

# 怎么量化投资股票--如何构建量化投资策略-股识吧

## 一、量化基金是怎么操作的，风险大吗？

量化基金通过数理统计分析，选择那些未来回报可能会超越基准的证券进行投资，以期获取超越指数基金的收益。

量化基金主要采用量化投资策略来进行投资组合管理，采用的策略包括：量化选股、量化择时、股指期货套利、商品期货套利、统计套利、期权套利、算法交易、资产配置等。

量化基金的风险当然大，因为投资于股票的比例大。

只要是投资于股票比例大的基金风险都大。

不要迷信什么量化基金，最重要的还是要看基金经理，不管什么基金，只有基金经理的炒股和管理基金的能力强，基金的表现才会好。

## 二、同花顺量化

量化投资只是一种工具，当然通过现在智能工具比纯技术范的好一些，更理性一些。

现在国内的公司：东方财富、大智慧、同花顺和chinasope数库等都这一领域布局，国外的量化投资更加成熟一些，国内这块发展还处于发展期。

相信以后会快速发展吧。

## 三、学习量化交易如何入门？

策略的框架包括择时、选股、仓位控制、止损止盈。

因为量化的框架太大

## 四、国内股票的量化投资策略有哪些，特别是基本面量化

柠檬给你问题解决的畅快感觉！主要的量化对冲策略有：1、市场中性策略 主要追

求的是通过各类对冲手段消除投资组合的大部分或全部系统风险，寻找市场中的相近资产的定价偏差，利用价值回归理性的时间差，在市场中赚取细小的差价来获得持续的收益。

## 2、事件驱动套利策略

利用特殊事件造成的对资产价格的错误定价，从错误定价中谋利。

## 3、相对价值策略 主要是利用证券资产间相对的价值偏差进行获利。

感觉畅快？别忘了点击采纳哦！

## 五、同花顺量化

对历史数据进行统计分类，包括基本面和技术面，然后对影响股市涨跌的因素进行归纳，找出一个模型，这个模型不能保证你一直赚钱，但能确定你长期一直赚钱。然后对这个模型拿到当下的行情中测验，如果能经受得住时间的洗礼（短线要三个月，中线，一两年，长线五六年，在现实中往往是短线，西蒙斯的就是短线），那么这个模型就是可以的，值得使用的。

然后在操盘中，只根据模型发出的信号做为买卖依据，任何个人的主观意念都是错的。

本人就在一个投资公司做交易员和研发员，就是搞量化投资的，不过主要做的是大宗期货和股指，一星期进行二十资左右的交易，收益不错。

。

。

量化投资的本质是对规律的总结和模式化交易，避免个人心里影响成果。

因为市场上最大的敌人是自己的内心，贪，嗔，痴等情感。

## 六、如何构建量化投资策略

量化策略有简单也有复杂的，简单到围绕一根均线构建系统，复杂到根据多个因素共同构建系统。

方式虽然不同，但本质都是一样的，即策略中涉及的各项要素都需要标准化。

### 1、要素的标准化既然是策略，必然要有一些要素，如标的、仓位、买点、卖点等

。

这是最基本的四个要素。

先来看标的选择，任何一笔交易首先要明确的是标的如何选择。

市场有几千只股票，不可能每只股票都是符合你的标的，如何去选择，需要建立一

定的筛选标准，有人喜欢用基本面去分析，有人喜欢用技术面去分析，都无可厚非，但一定要有逻辑支撑，这就是标的选择的量化。

再来看仓位的量化，如果要用数学期望的角度去看待投资，那么仓位就需要去平均分配，避免因人为主观因素导致仓位的不同，从而影响最终结果。

那么既然是平均分配，就要考虑仓位分配与收益之间的权衡关系。

如果仓位过于分散，虽然整体波动性会变小，但势必也会降低整体收益率，反之亦然。

所以，仓位分配需要结合实践来达到最优。

最后来看买点和卖点的量化，在标的、仓位标准化后，接下来需要考虑买卖点的设置。

即达到什么条件就会触发买入和卖出指令，当卖出指令执行，就意味着一笔交易的结束。

而买入卖出条件因人而异，可以根据不同周期、不同模式，再结合实践来确定，最终核心是要围绕成功率和盈亏比来最终决定。

2、一致性原则一个完整的量化策略不仅包括前面所说的各项要素的标准化，还包括最终的执行。

对于专业的量化投资机构来说，往往是通过电脑去执行命令，这样做的好处是能够百分之百的实行量化策略，而不受人为因素的干扰。

最终目的是要保持交易的一致性。

对于普通投资者的量化策略来说，由于资金规模、量化策略的简易性，往往不需要如此复杂，可以通过投资者自己去执行。

那么，如何确保完全按照量化策略去执行呢？这就需要投资者具备良好的心态以及极强的控制能力，在交易中避险主观因素的干扰。

以上两点阐述了如何去构建一个量化策略，包括涉及的各个要素，但一个好的量化策略注定要经过长期反复的市场检验，并且不断的修正，数据的持续回测，最终达到理想的预期。

最后，还需要强大的执行力，而这考验的是你的心态。

## 七、散户怎么参与到量化投资中？

简单的说，量化投资是利用大量的历史数据帮助投资者作判断，用电脑帮助人脑处理信息，克服了人的情绪和弱点对投资的影响。

目前正式定义是投资者利用数学、统计学、信息技术的量化投资方法来管理投资组合。

数量化投资的组合构建注重的是对宏观数据、市场行为、企业财务数据、交易数据进行分析，利用数据挖掘技术、统计技术、计算方法等处理数据，以得到最优的投

投资组合和投资机会。

散户一般首先要有自己稳定的策略操作模型,可通过期货公司或证券公司IT接口进行试运行一段时间后,就可正式上线交易.一般通过互联网接口或专线交易,但由于出现光大证券乌龙指事件后,为控制风险,现在证券公司多用专线接口,尤其是大的证券公司,如中信证券等.当然专线相对而言费用较高,除设备初装费还每月收月租费.设备费要几万元,参与交易至少100万.

## 八、做量化交易一般用什么软件？

需要懂一些数学模型，比如统计分析、人工智能算法之类的，他的本质是利用数学模型分析数据潜在的规律寻找交易机会，并利用计算机程序来搜寻交易时机以及完成自动化交易。

并没有现成的软件可以做这个，因为它需要一个搭建一个专业的平台，这不一个人可以完成的。

国内有一些软件，比如大智慧提供数量分析，还有一些软件提供股票、期货的程序化交易。

但是实际上这并不是真正意义上的量化交易。

事实上，做一款纯粹的适合个人投资者的量化投资软件，难度是非常大的，因为量化策略并不想传统的基本面、技术面那样存在已有既定的必然规律。

他需要跨越多学科，多领域去挖掘数据的规律，然后利用得出的规律进行交易。

但是不同时间、空间的数据的潜在规律并不一致，所以对量化过程进行标准化是一件很难完成的事情。

如果是计算机或者数学专业的人士，可以考虑使用C、C++、SQL等语言，其他的可以使用MATLAB/SAS等软件。

不管是哪一种软件，要实现量化交易，肯定是需要一定的建模基础和编程基础的，其中最重要的东西是数学能力。

## 九、如何实现基本面量化

1. 对于基本面量化来说的确数据是第一位的,

真正生产环境可以work的策略都是必须有高质量的数据支撑; 2.

一般来说首先是资产配置模型, 根据宏观, 市场情绪以及经济基本面等建模,

优化股票债券和现金的优化配置比例, 当然资产配置本身就是博大精深的,

有很多可以研究3. 在具体的投资标的比如股票, 可以利用量化的方法构建价值因子,

成长因子,盈利质量分析因子,分析师估值因子,情绪因子,  
市场动量因子等阿尔法模型,  
最后在风险模型的基础上进行优化和个股选择/组合构建

## 参考文档

[下载：怎么量化投资股票.pdf](#)

[《买股票要多久才能买到》](#)

[《股票的牛市和熊市周期是多久》](#)

[《启动股票一般多久到账》](#)

[下载：怎么量化投资股票.doc](#)

[更多关于《怎么量化投资股票》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/read/10811591.html>