

如何量化股票成交量_量化交易的应用-股识吧

一、A股市场个人量化交易者，需要哪些工具

量化交易的前提是量化，而量化就是建立数学模型。

数学模型是理解量化交易的前提。

数学模型就是把具体事物数字化的过程，比如股票跌涨的统计图，如果没有统计图我们就必须通过研究具体的数字并且通过加减法去了解某只股票的近期走向，但当某一天有人发明了折线统计图，只要简单的把代表某个数字的点画出来然后连接起这些点，就可以一眼看出跌涨幅度。

其实数学模型就是这样一种抽象现实事物的工具。

股票量化交易中的模型建立是非常复杂的，拥有非常多的参数，数据量也非常大，数据分析的过程也十分复杂。

这样做的好处就是数学模型替代人为的主观判断，利用计算机技术从庞大的历史数据中海选能带来超额收益的多种“大概率”事件以制定策略，极大地减少了投资者情绪波动的影响，避免在市场极度狂热或悲观的情况下作出非理性的投资决策。

量化交易技术盛行于现今多种金融交易机构当中，已经成为了机构交易当中占据重要地位的交易手法，然而散户如何能够跨过量化交易的门槛，成为一名量化交易者呢?答案就是使用策略炒股通软件平台进行交易。

二、如何根据量价关系来买卖股票？

如果实际股价和预测有较大出入，往往隐藏着主力的阴谋才

三、量化交易的应用

量化投资技术包括多种具体方法，在投资品种选择、投资时机选择、股指期货套利、商品期货套利、统计套利和算法交易等领域得到广泛应用。

在此，以统计套利和算法交易为例进行阐述。

1、统计套利。

统计套利是利用资产价格的历史统计规律进行的套利，是一种风险套利，其风险在于这种历史统计规律在未来一段时间内是否继续存在。

统计套利的主要思路是先找出相关性最好的若干对投资品种，再找出每一对投资品

种的长期均衡关系（协整关系），当某一对品种的价差（协整方程的残差）偏离到一定程度时开始建仓，买进被相对低估的品种、卖空被相对高估的品种，等价差回归均衡后获利了结。

股指期货对冲是统计套利较长采用的一种操作策略，即利用不同国家、地区或行业的指数相关性，同时买入、卖出一对指数期货进行交易。

在经济全球化条件下，各个国家、地区和行业股票指数的关联性越来越强，从而容易导致股指系统性风险的产生，因此，对指数间的统计套利进行对冲是一种低风险、高收益的交易方式。

2、算法交易。

算法交易又称自动交易、黑盒交易或机器交易，是指通过设计算法，利用计算机程序发出交易指令的方法。

在交易中，程序可以决定的范围包括交易时间的选择、交易的价格，甚至包括最后需要成交的资产数量。

算法交易的主要类型有：(1) 被动型算法交易，也称结构型算法交易。

该交易算法除利用历史数据估计交易模型的关键参数外，不会根据市场的状况主动选择交易时机和交易的数量，而是按照一个既定的交易方针进行交易。

该策略的核心是减少滑价（目标价与实际成交均价的差）。

被动型算法交易最成熟，使用也最为广泛，如在国际市场上使用最多的成交加权平均价格（VWAP）、时间加权平均价格（TWAP）等都属于被动型算法交易。

(2) 主动型算法交易，也称机会型算法交易。

这类交易算法根据市场的状况作出实时的决策，判断是否交易、交易的数量、交易的价格等。

主动型交易算法除了努力减少滑价以外，把关注的重点逐渐转向了价格趋势预测上。

(3) 综合型算法交易，该交易是前两者的结合。

这类算法常见的方式是先把交易指令拆开，分布到若干个时间段内，每个时间段内具体如何交易由主动型交易算法进行判断。

两者结合可达到单纯一种算法无法达到的效果。

算法交易的交易策略有三：一是降低交易费用。

大单指令通常被拆分为若干个小单指令渐次进入市场。

这个策略的成功程度可以通过比较同一时期的平均购买价格与成交量加权平均价来衡量。

二是套利。

典型的套利策略通常包含三四个金融资产，如根据外汇市场利率平价理论，国内债券的价格、以外币标价的债券价格、汇率现货及汇率远期合约价格之间将产生一定的关联，如果市场价格与该理论隐含的价格偏差较大，且超过其交易成本，则可以用四笔交易来确保无风险利润。

股指期货的期限套利也可以用算法交易来完成。

三是做市。

做市包括在当前市场价格之上挂一个限价卖单或在当前价格之下挂一个限价买单，以便从买卖差价中获利。

此外，还有更复杂的策略，如“基准点”算法被交易员用来模拟指数收益，而“嗅探器”算法被用来发现最动荡或最不稳定的市场。

任何类型的模式识别或者预测模型都能用来启动算法交易。

四、股票交易中 量化关系 成交量上涨 持仓量下跌 价格上涨 未来的行情会如何（短期如何 后期如何）

主力收集筹码。

短线上攻。

后期就只有继续看了

五、怎么用大智慧编一些指标呢，比如说我要知道哪个股票的成交量小但涨幅大？哪位朋友能为我详细解答。

编写指标是需要将思路量化以后才能写，光是小、大是写出来的，要说明小到多小，大到多大，电脑才能算出来。

六、在成交量VOL（5.10）没有20日平均移动线 但是系统里只有5和10日的想增加20日的 公式怎么改呀

基本都是自己封装ctp接口，程序端实现多账户、多策略的行情信号接收和委托提交/回报处理。

也可以用 [quantbox/quantbox_xapi · github](#)

这样的封装的比较好、多接口统一api的项目直接整合到程序化平台的项目中使用。

通过程序接口用证券、期货账号登录后订阅品种的行情，证券、商品期货、股指期货、期权（全真模拟，9号就有实盘行情）都可以接收交易所的快照数据（例如商品、股指都是500ms一个快照，数据结构也比较完整）。

然后交易平台可以把行情数据广播给各个策略程序，程序根据量化策略的逻辑判断是否下单？挂单的方式如何？挂单失败是否追单？如何追单？策略程序判断要下单，则提交指令到程序化交易平台，平台把各个帐号各个品种中策略的逻辑持仓汇总为实际持仓，然后通过接口提交委托，并且处理委托回报。

行情数据一方面广播给策略程序，一方面自己存数据库，存下来的数据通过完整性检测后，可以自己合成低频率的数据，如1分钟、30分钟、1小时、日度等等，这些数据会被用于策略回测，也可以用于市场微观结构的观察和研究，例如可以通过优化挂单方式来降低交易滑点。

目前量化投资做的比较好的是微量网*wquant*

七、如何量化趋势交易思路

趋势有长短，衡量有有标准。

没有突破就没有方向。

趋势线才是衡量趋势的标准。

这个趋势线是绘制的还是自动生成的简单移动平均线。

我是用趋势线来分析。

按简单移动平均线来操作（趋势交易模型）。

具体量化就是MA30在日K线上的使用。

参考文档

[?????????????.pdf](#)

[???????????????](#)

[???????????????????](#)

[???????????????](#)

[???????????????](#)

[?????????????????.doc](#)

[?????????????????????????????...](#)

??

<https://www.gupiaozhishiba.com/author/36101045.html>