

《天才數學家的秘密賭局》

图书基本信息

书名：《天才數學家的秘密賭局》

13位ISBN编号：9789578036772

10位ISBN编号：9578036779

出版时间：2008

出版社：平安文化有限公司

作者：威廉·龐士東

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

《天才數學家的秘密賭局》

內容概要

《天才數學家的秘密賭局》

作者簡介

《天才數學家的秘密賭局》

精彩短评

- 1、在淘宝买到了正版的台版书，才29人民币。而孔夫手上的二手书要价十倍。
- 2、已经想了很久了
- 3、揭露了投資學最重要的唯一一件事

《天才數學家的秘密賭局》

精彩书评

1、资金管理模式Optimal f最佳f值。Optimal f，最佳f值，是由Ralph Vince所提出的。主要是针对Kelly Formula改善而来的，目的是算出可以获得最大获利的风险资本比例。而且通常算出来的值会比 Kelly Formula还要更积极更大胆。所以资本所冒的风险也会更大。所以一般不会真的拿来作交易所使用，也是只有拿来当作教学和与其它资金管理比较之用。下面这一段是两位高手网友Steven(ezbentley) 和思沐就 Kelly formula 和optimal f的响应，贴出来给大家参考

：=====ezbentley于2009/02/10 03:24 回应另外想补充一下Kelly Formula是很有突破性的发现但是他只适用于Bernoulli Distribution也就是Distribution的结果只能有两种(WL跟Pw都是固定的)在真正的交易中, WL跟Pw都不是固定的所以严格上来说, Kelly Formula是不能应用在交易上的以上的限制Ralph Vince在他的书里也有提到所以他提出了Optimal f(optimal fixed fractional trading)的建议Optimal f的精神其实跟Kelly Formula是很接近的只是那个Optimal f的值只能用历史回测得到不能用公式来计

算=====思沐于2009/02/12 03:37回应抱歉一时没注意到ezbentley 兄的问题，我指的是Fortune's Formula这本书，中译为天才数学家的秘密赌局。这本书后半反复辩证才华洋溢又言词犀利的萨缪尔森对夏农/凯利准则的批判，初看时也疑惑难解，难道在没有破产风险的情况下追求毕生最大报酬率有错吗？同为工程背景的对天才夏农充满景仰，也很喜欢凯利准则的精简美丽。我的经济学涵养则不足以评判或完全了解萨缪尔森的微言大义，或许萨缪尔森并非说这公式理论错误，而是结果并非大家真正想要或承受的起的，他认为凯利准则过度规避微小的破产风险，致富后却又过度追求多余的利润。矛盾吗？举例来说：某甲先生与乙先生期初资本相同，数年后甲用某方式稳定获利至一千万，乙则利用凯利准则先大赚至1亿再回跌至两千万，您认为谁会比较满足他的财富？让您选择重来一次您又希望是谁？很吊诡的，较富有的乙先生恐怕要经常活在悔恨当中，不断为他逝去的巨额财富伤心不已，即便他的财富仍多于甲先生，即便他的生活应不虞匮乏。面对未来乙先生不太敢消费，因为他不知道剧烈波动的财富会不会在他需要用钱的时候出现大幅回测，不破产并不代表财富不会落至贫穷线以下。甲先生财富虽不完全满意但可接受，他敢于支配并规划生涯享受人生，...凯利准则让财富大致呈指数增加但波动剧烈，人的满足感则未必是指数型，一毛不拔的富翁与出手爽快的穷人我都见识过，理财方式在不同阶段不同人身上都应有所差别，经济学家考虑的是社会心理人生，物理学家工程师追求的是完美极致，就让真正明白真相的人自由选择吧！但,请不要高估考验来临时自己的承受能力！有趣的是物欲极低又天真烂漫的夏农晚年成为富翁，凭借的却是基本面内线消息集中持股长期持有策略。巴菲特年轻时与夏农赌博套利集团核心人物索普切磋骰子机率问题，深明避险基金套利机率技巧，却常只让外界知道他对公司价值投资的一面。持反对冒进立场的萨缪尔森子弟们间接利用索普与前人的技巧完成衍生性商品定价理论，却无形中埋下这次金融危机的引子。只能说随机人生还真是难以预测啊！

2、于是我机智的买了台版。翻译自不用说，闭着眼睛都知道比简体好。总之我看的很流畅。这书嘛，含金量非常高，但你挖不挖的出来，就看造化了。最有意思的是，全书讲一个策略，最后却说主角靠的不是这个策略赚大钱，而是靠人尽皆知的财务基本分析，哈哈。

3、这本书还没有看完，不过非常有趣。主人公有数字计算机理论的创始发明人香农（他发明了熵(entropy)的概念，他证明熵与信息内容的不确定程度有等价关系）总之是非常了不起的人物，不过他却没有花更多的时间在科学研究上，而是去研究玩具和自己感兴趣的东西。另外一个数学家找他研究打败21点的策略（这是他的博士论文）和如何预测轮盘赌的落点。他们最后研究成功，并有黑帮资金支持。来支持的黑帮老大，靠赌马和经营停车场起家。后来为洗白自己，收购公司上市。这家公司居然是华纳兄弟。

《天才數學家的秘密賭局》

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