

交易风险管理



[交易风险管理_下载链接1](#)

著者:肯尼思·格兰特

出版者:万卷出版公司

出版时间:2010-4

装帧:

isbn:9787547007181

《交易风险管理:通过控制风险提高获利能力的技巧》是老生常谈了——不过很少有人去质疑——证券交易员如果过度冒险是自寻死路。但正如肯尼思·L.格兰特在《交易风险管理》中所说。基金经理和个人投资者如果不冒一定的风险就会失去很多机会。赚些蝇头小利固然也不错，但他们将永远难以赚大钱，把投资者的资产组合推进到一个新的水平。证券交易员需要的是一套可靠的风险管理技术——从而使他们能够充满自信地进行大笔投资，实现他们的预期目标。

许多职业交易员往往受制于企业整体的风险管理规则，使其成长受到限制；而个人投资者常常会面对门乎需要博士水平才能看懂的，满是计量公式的投资书籍而不知所措。这两类交易者往往默许一些主观的、松散的经验规则。而格兰特的交易体系则是一个简单而有效的解决方案——它剔除了许多主观色彩的东西，使交易者避免因主观判断而面临巨大的交易风险。

格兰特用一套极其简单的算术和统计工具，形象地说明了什么样的投资组合才有效。他接着告诉你怎么控制风险——有时投资不太理想是不可避免的，这要事先做好准备.避免遭遇灭顶之灾。格兰特还帮助您设计投资组合的构成.并讨论如何做到使这种组合与您的财务管理和风险管理的目标是一致的。

点击链接进入英文版：

Trading Risk: Enhanced Profitability Through Risk Control

作者介绍:

目录: 译者序

前言

致谢

第一章 风险管理投资概述

第二章 设定绩效目标

第三章 理解不同时期的盈亏模式

第四章 单个组合的风险构成

第五章 确定适当的风险水平（法则一）

第六章 调整投资组合风险（法则二）

第七章 单个交易的风险构成

第八章 放开手脚，大胆尝试

附录 最优f值与全损风险

• • • • • [\(收起\)](#)

[交易风险管理_下载链接1](#)

标签

交易

风险管理

投资

金融

股票

投机

已购

资金管理

评论

深入浅出，很實用的風控好書！值得花錢買紙書。注意第七章，里面提到為什麼需要提高交易頻率。

有点失望，只是介绍了一些风险预测的工具而已。不过，这依然是一本值得读的书。即使不使用这些具体的工具，至少要考虑过这些风险控制思想。只是要注意，风险预测用到小数点，基本上也是为了表现幽默感。不要迷信，不要不信。风险跟其他许多经济数据一样，都是长期不可测的。不要觉得一切尽在掌握。

不是风险管理，是波动性管理吧。一颗星给作者的简历

马桶书。。。。。

理论学术性

还行 书内容不多 浅显不深

亏损时降低风险。各种评估。方法上：设定目标->倒夏普计算最大回撤->用VaR衡量每日风险，让每日风险 $\leq 10\%MD$ 。大体如此。

风险管理的书也不少了，重要的是要做到

用数据统计的方法来作为一个综合报告，的确可以让我们从历史中找出自己的优势和缺点，这一点对于分析我们以前的业绩具有很好的作用。但历史和未来是不同的，这些东西只能作为一种客观的存在，而不能用来预测未来。

现在的交易平台通常都会提供报表工具，全方位的解析账户状况。而这本书，只能算是一些专业名词解释的字典吧。基本上，我个人用IB提供的账户风险分析工具，很棒。

账户分析报告没书里讲得那么复杂

启发了我建立资产组合风控体系的思路，不过我仍然非常厌恶频繁交易

枯燥啰嗦

虽然我没有从这里获得什么具体的风险管理技巧，但是它给我开启了一扇通往风险管理的大门。我将依据这里获得的思想建立自己操作系统相关的风险管理体系。

二十年来读过的所有投资类书籍中最好的一本，没有之一。它是由一个诚恳的、对交易有深度认知的人所写。

[交易风险管理_下载链接1](#)

书评

风险管理类的书确实不多，这本又是百度直接推荐的，就买了，看了近40页实在看不下去了，翻译很憋足，绕来绕去也说不明白～～全书的排版逻辑性差、作者的专业水平我不好评价，本人水平不够，但是写作能力真的不敢恭维，书本的引入用了一首《流浪啊，流浪》，极度无厘头，我很嗜...

主要描述了机构级别的风险控制是怎么一回事，大致说了一下VaR分析和其他分析方法。问题是，公式太少，而这些东西用大白话又没法说清楚。另外，这本书里面的方法执行成本有点高，需要动到的市场和产品对小散户来说也是过于奢求，估计只有大户或者机构用了。语言风趣幽默，故...

[交易风险管理_下载链接1](#)