

《計量技術操盤策略》

图书基本信息

书名：《計量技術操盤策略》

13位ISBN编号：9789861570099

10位ISBN编号：9861570098

出版时间：2004年11月

出版社：McGraw-Hill

作者：Lars Kenstner

页数：268

译者：寰宇證券投資顧問公司

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

《計量技術操盤策略》

內容概要

深入觀察當今頂尖的技术交易系統，告訴你如何把它們納入你個人的交易系統內。並配合先進科技與歷史資料，讓技术分析者能夠憑藉直覺控制交易結果而迅速認賠，讓獲利持續發展。本書探討目前最常用的一些有效系統，告訴你如何運用計量方法的優點，提升進場與出場的時效與風險管理。本書主要内容如下：

如何建構、測試與運用交易系統。

介紹最常用的交易系統，並列舉其歷史檢定績效。

根據最佳信用擴張程度執行資金管理的方法。

本書準備探討計量交易策略對於市場時效拿捏的能力。計量交易策略結合了技术分析與統計分析，藉以產生買賣訊號。這些訊號來自於價格型態，或來自於市場價格構成的某種指標的複雜讀數。交易策略設定之後，我們利用歷史資料檢定（測試）其績效，藉以確認交易策略是否有效。績效經過檢定之後，我們挑選一些市場實際進行交易。操作分散性的投資組合，可以在特定期望報酬水準下，儘量降低風險。發展觀念，測試歷史績效，然後挑選市場進行交易，這是有效整合交易策略的少數幾種技巧。雖然有不少書籍曾經談到上述發展程序的某些領域，但我相信本書是觸及交易程序所有層面的第一本專門著述。

本書特色：

本書主題是發展有關金融資產買、賣的交易策略，同時管理這些部位的風險。

探討計量交易策略對於市場時效拿捏的能力。

本書的論點都有歷經時間考驗的統計數據作為證據，並以圖表說明實際操作績效。

本書準備回答的問題，目的在於增進對市場行為的了解，並利用這些資訊提升投資或交易的獲利能力。

謝辭

前言

第一篇 增進技術交易的結構性基礎

1. 記量交易簡介

2. 統計學簡介

3. 建構交易策略

4. 評估交易策略績效

5. 投資組合績效

6. 參數最佳化程序

第二篇

7. 檢視目前可共運用的策略

謝辭5

前言7

8. 進場、出場與濾網的新觀念

9. 一些新市場

10. 投資S&P 500

11. 資金管理新技巧

12. 解決交易拼圖

結論

參考書目

《計量技術操盤策略》

作者簡介

Lars Kenstner

任職於花旗與投資銀行擔任投資部門副總裁，他的主要重點在為花旗銀行和它的主要客戶操盤。Kestner 寫有很多有關投資方面的文章，也是A comparison of Popular Trading Systems的作者。

精彩短评

1、 WTF !!!

《計量技術操盤策略》

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