

《日内交易策略》

图书基本信息

书名：《日内交易策略》

13位ISBN编号：9787547006108

10位ISBN编号：7547006108

出版时间：2010-1

出版社：万卷出版公司

作者：戴维·班尼特

页数：171

译者：张意忠

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.tushu111.com

《日内交易策略》

前言

本书是针对大豆、小麦和玉米（即“谷物”）期货交易的。这些合约在芝加哥商品交易所（现在在美国芝加哥商业交易所集团的一部分）上市交易。本书仅考虑电子合约，因为不论在哪里，只要有可靠的互联网接入，任何人都可以有效地进行交易。严格说起来，大豆是油料作物，不是谷物粮食类，但在本书中不愿称它们为“谷物和油料”，那样有点拗口，我简称它们为谷物。本书不讨论权证、价差合约、价差赌注以及任何别的金融衍生品种，书中大部分内容是关于谷物期货交易的。事实上，有些跟我学习交易技术的交易者成功地把这些技术应用到普通股票交易中。本技术分析方法不局限于某一个金融市场。虽然本书集中讨论日内交易（不是持仓过夜），但这纯粹是我个人偏好。没有什么东西阻止本技术分析方法应用到其他时间结构中去识别交易机会和管理交易过程。简言之，本书全是关于我如何在日内交易谷物期货，但我所采用的技术分析方法可以广泛地应用在绝大部分市场和时间结构中。一些交易者或许希望看到我对更多交易技术的描述。但是别忘了，市场中存在着无数的交易风格和交易策略。而本书起源于一个项目，目的是确切地逐日记载我在市场交易时具体做了什么，和我为什么那样做。它着重描述的是我采用的交易风格和交易策略，而不是包罗万象。

《日内交易策略》

内容概要

《日内交易策略:谷物期货交易实战指南》是一本非常实用的介绍技术交易策略的书籍。作者详细展示了在日内进行谷物期货交易所需要的一切。前几章阐明了作者偏爱芝加哥商品交易所谷物期货品种的理由，以及为什么只选择了在日内交易的原因，随后解释了交易的根本基础，并详细介绍了作者选定的这个日内交易策略。

在跌宕起伏的实盘交易中，对于日内交易者的挑战是如何利用有限的信息尽快识别具体的支撑和阻挡区间，同时辨别趋势的潜在方向。作者描述了他自己奥体是怎么做到的，也有详细的插图和实际交易的案例作为参考。然后他用开盘之初简单而有限的信息，具体阐释了他如何确定止损和止盈价位。

《日内交易策略:谷物期货交易实战指南》的一个重要特色是作者曾用一整章的篇幅，专门追踪记述了一个完整交易日的具体交易过程。它使用大量的屏幕截图展示了如何在实践中具体应用作者的交易策略，给予读者一种完全明了的切身体验。

作者在另外一个大量使用插图的章节，展示了连续一个丹每个交易日的蜡烛圈，对于每个交易日作者都进行了交易出入场的具体描述。给读者提供了一个检查这个日内交易策略长期收益情况的机会，当然也让读者体验了必定会有的某些亏损日的心理折磨。作者把整个交易过程总结为：严格执行简单交易计划的持续重复。

在别的章节，作者概述了以具体实践需要为根本的观点，而且在计算机和网络设置方面，提出了一些应当引起交易者注意的重要建议。

《日内交易策略:谷物期货交易实战指南》的焦点是在突出谷物期货存在的令人欣喜的交易机会的同时，详细介绍作者亲身实践的技术交易策略，也表明了这个交易策略对于每个期货品种、股票、债券、权证和价差合约的交易者而言，是一个非常宝贵的财富。

点击链接进入英文版：

[Day Trading Grain Futures: A Practical Guide to Trading for a Living](#)

《日内交易策略》

作者简介

作者：(美国)戴维·班尼特(David Bennett) 译者：张意忠

戴维·班尼特，是一位生活在澳大利亚黄金海岸的农产品期货交易商，他从事教学、人力资源管理等工作，但他钟情于交易。“在很多年我尝试过我听过的所有的交易，但结果都很平庸，后来我开始交易农产品期货——我便再未回头过！”戴维拥有三个国籍：英国、新西兰、澳大利亚，他不断追逐着太阳生活。戴维成为一个大型养老基金的董事主席。同一些专业基金经理人一起工作的时候，他开始对交易与金融感兴趣。他认为要保持身体健康、才思敏捷，就要尽量多花时间进行跑步、游泳、瑜伽等运动。

《日内交易策略》

书籍目录

译者序

前言

引言

1 简介

2 为什么选择交易谷物期货

3 为什么选择日内交易

4 全是赌博

5 全是关于风险管理

6 我交易什么

7 投机交易者做什么

8 图表

9 支撑和阻挡

10 入场准则

11 交易管理

12 计划实施

13 我的交易计算器

14 我的交易屏幕

15 案例研究

16 交易一整月

17 实践的重要性

18 计算机设置

19 交易日常工作

参考书目

索引

章节摘录

全是关于风险管理我一旦在期货交易中开仓，我的资金就在那跌宕起伏的价格线上了。期货是杠杆化的交易品种，因此，如果我不采取合适的预防措施，我可能很快输掉比实际占用的保证金多得多的钱。你或许已经注意到，我对于杠杆化的投资风险有一个清醒的认识。如果你还没有这种警觉，就贸然进入这样的市场，它迟早会给你一个教训。不要用最艰难的方式学习。充分的硬件配置风险管理的某些方面更多的是一个纯粹常识的问题。例如，我需要确保我的交易硬件配置像它能够做到的那样可靠，以及如果意想不到的事情发生，我已经有应急预案去对付。这就像为诸如下面这个问题准备好答案：如果网络连接失败，我该如何处置？（我在第18章会探讨硬件配置方面需要注意的问题。）

交易必设止损风险管理的另一方面更多的是关于具体的交易策略。我下单必设止损。止损不是一个完美的保障机制，但在我看来对于意想不到的事情它仍然是最可靠的保护措施。恪守纪律的交易者在下单之前都明确地知道止损要设在哪里。那么为什么不立即下止损单呢！我不是一个完全靠心理感觉来止损的爱好者。一则，交易者或许没有在最适合的时间采取止损，或者相对快速变化的市场，止损反应较慢，或者（这比较恐怖）网络连接在这最关键的时候突然断掉了。止损单成交容易是我偏爱日内交易的另一个原因。在快速跳动的市场条件下，我的止损单通常在与指定价格非常接近的位置被触发成交。相反，如果市场开盘跳空，一个较长线交易者的止损单很容易在距离目标价较远的位置被触发成交。一次赌注多大？在每一次交易中，最基本的风险管理概念是下一个多大的赌注。我下的赌注越大，我能挣的钱越多，或者亏掉同样的钱。如果在每一次赌注中都押上所有的资金，当碰到我的第一次不可避免的亏损时我就会爆仓破产。那么，我应该怎么做呢？我应该把每一次赌注刚好限制在我所有资金的50%，或者25%，或者10%吗？一些自杀式交易者以直觉为基础提倡百分比风险，比如说，“10%应该就行了”，或者依靠一个被称为最优值的数学计算。但是永远不要忘记：即使一个交易策略在一半的交易次数中能够盈利，从长远来看，它仍然会有连续失利的时候。迟早会有一连串五六次的持续亏损。如果你刚开始你的交易生涯，每次交易都冒你所有资金10%的风险，结果遇到了五次连续的亏损，试想一下你感觉会怎么样？我告诉你，你会感觉糟透了。你或许会放弃交易，或者开始采用另一个不同的交易策略，因为“这个不行”。（不要忘记：墨菲法则说当你停止使用它的时候，这个策略就开始了一连串连续盈利高峰。）

《日内交易策略》

编辑推荐

作者以一种简洁、精准的方式，向读者介绍了一些永恒的交易理念，也同时展示了如何将这些理念融入到一个具体的交易策略中，去出击那个充满惊喜的谷物期货战场。没有晦涩难懂的指标，也没有复杂异常的数学模型，作者在行之有效的交易原则基础上，创建了他自己的日内交易策略系统，并配有明确的资金管理策略。

《日内交易策略》

精彩短评

- 1、震荡的时候，我一般旁观：)
- 2、这套书可以的
- 3、突破法，我的至爱，关键是掌握仓位吧，小形态小突破小仓位，大形态大突破大仓位。现在我喜欢15分钟小突破小仓，60分钟大突破大仓，做得还可以。唯一一天仓位不正确，来回震荡的话，的确让人吃亏，但整体此方法是我认为最好的方法。在区间内做赌注的话，盈利可能增加，但成功次数会大大降低，毕竟我们不是半仙。
- 4、实用
- 5、系统非常简单，2分钟k线，新高/低后打开保险等回调，再创新高/低后顺势入场，按波动区间的倍数（0.5/1.5）止损止盈。资金管理是每次赌1.5%。

这真是个简单的策略，不过很有意思。入场策略不怎么样，应该比随机入场好不了多少（作者也说了，这个系统的胜率是55%，不知道他的样本有多大，我的感觉是这个多出来的5%也多半来源于抽样误差），有意思的是小的风险资本（1.5%，比大多数交易类书籍推荐的都少）和强制止损止盈带来3：1的赢损比，然后就是一天只做一次交易。

估计最要紧的，就是那个1.5%和每日一次交易吧。前面一个好说，后面一个我还得想想。

前几天做了一下模拟，独立同分布，50%的胜率，在连续100次模拟中，出现连续10次失败的概率是20%，这显然不是一个可以忽视的概率了。更何况我现在胜率还不到40%，然后交易的，还都是相关性很强的品种，ft。看来1.5%的风险有点道理。

回到这本书上来，我感觉作者还是上自动交易系统算了，他这套策略半个小时就可以编出来干活了，何必浪费人力去手动更新excel表和交易啊.....

最后想说，这本书真是薄啊，虽然打完折后价格还算厚道。

- 6、作者的方法其实就是2分钟k线开盘分型突破，止损放在分型的底部/顶部

找支撑/阻力，顺势，止损止盈

如果你情绪化，如果你反应不够快，你会死很惨。

这本书虽然很薄，但其实可以更薄，也就一页纸够了。好在描述清楚，图片清晰，调理清楚。

- 7、还不错。作者讲述了其怎样通过IB的TWS来交易美国谷物市场的3个期货品种。作者很详细的描述了他用的日内交易策略。当然如果你要将该策略用于国内谷物品种的话，还是要先测试再说 呵呵
- 8、就這麼點東西好意思寫一本書嗎？
- 9、1.2分钟k线做突破2.止损和止损定量化3.严格的交易规则和plan b
- 10、在开盘形成一个分形后在突破分形的最高价做多，跌破分形的最低价做空，

=====

成本比较高一点，遇到震荡市或炮弹头（即反向的，涨前先跌一波或跌前先涨一波）就亏了。好处是所有正规大区间都不会逃过，都做得好。---会枉不纵。

- 11、今天内盘60分钟，很多品种都新高突破了。呵呵。
- 12、胜率和期望值是两回事，胜率即使低于30%也不能简单断定一套系统的期望值。
- 13、在中国还不太可行
- 14、干PP就靠他了
- 15、突破交易法应该是短线获利能力最强效率最高的方法之一。

《日内交易策略》

- 16、但30%的胜率的话，对资金和仓位管理是一个比较严峻的考验，因为连续失败的游程比较长，不能熬完整个回撤难说。大于50%的回撤一般是肯定无法接受的。
- 17、日内交易策略:谷物期货交易实战指南
- 18、真正实务性图书，胜过市场上99%的其他同类书籍！
- 19、我也认为胜率不太重要，收益率才是赢利的基础，华尔街最顶尖的交易员胜率也不过百分之三十多，交易系统就是要由全局考虑才有意义，如果接受不了也没办法，这也许就是一般人炒股大多都亏的原因吧。。。
- 20、相对朴实安全的交易策略，突破买入，标准波称范围的设置和做好止损是交易的一致性得以延续的保证。8到11章值得精读，适合初学者。
- 21、境界，到了，就飞花摘叶，也可伤人救世了。。。。
- 22、也是我亏最大的方法。特别在震荡中，来回刷。
- 23、嗯、Rover，迟点找你们聊，近来超忙。
- 24、万卷出版社，垃圾出版社
- 25、突破 标称波动范围
- 26、原理很明白，就是缺乏操作性
- 27、本书最大的用处在于处理一些突发事件 比如设备 开盘前的准备 收盘后的检查
- 28、re中华小快板。嗯。今天的豆粕，和pta正好是正反两个例子
- 29、阻力支撑——趋势——奔跑、止损
- 30、简单明了。
- 31、短線突破做單，方法很實用，在國內可以嘗試用5分鐘線做一做
- 32、突破入场，1：3出场，简单诚恳的策略，我要测试
- 33、震荡我在箱体边缘对赌
- 34、原则比技巧重要
- 35、用的是K线，其实本质上是道氏理论
- 36、在国内竟然还能用。。。可惜大家都视而不见。。。
- 37、突破交易法
- 38、喜欢几个内容：
 - 1、交易的三个核心要点：支撑和阻挡、趋势、让利润奔跑和截断亏损；
 - 2、用excel实现日内交易的资金策略；
 - 3、对IB公司的交易平台TWS的介绍（基于IB的客户，非IB的客户也有很好的参考价值）；
 - 4、用订单组合实现自动化的交易策略；
- 39、这个玩意儿当枕边书，我也太不浪漫了吧。。虽然写得简单了点，但看完还是有收获的。
- 40、：
F830.9/1172-2
- 41、2分钟的日内操作。其实没什么大花头，精华就一句话“我所有的交易都来自于一个阻挡被突破（做多）或者一个支撑被击穿（做空）。”设定大止盈小止损单，让浮盈飞翔让止损可控。纪律纪律啊！看人家是怎么遵守纪律的！但人家一笔单子可以止赢止损市价卖，国内却只能择其一，也是影响遵守纪律的障碍之一。
- 42、实际上，在<http://tradingcalculator.com.au>(书中使用的计算器的下载网址)提供了一种已经开发出来的自动交易程序TradeOnAuto
- 43、西方人总爱使用突破交易法，本书作者日内交易也是使用突破交易法，在开盘形成一个分形后在突破分形的最高价做多，跌破分形的最低价做空，一旦盈利后立马设保护止损。此法在国内商品市场也就是大区间日战法了。作者的保护止损设置有可取之处。
- 44、比如前几天的eur，就是荡来荡去。用极小的仓位再做，微亏。昨天抓到很大的一波趋势，不仅把亏的赢回来了，还盈利不少
- 45、策略很实用 值得反复论证
- 46、读过三遍。简短精悍的小书，包含了一些技术分析和系统交易最基本的原理。
- 47、哈哈，你们又在这里讨论过了。最近很久没有听到布鲁斯的声音了
- 48、很好的股票书

《日内交易策略》

49、美国期货散户的交易心得，可参考。

50、第三章说日内交易跟隔夜交易的区别有点用处；第十章的交易策略还好，但是他所谓的波动率R不太科学，还不如用ATR，而且实际测试中效果并不太好<http://book.douban.com/review/4756963/>

51、3.5星，一种超短线赢家策略的展示，清晰简单易懂。

52、适合初学者,不过书中完全忽视了成交量的影响.15,16章挺不错,我都扫描下来了~

《日内交易策略》

精彩书评

- 1、还不错。作者讲述了其怎样通过IB的TWS来交易美国谷物市场的3个期货品种。作者很详细的描述了他用的日内交易策略。当然如果你要将该策略用于国内谷物品种的话，还是要先测试再说 呵呵
- 2、系统非常简单，2分钟k线，新高/低后打开保险等回调，再创新高/低后顺势入场，按波动区间的倍数（0.5/1.5）止损止盈.资金管理是每次赌1.5%。这真是个简单的策略，不过很有意思。入场策略不怎么样，应该比随机入场好不了多少（作者也说了，这个系统的胜率是55%，不知道他的样本有多大，我的感觉是这个多出来的5%也多半来源于抽样误差），有意思的是小的风险资本（1.5%，比大多数交易类书籍推荐的都少）和强制止盈止损带来3：1的赢损比，然后就是一天只做一次交易。估计最要紧的，就是那个1.5%和每日一次交易吧。前面一个好说，后面一个我还得想想。前几天做了一下模拟，独立同分布，50%的胜率，在连续100次模拟中，出现连续10次失败的概率是20%，这显然不是一个可以忽视的概率了。更何况我现在胜率还不到40%，然后交易的，还都是相关性很强的品种，ft。看来1.5%的风险有点道理。回到这本书上来，我感觉作者还是上自动交易系统算了，他这套策略半个小时就可以编出来干活了，何必浪费人力去手动更新excel表和交易啊.....最后想说，这本书真是薄啊，虽然打完折后价格还算厚道。
- 3、喜欢几个内容：1、交易的三个核心要点：支撑和阻挡、趋势、让利润奔跑和截断亏损；2、用excel实现日内交易的资金策略；3、对IB公司的交易平台TWS的介绍（基于IB的客户，非IB的客户也有很好的参考价值）；4、用订单组合实现自动化的交易策略；
- 4、西方人总爱使用突破交易法，本书作者日内交易也是使用突破交易法，在开盘形成一个分形后在突破分形的最高价做多，跌破分形的最低价做空，一旦盈利后立马设保护止损。此法在国内商品市场也就是大区间日战法了。作者的保护止损设置有可取之处。

章节试读

1、《日内交易策略》的笔记-第1页

我是做程序化的，正好看到这本书，于是把他的方法代码化了。
但是在写之前就发现问题：这个方法在碰到开盘跳空，或者连续拉升下跌的时候，往往会在最差的时候入场。

测试下来确实如此。

我拿股指做的测试，数据从2012年1月1号，手续费设的1%%，一天只做一次。

分别按固定一手交易，以及按书中的百分比方法，设20万资金，每次止损2%本金计算开仓。

效果都不咋样，如图。

不过他有的思路倒是可以借鉴，只是入场点太慢了。

胜率确实如作者而言，根据其调整r来控制。如果设置的小，胜算可以很高，但是亏钱。。。2%止损动态仓位固定1手

2、《日内交易策略》的笔记-第20页

短期价格曲线不可能与长期价格曲线有明显区别。去掉那些标注时间和价位的数字，把一幅单个交易日的2分钟图和一幅涵盖几年的月线图放在一起，我相信那些评论家也找不出二者的区别。它们同样显示了趋势、支撑、阻挡和空间范围等等。

日内交易的真正问题是交易费用。

《日内交易策略》

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.tushu111.com