

强势股票最大回撤是多少 - - 量化投资有风险吗只转不赔吗-股识吧

一、基金经理最大回撤超过多少很危险

看基金策略，各不相同。
有的是20%，有的是30%。
甚至有50%的。

二、如何评价操盘手交易水平

基于以上两点，有以下一些关键指标要重点考察。

1、收益率

这是衡量操盘手水平最直观的指标，当然必须剔除出入金的影响以达到客观公正。收益率理论上是越高越好，但是暴利一般是不可以持续的，所以一个优秀的操盘手一般不追求暴利。

国际纯期货类CTA元盛资产管理公司能够持续10年平均收益达到12%，已经做到了270亿美元的管理规模。

从这点上来说，期货类CTA应该本质上是一个收益率较高的绝对收益产品。

在证券交易的评估上，投资业绩一般不按绝对收益衡量，而是参照股市大盘来计算相对收益。

在期货市场，虽然说一般按绝对收益去评价，但是在不同年份，行情的性质不同，收益水平仍然可能存在较大差异，所以结合期货类的相关指数，也可以对交易进行相对收益分析。

结合了绝对收益率分析和相对收益率分析，另一个维度，我们可以将不同时间周期的收益率转化为年化收益率，这样可以大概考察操盘手在一个长周期里盈利的目标，从国际标准上来看，规模资金每年收益能稳定在10%以上，就是非常优秀的了。

2、资金最大回撤率 这个指标着重考察操盘手的盈利稳定性。

优秀的操盘手应该不仅仅能够盈利，还要稳定盈利，这样才能保证未来会继续盈利。

资金回撤率越小，说明风险越小，但是如果过小则有可能会拉低收益率，一般收益越大风险越大，关键是要在收益和风险之间找到一个合适的平衡点，衡量指标是收益风险比。

收益风险比计算方式为年化收益率/资金最大回撤，越大越好，至少维持在2.3以上

3、管理规模 如果操盘手能够在较小资金回撤率的情况下，做到较高的收益率，那么就已经很优秀了。

但是他是多大资金规模上做到的，这也是很关键的，将决定了他是否适合发行基金产品。

一般而言，小资金是风险偏好型，而大资金是风险厌恶型，对于小资金更关注其成长性，而对于大资金则更关注其稳定性。

大资金在交易过程中还会对市场产生冲击和连带影响，会一定程度改变市场生态结构，所以交易过程中还需要进行算法交易调整以及冲击性压力测试。

4、投资逻辑 如果操盘手的数据明明白白的说明他很优秀了，我们依然有必要对其投资逻辑进行考察。

一个头脑清楚的操盘手比一个稀里糊涂的操盘手更有希望实现长期盈利。

重点考察其因果关系是否成立，如果成立是必然还是偶然，如果是偶然则这种逻辑具有相当大的不确定性和风险性。

三、股指期货全自动交易模型怎么评判好和不好

好不不好关键看风险控制，我们公司LT量化期货一号 稳健型一年最大回撤4.09%，比买基金的风险还小，他就是非常好的交易模型，只要有超过1%以上的涨幅或跌幅都能赚大钱。

LT一号产品与2022年正式上线测试，经过多年市场的验证取得了良好的成绩，2022年实盘验证中年化收益率达到43.24%，期间资金最大回撤值4.09%的优秀成绩！LT一号产品原理以趋势交易为主，配合波段交易方法，在尽可能规避震荡行情的前提下，抓取市场形成趋势后的交易机会，虽然产品总胜率在35%左右，但盈亏比例超过3倍，同时利用合理的资金管理更好的规避回撤风险，同时规避了市场不规则波动下的大幅亏损风险。

我们公司的网址*：[// *luotaijr*/show/](http://*luotaijr*/show/) ;

QQ1297313003 电话15021299622

四、基金有一个写最大回撤，然后用一个-的符号。是什么意思？

股东符合《证券投资基金法》和本办法的规定；

有符合《证券投资基金法》、《公司法》以及中国证监会规定的章程；

注册资本不低于1亿元人民币，且股东必须以货币资金实缴，境外股东应当以可自由兑换货币出资；
有符合法律、行政法规和中国证监会规定的拟任高级管理人员以及从事研究、投资、估值、营销等业务的人员，拟任高级管理人员、业务人员不少于15人，并应当取得基金从业资格；
有符合要求的营业场所、安全防范设施和与业务有关的其他设施；
设置了分工合理、职责清晰的组织机构和工作岗位；
有符合中国证监会规定的监察稽核、风险控制等内部监控制度；
经国务院批准的中国证监会规定的其他条件。
以上是基金公司成立的条件。
你这个-就是负号，就是跌了多少的意思。

五、股票的最大涨幅和最大跌幅通常是多少

A股市场10% 就是10元股票11元涨停 9元跌停

六、基金回撤是什么意思？

基金回撤是指，在某一特定的时期内，账户净值由最高值向后推移，直到净值回落到最低值时，期间净值减少的幅度。
通俗的讲，回撤就是跌幅。

七、短债基金是债券基金中风险最低的投资品种，这个结论是怎么得出来的，光大机智姐私教课提了吗？

光大机智姐理财私教课提到目前理财产品都会有其对应的风险评级，数字越小代表它的风险等级越低。
货币基金的风险评级为R1，是风险最低的等级。
而短债基金一般为R2，也就是风险稍高。
其他类别基金的风险等级则会更高。
除了风险等级，我们还可以通过最大回撤这一指标来评估产品的风险水平。

最大回撤的意思就是你买入基金后，最坏的情况下会亏损多少钱。

八、量化投资有风险吗只转不赔吗

也有风险，但是要设计模型最大程度地降低风险，降低最大回撤，争取稳定收益
红蓝牧投资

九、头号理财上面稳稳小确幸怎么样？

稳稳小确幸由汇添富基金提供，通过严选成分基金和动态调整股债资产比例，严控风险，其中约80%债券类基金，收益相对稳定，回撤较小，约20%股票类基金，紧密跟踪股市，增厚收益。

该组合自成立以来，最大回撤1.89%，做到了稳扎稳打。

参考文档

[下载：强势股票最大回撤是多少.pdf](#)

[《抛出的股票钱多久能到账》](#)

[《股票开户后多久能拿到证》](#)

[《股票改名st会停牌多久》](#)

[下载：强势股票最大回撤是多少.doc](#)

[更多关于《强势股票最大回撤是多少》的文档...](#)

声明：

本文来自网络，不代表

【股识吧】立场，转载请注明出处：

<https://www.gupiaozhishiba.com/chapter/46299795.html>