

股票量化如何优化市场-这两天股市暴跌，A：最近在哪里发财啊？B：炒炒股票。A：做的怎么样？B：马马虎虎，最近正在看楼。A：-股识吧

一、量化交易主要有哪些经典的策略

研究量化投资模型的目的是找出那些具体盈利确定性的时空价格形态，其最重要手段的概率取胜，最重要的技术是概率统计，最主要的研究方向是市场行为心理。那么我们在选择用于研究的参数时，也应该用我们的经验来确定是否把某技术参数放进去，因为一般来说定性投资比较好用的参数指标对量化投资同样适用。

量化投资区别于传统定性投资的主要特征在于模型。

我打个比方，我们看病，中医与西医的诊疗方法是不同，中医是望、闻、问、切，最后判断出的结果，很大程度上基于中医的经验，主观定性程度大一些；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。

中医对医生的经验要求非常高，他们的主观判断往往决定了治疗效果，而西医则要从容得多，按事先规定好的程序走就行了。

量化投资就是股票投资中的西医，它可以比较有效地矫正理智与情绪的不兼容现象。

量化投资的一般思路：选定某些技术指标（我们称之为参数，往往几个组成一组），并将每一个参数的数据范围进行分割，成几等份。

然后，用计算机编程写出一段能对这些参数组对股票价格造成的影响进行数据统计的程序，连接至大型数据库进行统计计算，自动选择能够达到较高收益水平的参数组合。

但是选出这些参数组后还不能马上应用，因为这里涉及到一个概率陷阱的问题，比如说，有1到100这一百个数字放在那里，现在让你选择，请问你选到100的可能性是多大？是的，就是1/100，如果较幸运你选到了100并不能说明你比别人聪明，而是概率的必然。

所以，在进行统计时要特别关注统计的频率与选出的结果组数量之间的关系。

在选出符合要求的参数组后我们还应留出至少三年的原始市场数据进行验证，只有验证合格后才能试用。

量化投资原始数据策略：我们选用96年后的市场数据，因为96年股市有过一次交易政策改革（你可以自己查询了解一下），为了不影响研究结果我们不采纳96年以前的数据进数据库。

量化投资研究的硬设备：高计算性能电脑，家用电脑也可以，不过运算时间会很长，我曾经用家用电脑计算了三个月时间才得到想要的数据库。

统计方法：可以选用遗传算法，但我在这里陪大家做的是比较简单的模型，所以采

用普通统计方法就可以了。

用于量化研究的软件：我采用的是免费的大型数据库MYSQL，ASP网络编程语言，以及可以设置成网络服务器的旗舰版WIN7操作系统。

二、量化投资策略的优势有哪些

量化投资策略的优势有哪些?量化投资策略有如下五大方面的优势，主要包括纪律性、系统性、及时性、准确性、分散化等。

(1)纪律性：严格执行量化投资模型所给出的投资建议，而不是随着投资者情绪的变化而随意更改。

纪律性的好处很多，可以克服人性的弱点，如贪婪、恐惧、侥幸心理，也可以克服认知偏差，行为金融理论在这方面有许多论述。

(2)系统性：量化投资的系统性特征主要包括多层次的量化模型、多角度的观察及海量数据的观察等等。

多层次模型主要包括大类资产配置模型、行业选择模型、精选个股模型等等。

多角度观察主要包括对宏观周期、市场结构、估值、成长、盈利质量、分析师盈利预测、市场情绪等多个角度的分析。

(3)及时性：及时快速地跟踪市场变化，不断发现能够提供超额收益的新的统计模型，寻找新的交易机会。

(4)准确性：准确客观评价交易机会，克服主观情绪偏差，妥善运用套利的思想。

量化投资正是在找估值洼地，通过全面、系统性的扫描捕捉错误定价、错误估值带来的机会。

与定性投资经理不同，量化投资经理大部分精力花在分析哪里是估值洼地，哪一个品种被低估了，买入低估的，卖出高估的。

(5)分散化：在控制风险的前提下，充当准确实现分散化投资目标的工具。

分散化也可以说量化投资是靠概率取胜。

这表现为两个方面，一是量化投资不断的从历史中挖掘有望在未来重复的历史规律并且加以利用，这些历史规律都是有较大概率获胜的策略。

二是依靠筛选出股票组合来取胜，而不是一个或几个股票取胜，从投资组合理念来看也是捕获大概率获胜的股票，而不是押宝到单个股票上。

三、

四、如何合理利用私募基金量化选股策略

随着近期指数增强产品的兴起，量化选股的概念再一次进入了投资者的眼帘，伴随近些年国内量化投资的高速发展，量化选股策略早已大量应用在了私募产品的投资策略之中。

量化选股的定义简单来说，量化选股就是利用数量化的方法构建模型，进而选择股票组合，期望该股票组合能够获得超越基准收益率的投资方法。

量化选股为什么能赚钱？由于A股市场不是特别有效的市场，在非有效的市场下，量化模型对于市场微观交易机会的把握和处理是远强于人脑的，市场的非理性机会，各种各样的套利机会，很多都需要通过大量的数据统计和挖掘来发现。

另一方面，量化选股策略由于是程序化操作，其纪律性，客观性，准确性，及时性的特征，能够更好的把握市场机遇，不会受人为情绪因素所影响，而且对交易机会的发现和执行要比人为判断更加迅速。

再者，量化选股因为是通过数据挖掘，模型选股，所以构建的投资组合可以同时持有数百只股票，而且可以高频率的交易，这样能很好的起到分散风险并提高收益的作用。

量化选股的风险特征如何？一、市场中性策略 对于市场中性策略来说，其目标主要是通过量化选股的方法选出高阿尔法的股票构建组合，并做股指期货对冲。

以此来剥离股票组合的市场风险，并收获纯阿尔法收益。

所以一般情况下中性策略相对纯股票多头产品回撤风险要小，波动平滑，最大回撤一般较小，属于相对比较稳健的投资策略。

二、指数增强策略 市场上现在比较主流的指数增强策略主要由原来的市场中性策略演变而来，为了能够提高资金使用效率和搏取更高的收益，将市场中性策略中的股指期货对冲部分去除，直接构建股票纯多头组合，运用量化选股的方法选择一揽子股票，追踪指数，控制跟踪误差。

目的是在承担市场风险的前提下，获取能比市场指数更高的收益，不仅获取中性策略中所提供的纯阿尔法收益，也获取市场本身所带来的收益。

中天嘉华优财富平台通过深度调研甄选出市场中优质的理财产品，供理财师和投资者选择。

优财富平台产品种类丰富，包括固定收益、私募股权、私募证券、海外投资等多个投资品类。

产品交易结构透明、项目优势明显、不存在过度包装。

除了产品本身，优财富平台还为理财师提供了数以千计的产品投资组合以及相应的存续服务、高佣金、费用结算等服务，同时还会推出紧跟市场的投资策略和极具前瞻性的投资观点。

五、这两天股市暴跌，A：最近在哪里发财啊？B：炒炒股票。
A：做的怎么样？B：马马虎虎，最近正在看楼。A：

也还好，震荡而已。

参考文档

[下载：股票量化如何优化市场.pdf](#)

[《股票涨30%需要多久》](#)

[《股票涨30%需要多久》](#)

[《上市公司离职多久可以卖股票》](#)

[《股票账户多久不用会失效》](#)

[下载：股票量化如何优化市场.doc](#)

[更多关于《股票量化如何优化市场》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/author/40614550.html>