

量化基金的特点有哪些 - - 什么是数量化基金？-股识吧

一、量化对冲是什么？量化对冲优势是什么

“量化对冲”是“量化”和“对冲”两个概念的结合。

“量化”指借助统计方法、数学模型来指导投资，其本质是定性投资的数量化实践。

“对冲”指通过管理并降低组合系统风险以应对金融市场变化，获取相对稳定的收益。

实际中对冲基金往往采用量化投资方法，两者经常交替使用，但量化基金不完全等同于对冲基金。

其中“量化”投资是区别于传统“定性”投资而言的。

量化投资通过借助统计学、数学方法，运用计算机从海量历史数据中寻找能够带来超额收益的多种“大概率”策略，并纪律严明地按照这些策略所构建的数量化模型来指导投资，力求取得稳定的、可持续的、高于平均的超额回报，其本质是定性投资的数量化实践。

由此可见，所有采用量化投资策略的产品(包括普通公募基金、对冲基金等等)都可以纳入量化基金的范畴。

量化投资的最大的特点是强调纪律性，即可以克服投资者主观情绪的影响。

二、什么是数量化基金？

量化基金的主要特点是将定性研究的理论通过数量模型演绎出来，借助电脑强大的处理信息的能力，全范围的筛选符合“标准”的股票，避免任何投资“盲点”的产生，最大限度地捕捉“标准”的投资对象。

由于借助量化模型，定量投资能够避免基金经理情绪、偏好等对投资组合的干扰，精确地反映基金管理人的投资思想，最大限度地“理性”投资。

与传统的投资方法不同，数量化投资不是以个人判断来管理资产，而是将投资专家的思想、经验和直觉反映在量化模型中，利用电脑帮助人脑处理大量信息，并进行投资决策。

量化投资并不是基本面分析的对立者，90%的模型是基于基本面因素，同时考虑技术因素。

因此，它也不是技术分析，而是基于对市场深入理解形成的合乎逻辑的投资方法。

量化投资基金：“以数量化模型作为资产配置与构建投资组合的基础，实行从一级

股票库初选、二级股票库精选，到行业配置的动态全程量化投资。

”量化投资在海外的历史已有30多年的历史，其投资业绩稳定，市场规模和份额不断扩大、得到了越来越多投资者认可。

事实上，互联网的发展，使得新概念在世界范围的传播速度非常快，作为一个概念，量化投资并不算新，国内投资者早有耳闻。

但是，真正的量化基金在国内还比较罕见。

量化投资区别于定性投资的鲜明特征就是模型，对于量化投资中模型与人的关系，大家也非常关心比较关心。

我打个比方来说明这种关系，我们先看一看医生治病，中医与西医的诊疗方法不同，中医是望、稳、问、切，最后判断出的结果，很大程度上基于中医的经验，定性程度上大一些；

西医就不同了，先要病人去拍片子、化验等，这些都要依托于医学仪器，最后得出结论，对症下药。

医生治疗病人的疾病，投资者治疗市场的疾病，市场的疾病是什么？就是错误定价和估值，没病或病得比较轻，市场是有效或弱有效的；

病得越严重，市场越无效。

投资者用资金投资于低估的证券，直到把它的价格抬升到合理的价格水平上。

但是，定性投资和定量投资的具体做法有些差异，这些差异如同中医和西医的差异，定性投资更像中医，更多地依靠经验和感觉判断病在哪里；

定量投资更像是西医，依靠模型判断，模型对于定量投资基金经理的作用就像CT机对于医生的作用。

在每一天的投资运作之前，我会先用模型对整个市场进行一次全面的检查和扫描，然后根据检查和扫描结果做出投资决策。

三、量化型基金是什么 哪些量化型基金该买 – 慢钱网

量化型基金是近年来市场风行的一种基金品种，该类基金区别于传统投资基金的一个重要特点便是高度、严明的纪律性，严格按照模型及程序的精确设定来优化投资组合，以克服投资过程中的人性弱点，寻找投资机会。

四、什么是量化红利基金

你知道红利基金吧。

量化红利基金和它的区别就在于“量化”二字。

而所谓“量化”-----就是“数量化”投资

，即采用数量化选股策略和模型构建红利风格股票池和股票组合。

给你举个例：比如说某个孩子这个学期的成绩好了很多，但这个说法比较模糊，到底好了多少呢？那就不用“量化”的方式来表达吧-----这个孩子这个学期的成绩在全班排名提前了10名，这样的表述是不是感觉更客观呢。

说白了，就是这种投资方式会更客观一些。

五、关于量化对冲基金

首先你要明确定性分析和定量分析的区别，定性分析举个简单的例子就是股票和债券的性质是不同的，A股票和B股票是不同的。

A股票上午买和A股票下午买是不同的。

这是从定性的角度来分析问题。

但实际运用当中A股票和B股票又是有联系的。

而他们的关联度如何去确定，那么就引入定量分析整个概念了。

一般来讲，量化投资都是运用金融建模进行定量分析。

其中运用最普遍的是对冲基金。

对冲基金意思是买一个标的物，然后再卖一个标的物。

利用标的物与标的物之间的关联性进行套利。

而这种套利是需要精确的量化分析进行的。

所以说对冲基金主要运用量化投资这种方法。

但量化投资不见得是对冲基金。

参考文档

[下载：量化基金的特点有哪些.pdf](#)

[《股票你们多久看一次》](#)

[《股票钱多久能到银行卡》](#)

[《川恒转债多久变成股票》](#)

[《股票涨幅过大停牌核查一般要多久》](#)

[下载：量化基金的特点有哪些.doc](#)

[更多关于《量化基金的特点有哪些》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/75249921.html>