

如何对股票量化分析：怎样能迅速提高分析股票技术指标的能力？-股识吧

一、如何量化趋势

可把已知数据分两列输入Excel表，在图表向导中选择“折线图”“子图表类型”中的数据点线图，按步骤建立点线图，然后添加趋势曲线，在“趋势线格式”“选项”卡中选择“显示公式”，得到函数式。

二、什么是量化分析？

量化分析就是分析数据化混沌理论

：“相对论消除了关于绝对空间和时间的幻想；
量子力学则消除了关于可控测量过程的牛顿式的梦；
而混沌则消除了拉普拉斯关于决定论式可预测的幻想。
”一点就是未来无法确定。

如果你某一天确定了，那是你撞上了。

第二事物的发展是通过自我相似的秩序来实现的。

看见云彩，知道他是云彩，看见一座山，就知道是一座山，凭什么？就是自我相似。

这是混沌理论两个基本的概念。

混沌理论还有一个是发展人格，他有三个原则，：

- 1、能量永远会遵循阻力最小的途径
- 2、始终存在着通常不可见的根本结构，这个结构决定阻力最小的途径。
- 3、这种始终存在而通常不可见的根本结构，不仅可以被发现，而且可以被改变。

一、混沌理论（Chaos theory）是一种兼具质性思考与量化分析的方法，用以探讨动态系统中（如：人口移动、化学反应、气象变化、社会行为等）无法用单一的数据关系，而必须用整体、连续的数据关系才能加以解释及预测之行为。

二、混沌一词原指宇宙未形成之前的混乱状态，我国及古希腊哲学家对于宇宙之源起即持混沌论，主张宇宙是由混沌之初逐渐形成现今有条不紊的世界。

在井然有序的宇宙中，西方自然科学家经过长期的探讨，逐一发现众多自然界中的规律，如大家耳熟能详的地心引力、杠杆原理、相对论等。

这些自然规律都能用单一的数学公式加以描述，并可以依据此公式准确预测物体的行径。

三、近半世纪以来，科学家发现许多自然现象即使可化为单纯的数学公式，但是其行径却无法加以预测。

如气象学家Edward Lorenz发现，简单的热对流现象居然能引起令人无法想象的气象变化，产生所谓的「蝴蝶效应」，亦即某地下大雪，经追根究底却发现是受到几个月前远在异地的蝴蝶拍打翅膀产生气流所造成的。

一九六〇年代，美国数学家Stephen Smale发现，某些物体的行径经过某种规则性的变化之后，随后的发展并无一定的轨迹可寻，呈现失序的混沌状态。

四、混沌现象起因于物体不断以某种规则复制

前一阶段的运动状态，而产生无法预测的随机效果。

所谓「差之毫厘，失之千里」正是此一现象的最佳批注。

具体而言，混沌现象发生于易变动的物体或系统，该物体在行动之初极为单纯，但经过一定规则的连续变动之后，却产生始料所未及的后果，也就是混沌状态。

但是此种混沌状态不同于一般杂乱无章的混乱状况，此一混沌现象经过长期及完整分析之后，可以从中理出某种规则出来。

混沌现象虽然最先用于解释自然界，但是在人文及社会领域中因为事物之间相互牵引，混沌现象尤为多见。

如股票市场的起伏、人生的平坦曲折、教育的复杂过程。

五、混沌理论在教育行政、课程与教学、教育研究、教育测验等方面已经有些许应用的例子。

由于教育的对象是人，人是随时变动起伏的个体，而教育的过程基本上依循一定的准则，并历经长期的互动，因此，相当符合混沌理论的架构。

也因此，依据混沌理论，教育系统容易产生无法预期的结果。

此一结果可能是正面的，也有可能是负面的。

不论是正面或是负面的，重要的是，教育的成效或教育的研究除了短期的观察之外，更应该累积长期数据，从中分析出可能的脉络出来，以增加教育效果的可预测性，并运用其扩大教育效果。

三、以量化分析方法选股，要怎么算股票收益率？？？

首先建立各个指标在相应分析期内的“增持”/“减持”组合，通过事后检验，统计并分析各指标的“增持”/“减持”组合在分析期内的信息比率与收益率。

依据各个指标的“增持”组合的市场表现，判断该指标的选股能力。

“增持”与“减持”组合的构建方法如下：每次选择一个指标，依据该指标对行业内个股进行排序。

根据指标代表的经济含义，选择指标排序最优的前25%的股票设定为“增持”，后25%的股票设定为“减持”。

将“增持”与“减持”股票，按照流通股市值为权重，组成“增持”与“减持”投资组合。

投资组合建立后每隔三个月，根据市场最新的指标数据，对“增持”与“减持”组合进行一次重新调整。

1. 经过众多的统计分析研究比较，一些短线投资者认为当随机指标KDJ的K线从下向上穿过D线时，可以买入股票。

2. 短线买截的不足之处。

从技术分析的角度而言，短线买点都是短线行为在一定时期内，短线买点特别多，同样短线卖点也特别多，因此投资者据此操作，成功的可能性不大。

如果考虑到投资者的交易成本投资者根据短线指标操作股票，成功的概率又进一步降低。

另外大多数散户由于交易设施的不完备，短线操作也不方便。

因此我们建议散户投资者不要轻易用短线的方法买进股票。

3. 短线的交点在决定卖点时，除了前面所讨论的方法外，一些短线投资者常常用随机指标KDJ来决定股票的卖点。

由随机指标KDJ的墓木原理知，当随机指标KDJ的K线从上向下穿过D线时，投资者可以卖出股票 我用的牛股宝，里面有个从炒股大赛里面选出来的牛人榜，这个牛股宝里可以跟着牛人买卖操作，这样能跟这这些牛人学习很多知识，牛股宝我觉得不错。

你也可以试试。

祝你成功。

四、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

五、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。

六、量化交易主要有哪些经典的策略

其实要说种类其实很简单，完全可以按照炒股的类型来对策略模型分类，从这个角度来说，认为可以分成技术分析型、价值分析型、机器学习与人工智能。

当然了，还有一大类是多因子模型，但是多因子从广义来说其实概念很广泛，任何的技术指标和财务因子都可以作为多因子模型的因子。

技术分析型主要是结合各种技术指标来对动量效应或反转效应做研判交易；
时变夏普率的择时策略、情绪择时-

GSIS、RSRS指标择时及大小盘轮动 价值分析则偏重股票标的的基本面分析；

查尔斯·布兰德斯价值投资法、迈克尔·普莱斯低估价值选股策略、阿梅特·欧卡莫斯集中投资法则 机器学习与人工智能可以算作是区别于前两类一种新兴的方式，主要利用一些统计机器学习算法和神经网络做出预测而量化；

基于KMeans的指数择时策略、利用随机森林进行因子选择、基于HMM的指数择时策略供参考！

七、怎样能迅速提高分析股票技术指标的能力？

没有好办法，只能选择一二个技术指标，不要太多，多看多练，很快就可上手了。
注意：不在多，只在精。

八、

参考文档

[下载：如何对股票量化分析.pdf](#)

[《一只股票多久才能涨》](#)

[《滴滴上市股票多久可以交易》](#)

[《蜻蜓点睛股票卖出后多久能取出》](#)

[《上市公司离职多久可以卖股票》](#)

[《卖完股票从证券里多久能取出来》](#)

[下载：如何对股票量化分析.doc](#)
[更多关于《如何对股票量化分析》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/article/42174474.html>