

书接上回，当我们有了基础的期货知识、一定的技术分析能力和正确的交易理念之后，我们想要去开发一套能够为己所用的交易系统并用于实践，那么如下几本书会对我们有所帮助。

首先是《海龟交易法则》，作者柯蒂斯·费思。

优秀的交易员究竟是天生的还是可以后天培养的？

当交易大师理查德·丹尼斯和他的朋友威廉·埃克哈特，在新加坡的一个海龟养殖基地度假时，也讨论起这个话题时，他们决定不做嘴炮，而是拿出真金白银，挑选10个对交易一无所知的小白，传授他们自己的交易系统，每人100w美元，让他们去实盘操作，看看最终结果如何。

这些被选中的幸运儿被称之为“海龟”，发起人理查德·丹尼斯宣称：“我们要培养交易者，就像新加坡人养海龟一样。”

柯蒂斯·费思无疑是最成功的海龟。交易记录显示，年仅19岁就加入了海龟计划的费思先生大约为丹尼斯赚了3150万美元。

多年后，作为事件亲历者，费思写下了这本《海龟交易法则》。书中前半部分详细介绍了整个实验的过程，揭示了丹尼斯和埃克哈特如何在短短两周之内把普通人训练成为杰出的期货交易员。后半部分则是干货满满的重点，作者用详细介绍了海龟参与的一些最重量级的交易，以及它们的时机把握法则，而这套法则也被称之为海龟交易法则。

海龟交易法则可以说是程序化交易领域的开山之作。这套法则的基础规则很简单，

精髓在于其中融入的资金管理体系。

具体来说，一个是根据ATR来确定仓位，这样在初始风险固定的情况下，结合波动率灵活地调整仓位。二是基础规则里面嵌套的加仓规则。而这一切地目的都是丹尼斯理念的体现：

“老练的玩家们在大多数时间里都赌得很小，因为优势在赌场一边。他们在等待时机，等待他们偶然获得对赌场的优势。一旦等到了这种机会，这些玩家就会加大赌注，利用他们的优势压倒庄家。”

通过对海龟交易系统深入研究之后，我们能够大体上对构建一套交易系统所需要涉及的方方面面有一个了

解，这个时候，

我们可能会想要去成为一个程序化交易者，想要去开发更多不同类型的交易系统，丰富我们的武器库，那么此时，我们就要下点大力气了。

首先上一本大部头的书《trading systems and methods》

，作者佩里·考夫曼，好像是2018还是2019年才出的中文版，想起那之前，我还抱着英文版啃了好久。

提到考夫曼，这个人大家可能比较陌生。但是，自适应均线创始人，《精明的交易者》一书作者，大家可能就變得比较熟悉一些了，没错，就是这个人，从火箭科学家到量化交易先行者之一。

书里面的目录挺

全面的，详细介绍了交易系统的

各个方面。这本书也是量化交易研究者的主要参考书之一。

除了基础的知识介绍外，对于交易系统的认知上，作者也是深邃的。比如交易系统的好坏评价上，适合的才是最好的；金融分析研究，追求的是寻找no

rmally right,规避normally wrong等等。

而后

如果我们

想要借助各类技术

指标开发出更多的交易系统，可以看

看《期货市场计算机分析指南》这本书，作者 查尔斯·勒博 (Charles Lebeau) /大卫·W·卢卡斯 (David W. Lucas)。

作者作为一个程序化交易者，用过来人的方式为读者一一展示了使用各类技术指标去构建交易系

统的时候，会遇到什么样的问题，

又该如何解决，完成后的交易系统，有什么样的优缺点，使用时需要注意什么，又有哪些可改进的方向...真的是手把手的感觉。

本书给我最大的感受就是真诚

，印象最深的一句话则是：制定计划时，始终要设想到最糟糕的情况并做好应对准备——当最糟糕的情况并未发生时，感谢自己的运气好；当最糟糕的情况果真发生时，感谢自己未雨绸缪的先见之明。如此，你就会经得住考验，不断攀升。

当然如果我们并不想要成为一名严格的机械化系统交易者，没关系，把握一些关键的规则，我们也可以做到相对灵活的操作，随心所欲而不逾矩！

于是最后就要推荐《华尔街幽灵》

这本书，书中主人公是一位不愿透露姓名，在华尔街交易30余年，取得巨大成功的交易员，他以“幽灵”自称，为世人分享自己毕生的交易智慧。

幽灵向读者详细论述了让自己在交易市场获得巨大成功的三大规则。

其一：只持有正确的仓位。

开仓后没有快速出现浮盈甚至是开始浮亏的持仓，都默认为错误的持仓，及时出清，不要等待市场提示你已经出错了。

这一点是有一定颠覆性的，我们通常说“计划你的交易，交易你的计划”，开仓后设置好止损，止损未到就持仓。但幽灵的观点更绝对，那就是只要开仓后没能快速出现大的浮盈，都被视为不正确的持仓，都要出清。

该规则的精

髓在于，幽灵对待不盈

利的持仓表现出近乎零容忍度

，等待一笔交易被证明是错误的，往往意味着我们已经要承担不小的损失，我们不如拿这些损失去多做尝试，去捕捉入场后就能快速脱离成本区的交易机会。这样做的另一个好处是，交易者永远也不会被市场咬死，永远能够保留足够的实力进行下一次交易。

但是规则一，很可能让交易者陷入多次频繁的小幅止损中，对于初级交易者而言，心理的负面影响很大，所以在实际使用过程中，提高入场成功率也非常重要。

很遗憾的是，幽灵没有就入场时机的选择细节作阐述，但是从规则一的要求中，我们可以推断出能够成为幽灵账户中的持仓的单子，一定是入场之后就迅速脱离了成本区的单子。

这一点其实在本质上，跟《短线操作秘诀》里的大区间日子有异曲同工之妙。

规则二则是加仓：毫无例外并且正确的对你的盈利仓位加码。

强调加仓的重

要性，这点与海龟交易法则

有着异曲同工之处，

都是希望在获取优势之后加大筹码，获得更大的盈亏比。

同样令我们略感遗憾的是，作者也未对具体的加仓时机做详细的论述，需要我们自己在平时的实践中去摸索总结。后面有机会我想就这块再单独写一写我的一些经验和感受。

幽灵还提到了

规则三，结合量价形态去判断何时该离场。

这一点个人感觉更像是一个技术指标的应用，与前面两个规则中所蕴含的交易智慧相比，显得有点单薄。