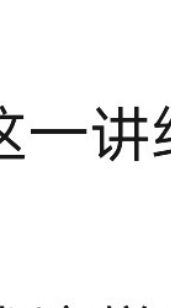


25 行动思维：如何聚焦



王烁

01-10 16:20



25 行动思维：如何聚焦

10:19 9.45 MB



王烁亲述

你好，我是王烁。

这一讲给你介绍一个行动派指南。

我这样的人，观察很多，思考不少，可是行动还不够。这一讲要介绍的打法，像激光一样聚焦于行动，根据行动来组织思考，寻找信息，对我很有触动，介绍给你。

这个打法出自索普（Ed Thorp）。他有这个资格：他出身学院派，靠算牌战胜了拉斯维加斯赌场，然后转战另一个赌场华尔街，自己摸索出了衍生品定价方法，跟后来拿到诺贝尔经济学奖的“布莱克-斯科尔斯”期权定价公式一样。不同的是他没有去发论文，虽然错过了诺奖，但是用它创建了当代第一个量化对冲基金，多年间战胜了华尔街，赚了很多钱。从拉斯维加斯和华尔街这两个世界上最大的财富陷阱中全身而退满载而归，他靠的是自己的打法。

他的打法有五条指南。

- 第一条，大家都说不可能战胜赌场，可不可能得自己真试过才知道。
- 第二条，习惯性地思考所得用于获利，关键词是“习惯性”。
- 第三条，制定可行计划，坚持直到成功。
- 第四条，始终保持理性，不是只在某个科学领域里保持理性，而是在与世界打交道的所有方面都保持理性。
- 第五条，保留意见，直到有足够证据作出决策。

我一条条讲解。

行动是第一目标

- 索普的第一条总结：大家都说不可能战胜赌场，可不可能得自己真试过才知道。

这一条的关键不仅在于要真去试，更在于去哪里试。

“不可能战胜赌场”，这句话其实绝大多数时候是对的。黑赌场就不用说了，进去你就是待宰羔羊。就说拉斯维加斯正规持牌赌场，它就是个明牌的概率游戏。

以轮盘赌为例，18个格子归赌客，18个格子归赌场，另外再多给赌场一个格子，球落在谁的格子里谁赢。赌场有1/37的概率优势。只要玩得次数足够多，赌场总是赢的。老虎机就更是如此。拉斯维加斯赌场里绝大多数赌法都是如此。

但有个赌法不一样，21点。它的概率不固定，而是随着发牌变化。一副扑克陆续发牌，如果先出小牌，那么在剩下的牌堆里大牌较多，而大牌多对庄家不利，因为规则是17点以下庄家必须继续要牌，可能爆牌。剩下的大牌越多，赌客的胜率就越高。赌客就是要抓住这些机会，胜率越高的时候下注越大。

找准时机，精准训练，保持纪律，赌客玩21点能战胜赌场。索普就这么做了。

对大多数人来说，人生从起跑线开始就不公平，确实如此，但抱怨也没用，不如把精力用来在对你不利的总体战场上寻找对你有利的局部战场。你总能找到几个。

- 索普的第二条总结：习惯性地思考所得用于获利。

索普对纯理论兴趣不大。他不是为了思考而思考，而是为了下注而思考。这是其一。其二是他更关心理论与现实之差，因为这里有行动机会。

不光21点，索普还瞄上了轮盘赌。轮盘赌对庄家有利，上面讲过了，这是数学理论，无可争议。但球毕竟是要在轮盘上转动的，这是物理，物理与现实世界有关，而现实不完美，不完美索普觉得就有琢磨的空间：地面平不平整？轮轴顺不顺滑？初始速度对结果有没有影响？

他把一个数学概率的问题转化成预测球事实上会落在哪里的物理学问题。

他发动信息论创始人香农，两人合作搞出了世界上第一套可穿戴计算机，在赌场实战。设备放在香农的鞋里，香农站在庄家旁边测量轮盘的速度，然后用脚趾头踩踏发出信号，索普用耳机接收，预测球最终落在哪些格子的概率偏高。

这是上世纪七八十年代的事，结果是他们太领先于时代，这套系统可用但不实用。他们玩玩就算了。这套设备至今还放在麻省理工学院的计算机博物馆里。更重要的是索普带来的启发：理论跟现实不一样的时候，对行动派来说，指责现实没意义，反过来说，指责理论也没意义。有意义的是从两者不一样的地方看到机会，特别是关注理论所依据的假设前提跟现实不一样在哪里，从中看到机会。

对行动派来说，现实当然总是对的，理论本身很可能也是对的，如果能搞明白为什么两者有冲突但都对的话，那么你不仅也是对的，还能赚钱。

理性是行动的前提

- 索普的第三条总结：制定可行计划，坚持直到成功。

这一条想必你一定懂，只是很难做到。

我要补充一点，坚持与执拗表面上没有什么不同，都是咬牙坚持，等待命运裁决，区别在于理性的坚持胜率高，不理性的坚持胜率低，这点区别而已。但现实不确定性太高，我们往往无法事前区分胜率高低，只能以结果论英雄。不公平，但没有更好的法子。

- 索普的第四条总结：始终保持理性，不是只在某个科学领域里保持理性，而是在与世界打交道的所有方面都保持理性。

这一条我感触很深。因为我是新闻工作者这层关系，见到太多精英人士，往往在自己这一行做到顶尖，但出了本专业则与常人无异。刚刚在朋友圈看两位朋友掐架，都是本专业顶尖人士，一个是一流经济学家，一个是一流科学家，掐架则是有关教育、国际关系和国民性问题，对掐水平很低。

受索普启发，我想这现象的起因并不是专业知识壁垒本身，而是有三层因素。

第一层是对信息质量缺少辨别力，所谓Garbage In Garbage Out，输入垃圾，输出也只能是垃圾。

专家对本行业的信息质量很有辨别力，但对公共领域里信息质量的辨别力不超过大众水平，也就是很低的水平。我那两位掐架的朋友就是被一篇完全不靠谱的公号文章挑动得掐了起来。作为新闻工作者，我在这方面倒是有些发言权，有兴趣的话可以去读课程《大学·问》里的文章《怎样识别不靠谱信息》。

第二层是没做到学以致用，学习与运用自动隔离。

学习对大多数人来说变成专用模块，进入本专业领域则自动调用，出了本专业就默认抛诸脑后。索普警醒自己也警醒我们，学习得变成通用模块，你才能不仅在擅长领域做到顶尖，还能在其他所有方面都能保持在一定水准之上，没有短板。

第三层是思维盲区有两种成因，一种是激励所致，一种是因为无知。

无知好说，求知就好了。激励导致盲区就难解决得多，我看不到是因为我不想看到，所以根本不去看。我有个先入为主

的看法，于是避开与此不相符的现象。

我那两个掐架的朋友也着了这个道。为什么不靠谱的公号文章能让他们掐得这么厉害？因为文章挑动了他们各自根深蒂固的观念。

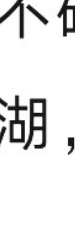
- 索普第五条总结：保留意见，直到有足够证据作出行动决策。

这一条可谓集大成，希望你能反复多念几遍。它提醒我们几点：

第一，意见是廉价的，行动才重要，行动及其结果是检验优劣的惟一标准。

第二，一方面是决策必须基于证据（evidence-based），另一面是证据越过阈值就应该行动。证据越过阈值还不行动的，其实是浪费了精力，太发散了，他就不该关心这件事。

第三，在证据不足的时候，保留意见，悬置。这点最难。没有人喜欢心里悬着许多事没有结论，消耗认知能量，带来许多焦灼，只有经过刻意训练才能在这么多不确定性前保持从容。胸有激雷，面如平湖，才可拜上将军。



字号

写留言

0

请朋友读