分析师，位于苏黎世的ACIES资产管理公司投资组合经理，Equilateral资产管理公司合伙人（这是一家投资顾问公司），Globalanced量化交易师。毕业于瑞典歌德堡大学，拥有经济学与商法方面的硕士学位，在进入对冲基金行业之前，曾在路透社任职，担任过路透社咨询公司北欧金融工程团队经理，期间主要负责量化分析顾问咨询工作，之后在路透社证券与商品期货分析公司担任国际经理。他精通于多投资品种量化交易策略分析，资深的CTA投资经理，在股票、股指期货、商品期货等领域上有着丰富的经验。

目录: 目录

推荐序

前言

致谢

第1章 利用期货实现跨资产的趋势交易1

分散化趋势跟踪策略的简单介绍3

传统的投资方法5

分散化管理期货的实例9

针对趋势跟踪策略的批评10

以管理期货为生12

个人投资与以交易为生的区别16

第2章 期货交易所需的数据和工具21

期货应当被视为一类资产22

期货的数据29

期货板块的划分37

必要的工具51

第3章 构建分散化的期货交易策略55

他们所有人做的都是同样的事情56

解密趋势跟踪策略的魔盒62

第4章 两种基本的趋势跟踪策略72

策略表现74

对于现有策略的改进	84
第5章 趋势跟踪策略表现的深度分析	101
策略的表现情况	102
成为股票投资的有益补充	104
交易方向的选择	107
不同板块的收益贡献	110
现金管理和来自政府的“免费午餐”	114
恰当地理解“杠杆”的含义	119
第6章 22年的回顾（1990~2011年）	123
如何阅读本章的内容	125
1990年	125
1991年	132
1992年	137
1993年	142
1994年	146
1995年	152
1996年	156
1997年	162
1998年	166
1999年	171
2000年	176
2001年	181
2002年	187
2003年	191
2004年	196
2005年	201
2006年	206
2007年	211
2008年	216
2009年	223
2010年	228
2011年	233
从22年的历史回顾中所总结出的结论	238
第7章 反向破解竞争对手的策略	240
投资品种池	241
不同品种池的比较	246
破解当世基金的策略	248
结论	261
第8章 一些改进的小技巧	262
同时捕捉不同时间尺度的趋势	263
合成期货的交易	265
添加逆势交易的元素	266
日内止损	267
相关性矩阵、持仓限额与风险控制	270
展期效应	272
模拟优化的缺陷	273
第9章 一些期货交易上的务实问题	275
资金规模的限制	276
交易的执行	278
现金管理	280
亏损时的业绩波动更为剧烈	282
投资组合监控	283
后续管理	283
第10章 最后的忠告	285

期货基金日薄西山的盈利能力286
小心别在阴沟里翻船288
设置初始的风险水平289
参考文献291
· · · · · (收起)

[趋势交易_下载链接1](#)

标签

投资

趋势交易

交易

金融

股票

期货

技术分析

量化

评论

超短交易#对于超短选手而言，收盘后账户股票涨停、红盘是非常常见的，当然也会有大面-15%的，这些都是正常现象，因为每一种交易系统都有容错空间，试错的工作包括买错，卖飞，被套，市场的游资也有亏成孙子的时候。但是从长期的交易看，大面通常发生在市场末期转折点，那时候仓位管理比起天天涨停还重要。我们的原则是，市场初步反攻全力配合，市场高潮后乏力提前溜。

分散交易策略，不过更侧重于基金的管理。另，使用在股票上的不佳绩效可能是因为选择投资了股指标的。

内容很硬

资产配置

就像这本书说的，圣杯不复杂，但很多人确实做不到。

《海龟交易法则》《趋势交易》，学习趋势交易，看这两本就够了。

牛逼，很多结论不谋而合~

想起大三时候看的一本书《Orange'S:一个操作系统的实现》。超5星

无用

四星半 很有诚意的一本书

没看到像评分那样的好，可能不符合我的交易系统吧

感觉还行，但好像不适合A股，

绝大多数内容确实说服了我

实用

对理解趋势交易很有帮助。以及对基金管理和交易也有了了解。

这是一部操作指南，即使你不是趋势跟踪的做法，也应该借鉴投资的过程和各个步骤

信自己，推荐人的话不能信，即便他写过好书

趋势交易是反人性的，不管平均年化收益率看上去多么平滑而又迷人，收益背后的惊人回撤、亏损、自我怀疑才是更应该去着重解决的。

核心假设：金融市场总是倾向于相当长的一段时间里按照同一方向运动。
趋势+资产配置 08年的那一段，有很大的启发价值。

对于非专业人士来讲对交易系统的测试篇幅实在是太长，看了一半只记下了结论

[趋势交易_下载链接1](#)

书评

这半个月加快速度阅读了《趋势交易》这本书，受益匪浅。试着复述其交易系统如下：

一、交易品种
交易品种：农产品、非农商品、汇率、证券、利率等五个板块50个等权重品种池
交易方向：做多/空 二、建仓规则 （一）趋势过滤(双均线)：
1、只有MA50>MA100，才能做多； 2、只有MA...

!!
没想到，那么多年的趋势交易经验要点，尽然基本被这本书写光了 !!!!!
!!

[趋势交易 下载链接1](#)