

Giełda, wolność i pieniądze

VAN K. THARP

SZCZEGÓŁOWY SPIS TREŚCI

Słowo wstępne

Podziękowania

Wstęp

Część I Najważniejszy czynnik decydujący o sukcesie: TY!

Rozdział 1 Legenda o Świętym Graalu

Metafora Świętego Graala

Co jest naprawdę ważne?

Modelowanie geniuszy rynku

Podsumowanie

Rozdział 2 Obciążenia oceny: dlaczego ludziom tak trudno jest zapanować nad rynkiem?

Obciążenia oceny wpływające na tworzenie systemu transakcyjnego

Obciążenia wpływające na sposób testowania systemów

Obciążenia wpływające na sposób prowadzenia transakcji

Podsumowanie

Rozdział 3 Wyznaczanie celów

Określenie celu jest najważniejszym elementem pracy nad systemem

Tom Basso o celach inwestycyjnych

Część I: Ocena samego siebie

Część II: Wyznaczenie celów

A. Cele inwestorów indywidualnych

B. Cele zarządzających pieniędzmi

Część III: Koncepcje

Ustalanie celów

Część II Podstawy systemu

Rozdział 4 Etapy pracy nad systemem

1. Przegląd własnych możliwości

2. Bądź otwarty i zbieraj informacje o rynku

3. Wyznacz sobie cele

4. Wyznacz swoją perspektywę inwestycyjną

5. Znajdź najlepsze historyczne ruchy o wybranym zasięgu czasowym i zbadaj ich wspólne cechy

6. Jakie koncepcje pozwalały uchwycić te ruchy? Jak obiektywnie można je sprawdzić?

7. Dodaj do systemu linie stopu i uwzględnij koszty transakcyjne

8. Dodaj zasady realizacji zysku i oblicz oczekiwaną skuteczność systemu

9. Szukaj transakcji dających duży zysk

10. Optymalizuj wielkość pozycji
11. Zastanów się, jak możesz usprawnić swój system
12. Uwzględnij najczarniejsze scenariusze

Rozdział 5 Wybór koncepcji

- Gra z trendem
- Analiza fundamentalna
- Zależności sezonowe
- Transakcje typu spread
- Sieci neuronowe
- Porządek wszechświata
- Podsumowanie

Rozdział 6 Oczekiwana skuteczność systemu i inne kluczowe elementy sukcesu

- Sześć kluczowych czynników sukcesu
- Metafora śnieżnych kul
- Oczekiwana skuteczność systemu z bliska
- Oczekiwana skuteczność i współczynnik R
- Oczekiwana skuteczność na rynku
- Zastosowanie oczekiwanej skuteczności do porównywania różnych systemów
- Podsumowanie zasad korzystania z oczekiwanej skuteczności

Część III Zrozumienie najważniejszych elementów systemu

Rozdział 7 Warunki transakcji

Cztery fazy wchodzenia na rynek

Kryteria namierzenia rynku

Filtry a warunki transakcyjne

Warunki transakcji stosowane w znanych systemach

Podsumowanie

Rozdział 8 Wejście, czyli synchronizacja z rynkiem

Jak osiągnąć skuteczność lepszą niż w metodzie losowej?

Popularne metody otwierania pozycji

Projektowanie własnego sygnału

Mechanizmy wchodzenia na rynek w popularnych systemach

Podsumowanie

Rozdział 9 Kiedy wychodzić z rynku, czyli ochrona kapitału

Jak działa stop

Linie stopu, które mają sens

Podsumowanie: ochrona kapitału

Mechanizmy stopu stosowane w popularnych systemach

Systemy dla rynku akcji

Rozdział 10 Jak realizować zyski

Cele zasad realizacji zysku

Linia stopu i docelowy poziom zysku

Kwestia prostoty a wielość zasad zamykania pozycji

Czego należy unikać?

Podsumowanie

Zasady zamykania pozycji stosowane w popularnych systemach

Rozdział 11 Liczba okazji transakcyjnych i koszty

Kilka możliwych dróg

Znaczenie liczby okazji transakcyjnych

Koszty korzystania z okazji transakcyjnych

Podsumowanie

Rozdział 12 Zarządzanie wielkością pozycji? Na moim rachunku jest tylko 10 000 dolarów!

Strategie zarządzania wielkością pozycji

Model pierwszy: jedna jednostka na stałą sumę pieniędzy

Model drugi: jednostki o równej wartości na rynku akcji

Model trzeci: strategia ryzyka procentowego

Model czwarty: model procentowej zmienności

Podsumowanie modeli

Przykłady wpływu zarządzania wielkością pozycji

Podsumowanie

Zarządzanie wielkością pozycji w innych systemach

Rozdział 13 Wnioski

Zalecane lektury

Skorowidz