

量化cta策略是什么--量化选股策略是什么？多因子模型是什么-股识吧

一、量化策略在基金中是什么意思？

具体而言，数量化基金主要依赖计算机的数量化分析方法进行股票筛选，不需要依靠主观判断及个人意见对每只股票进行单独、深入的分析。

面对纷繁复杂的股市，量化基金系统化的组合构建能够极大减轻个人情绪对组合的影响，克服人性的弱点及认知偏差，避免在市场极度狂热或悲观的情况下做出非理性的投资决策，使选股过程更趋理性。

二、什么是CTA策略？期货CTA哪家做得好？富善致远CTA怎么样

CTA(Commodity Trading Advisors)商品交易顾问，通常也被称作管理期货基金，是由于其最初主要活跃于商品市场。

CTA基金起源于1949年，随着期货交易品种的不断扩展，CTA基金在资产的风险管理与运作方面显得日趋重要，很多机构投资者诸如养老金、信托基金等都开始大量采用CTA作为他们投资组合中的重要组成部分，并在优化组合、分散风险等方面取得了良好的效果。

 ;

 ;

 ;

就投资方法而言，CTA基金有两大类，一类是主观CTA，即由基金管理人基于基本面、调研或操盘经验，主观来判断走势，决定买卖时点；

第二大类是量化CTA，是通过分析建立数量化的交易策略模型，由模型产生的买卖信号进行投资决策。

 ;

 ;

 ;

很多人提到CTA基金的主要投资标的——期货，第一反应都是觉得期货带杠杆，风险大，但用量化的方法来投资期货能够在获取收益的同时很好的管理风险。

量化CTA能够很好的避免人为的主观的非理性，在出现亏损或回撤时能够及时的止损从而有效的规避风险，同时量化CTA基金能够产生规模效应，这也是在国内乃至海

外，量化逐渐成为CTA基金的主流交易方法。

 ;

 ;

 ;

Preqin Hedge的数据统计，在海外，2022年80%的CTA基金采用程序化交易，9%采用混合策略，仅11%的基金采用主观分析。

而在国内，根据期货资管网的统计，国内量化CTA占比约5成并呈稳步上扬的势头

。

 ;

 ;

 ;

 ;

 ;

 ;

 ;

量化CTA中用的比较多的策略是趋势交易策略，趋势交易就是用大量各种策略模型寻找当前的市场趋势，判断多空；

趋势策略可以说是无惧牛熊，只要有上涨或下跌的行情就能获利。

这种策略特别在牛熊快速转换或者趋势明确时，优势非常大。

总之，趋势在、收益就有。

但如果趋势不明显，或者是震荡市场，那么这种策略可能会因为来回不停的止损而出现回撤。

 ;

 ;

 ;

简单来说，量化CTA的收益和投资标的的涨跌无关，他和投资标的的涨幅或者跌幅有关，即在波动率很大的行情中容易获利。

用一个形象的比喻吧，投资标的的波动率是CTA基金获利的心电图，一马平川或者小幅来回震荡贡献不了收益率甚至会出现回撤，而波峰波谷频现大起大落的行情下，CTA就能大幅获利。

 ;

 ;

 ;

 ;

期货cta做的比较好的有：黑翼，富善，凯丰。

三、期货cta包括哪些策略

期货中主观策略就是就是以优秀交易员自身这个人为根本，相信人的丰富多彩人的盈利能力，人的感觉敏锐和判断，人的风控和管理能力而不是相信死物的所谓程序化冰冷的机器会代替人。

我就是人，一个主观的人。

期货的量化策略除非是做大规模的风险对冲交易或者套利交易或者跨市场跨国家海量资金做对冲才能算得上量化交易，把具体的现状现象各种资料进行数字化图形化变成一种有用数据进行金融工程式的交易。

国内全部所谓的量化策略，量化交易，程序化交易啥的，根本就是狗屁，完全就是自编概念自我神话所谓交易系统自抬身价自卖自夸彻底忽悠人，哪怕有一点点大概率盈利的可能它也不会让你投资分享利益，所以勿信这些鼓吹的。

四、期货中主观策略，量化策略是什么意思

期货中主观策略就是就是以优秀交易员自身这个人为根本，相信人的丰富多彩人的盈利能力，人的感觉敏锐和判断，人的风控和管理能力而不是相信死物的所谓程序化冰冷的机器会代替人。

我就是人，一个主观的人。

期货的量化策略除非是做大规模的风险对冲交易或者套利交易或者跨市场跨国家海量资金做对冲才能算得上量化交易，把具体的现状现象各种资料进行数字化图形化变成一种有用数据进行金融工程式的交易。

国内全部所谓的量化策略，量化交易，程序化交易啥的，根本就是狗屁，完全就是自编概念自我神话所谓交易系统自抬身价自卖自夸彻底忽悠人，哪怕有一点点大概率盈利的可能它也不会让你投资分享利益，所以勿信这些鼓吹的。

五、量化选股策略是什么？多因子模型是什么

量化选股就是利用数量化的方法选择股票组合，期望该股票组合能够获得超越基准收益率的投资行为，研究表明，板块、行业轮动在机构投资者的交易中最为获利的盈利模式是基于行业层面进行周期性和防御性的轮动配置，这也是机构投资者最普遍采用的策略。

此外，周期性股票在扩张性货币政策时期表现较好，而在紧缩环境下则支持非周期

性行业。

行业收益差在扩张性政策和紧缩性政策下具有显著的差异。

多因子模型是应用最广泛的一种选股模型，基本原理是采用一系列的因子作为选股标准，满足这些因子的股票则被买入，不满足的则卖出。

多因子模型相对来说比较稳定，因为在不同市场条件下，总有一些因子会发挥作用

。

参考文档

[下载：量化cta策略是什么.pdf](#)

[《社保基金打新股票多久上市》](#)

[《社保基金打新股票多久上市》](#)

[《股票卖出多久可以转账出来》](#)

[《股票挂单有效多久》](#)

[下载：量化cta策略是什么.doc](#)

[更多关于《量化cta策略是什么》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/book/75666017.html>