

# 量化对冲基金什么意思~什么是量化对冲基金-股识吧

## 一、什么是量化对冲基金

量化对冲基金则是基金经理构建出一篮子模型组操作公募基金。每个模型根据自己的构建原理自主选股，好像是一个独立的子基金。举例来说，可以参考元普投资的量化对冲基金。他们以股票市场的中性策略为主，辅之期现套利、同类品种套利、分级基金套利、etf套利、期权套利、事件驱动套利等等多种策略。

## 二、什么是量化基金和对冲基金？

近年来，随着证券市场规模的不断扩大，金融衍生产品不断推出，投资策略和盈利模式发生根本性改变，投资复杂程度日益提高，导致证券市场投资者的构成比例出现了相应的变化。

专业投资管理人的占比越来越大，且有加速之势。

另一方面，量化对冲投资策略以其中低风险稳定收益的特性，将成为机构投资者的主要投资方向之一。

过去的13年间全球对冲基金市场经历了快速增长、衰退、反弹三个阶段。

08年金融危机前，全球对冲基金规模由2000年的3350亿美元上升至1.95万亿美元。

受金融危机影响，全球对冲基金规模一度缩减。

09年之后，在全球经济复苏背景下对冲基金规模又开始反弹，截至2022年11月底，全球对冲共基金管理着1.99万亿美元的资产。

从目前对冲基金的全球分布来看，北美地区(美国为主)是全球对冲基金市场发展最成熟的地区，且近年来占比有所扩大，截止2022年11月该地区对冲基金规模占据全球的67.5%。

其次是欧洲地区，占比达22.2%；

接着是亚太地区，占比达7.3%(日本+亚洲非日本)

常见的量化对冲策略包括：股票对冲(Equity Hedge)、事件驱动(Event Driven)、全球宏观(Macro)、相对价值套利(Relative Value)四种，任意一只对冲基金既可采取其中某一策略也可同时采取多种投资策略，目前全球使用占比最高的策略是股票对冲策略，占比达32.5%

量化对冲产品有以下几方面特点：1、投资范围广泛，投资策略灵活；

2、无论市场上涨还是下跌，均以获取绝对收益为目标；

- 3、更好的风险调整收益，长期中对冲基金在获取稳定收益的同时提供了更好的防御性；
- 4、与主要市场指数相关性低，具备资产配置价值。

### 三、量化对冲是什么意思，通俗解释。最好能举个例子，股票百科就不要复制了，都看不懂

这个要解释起来比较费力呢，我也是花了很多的时候才搞懂的。  
首先把这个词拆开成量化、对冲量化：就是数量化，数字化，公式化。  
对冲：用一项投资来降低另一项投资的风险的投资组合。  
(这个你应该知道吧？)合起来就是专业化的对冲投资。  
用精确的计算、大数据的支持统计、然后利用模型公式来推演。  
得到最佳的方案，进行投资。  
(纯属个人见解，如果觉得我说的对就采纳吧。  
)

### 四、什么是量化基金和对冲基金？

你好！量化基金：将基金投资于股票、债券等的定性分析、研究、运作，借助数学模型“量化”的基金，称为量化基金。  
想法不错，但股市规律很难掌握，尤其对非市场化股市。  
观察已有的量化型基金，例如，嘉实量化阿尔法；  
中海量化策略；  
光大量化核心，业绩很一般。  
对冲基金：亦称避险基金或套利基金，是指由金融期货（financial futures）和金融期权（financial option）等金融衍生工具（financial derivatives）与金融组织结合后以高风险投机为手段并以盈利为目的的金融基金。  
它是投资基金的一种形式，属于免责市场(exempt market)产品。  
意为“风险对冲过的基金”，对冲基金名为基金，实际与互惠基金安全、收益、增值的投资理念有本质区别。  
谢谢！高搜易财富团队很高兴为您解答！

## 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。

## 六、量化对冲型基金有什么特点

量化对冲基金有以下几方面特点：1、投资范围广、投资策略灵活；

2、以追求绝对收益为目标；

3、更好的风险调整收益；

4、与主要市场指数相关性低、具备资产配置价值。

## 七、量化对冲的简介

近年来，随着证券市场规模的不断扩大，金融衍生产品不断推出，投资策略和盈利模式发生根本性改变，投资复杂程度日益提高，导致证券市场投资者的构成比例出现了相应的变化。

专业投资管理人的占比越来越大，且有加速之势。

另一方面，量化对冲投资策略以其中低风险稳定收益的特性，将成为机构投资者的主要投资方向之一。

过去的13年间全球对冲基金市场经历了快速增长、衰退、反弹三个阶段。

08年金融危机前，全球对冲基金规模由2000年的3350亿美元上升至1.95万亿美元。

受金融危机影响，全球对冲基金规模一度缩减。

09年之后，在全球经济复苏背景下对冲基金规模又开始反弹，截至2022年11月底，全球对冲共基金管理着1.99万亿美元资产。

从目前对冲基金的全球分布来看，北美地区(美国为主)是全球对冲基金市场发展最成熟的地区，且近年来占比有所扩大，截止2022年11月该地区对冲基金规模占据全球的67.5%。

其次是欧洲地区，占比达22.2%；

接着是亚太地区，占比达7.3%(日本+亚洲非日本)

常见的量化对冲策略包括：股票对冲(Equity Hedge)、事件驱动(Event Driven)、全球宏观(Macro)、相对价值套利(Relative Value)四种，任意一只对冲基金既可采取其中某一策略也可同时采取多种投资策略，目前全球使用占比最高的策略是股票对冲策略，占比达32.5%

量化对冲产品有以下几方面特点：1、投资范围广泛，投资策略灵活；

2、无论市场上涨还是下跌，均以获取绝对收益为目标；

3、更好的风险调整收益，长期中对冲基金在获取稳定收益的同时提供了更好的防御性；

4、与主要市场指数相关性低，具备资产配置价值。

## 八、量化投资和对冲基金的区别

量化投资 量化投资就是借助现代统计学、数学的方法，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、可持续的超额回报。

量化投资就是将投资理念及策略通过具体指标、参数的设计为投资者针对以后的行情走向进行判断，然后对影响股市涨跌的因素进行归纳，建立一个模型，把这个模型拿到当下行情进行检测，如果这个模型能准确的反应出走势，确保为投资者带去优良的收益，那么这个模型就值得投资者使用。

相对于传统投资方式来说，量化投资具有快速高效性、客观理性、收益与风险平衡和个股与组合平衡等四大特点。

正是因为各个环节都要有不同的方法和量化模型来保证操作的可靠性，因此技术方面也几乎覆盖了整个投资流程，从估值选股、资产配置到程序化交易与绩效评估等，对操作人员的要求也是比较高的。

量化投资自身以及整个投资行业的发展逐步产生共振。

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。

作为一个概念，量化投资并不算新，国内投资者早有耳闻，以2022年股指期货上

市为转折点，目前已经非常成熟。

量邦科技把人的投资思想规则化、模型化，基于金融数据得出投资结论，并选用计算机去执行交易。

原本用于自然科学研究的手段应用于投资实践，就产生了投资科学。

比如出现于上世纪80年代左右的阿尔法投资，这种量化投资的主要工具是多因素模型，通过分析股价的驱动因素，合理配置权重，进行有益投资组合对冲基金对冲基金（hedge fund），也称避险基金或套利基金，是指由金融期货（financial futures）和金融期权（financial option）等金融衍生工具（financial derivatives）与金融组织结合后以高风险投机为手段并以盈利为目的的金融基金。

它是投资基金的一种形式，属于免责市场(exempt market)产品。

对冲基金采用各种交易手段进行对冲、换位、套头、套期来赚取巨额利润。

这些概念已经超出了传统的防止风险、保障收益操作范畴。

加之发起和设立对冲基金的法律门槛远低于互惠基金，使之风险进一步加大。

随着时间的推移，在金融市场上，部分基金组织利用金融衍生工具采取多种以盈利为目的投资策略，这些基金组织便被称为对冲基金。

对冲基金早已失去风险对冲的内涵，相反的，现在人们普遍认为对冲基金实际是基于最新的投资理论和极其复杂的金融市场操作技巧，充分利用各种金融衍生产品的杠杆效用，承担高风险、追求高收益的投资模式。

总结从海外经验也可以看出，量化对冲、CTA策略及量化多策略产品在市场下跌中仍然能获得较好的收益。

量化对冲产品偏向市场中性策略，可以在A股市场下跌中实现对冲风险，获取收益

。

## 参考文档

[下载：量化对冲基金什么意思.pdf](#)

[《股票平仓怎么保命》](#)

[《股票中k线三根线各代表什么意义》](#)

[《银行黄金理财怎么样知乎》](#)

[下载：量化对冲基金什么意思.doc](#)

[更多关于《量化对冲基金什么意思》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/store/75089364.html>